汇添富逆向投资混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富逆向投资混合
交易代码	470098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	609,842,845.31份
投资目标	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理,在科学严格的投资风险管理前提下,谋求基金资产长期稳健回报。
投资策略	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-254,308,346.54
2.本期利润	-644,654,951.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.9699
4.期末基金资产净值	1,029,485,541.18
5.期末基金份额净值	1.688

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

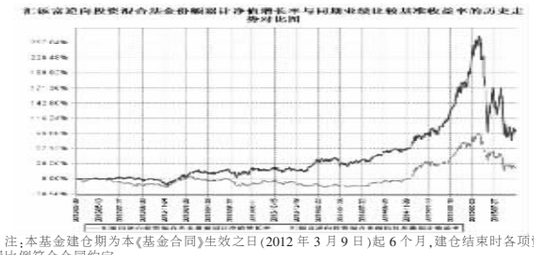
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-32.83%	4.75%	-22.60%	2.67%	-10.23%	2.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2012年3月9日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾耀强	汇添富策略回报混合基金、汇添富逆向投资混合基金、汇添富均衡增长混合基金的基金经理。	2012年3月9日	-	11年	国籍:中国,学历:清华大学管理学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员,海通证券股份有限公司行业分析师,中海基金管理有限公司高级分析师,基金经理助理,2009年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任高级行业分析师、基金经理助理,2009年12月22日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理,2012年3月9日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理,2014年4月8日至今任汇添富均衡增长混合基金的基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为1次,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度市场风云突变,出现了多次罕见的连续崩盘式下跌。导致市场大跌的因素很多,其中最重要的大概有这么几个:本身已经被杠杆吹得较大的股市泡沫;金融创新与市场相关制度、监管等基础设施的失衡;汇率改革引发的持续贬值预期;对实体经济恶化和改革进程放缓的担忧等。出于股市崩盘可能引发局部金融风险,国家开始干预市场,在降准降息、证金公司直接入市等组合拳作用下,到季度末市场才逐步企稳。

三季度本基金对市场走势的判断出现一定偏差,特别是对市场出现极端情况(去杠杆、大批股票停牌导致流动性冲击等)的预估不足,导致本基金组合结构和操作均出现一定的被动扭曲,阶段性净值损失较大,本基金认为市场最困难的时期已经过去,未来市场将逐步回归正常化,本基金将继续坚持逆向投资策略,并吸取此前教训,加强风险控制和流动性管理,努力为持有人获取稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年9月30日,本基金累积单位净值1.838元,三季度净值下跌-32.83%,成立以来累积收益率为83.8%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点,本基金认为四季度市场将呈现结构性行情。(1)流动性仍然极为宽松,股市相对配置价值提升。近期公司债和国债收益率的持续下行反映了流动性仍然极为宽裕。在实体经济疲弱、通缩和汇率压力较大的背景下,央行进一步降息降准的可能性也在加大。这将推动无风险收益率继续下行,股市的配置价值相应会不断提升。(2)上市公司整体业绩面临压力,但仍有一些局部亮点,如互联网相关、新能源、新兴消费等,能够实现较快的增长。此外大批上市公司在主业面临困境时积极寻求转型,通过并购等实现外延式增长。这些构成了结构性行情的基础。

从投资角度来看,我们看好三个方向的投资机会。(1)创新:与互联网相关的技术创新和模式创新(大数据、征信、供应链金融等)、工业4.0、新能源汽车等。(2)新消费与医疗服务:动漫、视频、体育等受益于80/90后逐步成长为消费主力带来的消费趋势变化而爆发;而受益于老龄化和医改,民营医院、连锁药店、医药流通等领域都有一批公司有望脱颖而出,实现稳定较快增长。(3)一些细分行业如养殖、化工等因为供求关系改善而带来的景气回升。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	955,483,000.66	92.43
	其中:股票	955,483,000.66	92.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,851,533.24	7.34
8	其他资产	2,351,018.35	0.23
9	合计	1,033,685,552.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	24,979,837.63	2.43
C	制造业	547,105,812.94	53.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,905,000.00	0.67
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	281,722,099.98	27.37
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,055,710.00	2.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,730,081.85	2.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,022,270.96	1.75
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	18,962,187.30	1.84
	合计	955,483,000.66	92.81

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002589	瑞康医药	4,398,534	140,093,307.90	13.61
2	600172	黄河旋风	5,999,920	87,118,838.40	8.46
3	600867	通化东宝	3,776,996	84,642,480.36	8.22
4	000906	物产中拓	5,979,218	68,521,838.28	6.66
5	002236	大华股份	1,522,051	51,460,544.31	5.00
6	002018	华信国际	2,237,968	48,429,627.52	4.70
7	002363	隆基机械	2,999,901	40,138,675.38	3.90
8	000059	*ST华锦	5,834,400	39,032,136.00	3.79
9	600305	恒顺醋业	1,780,000	35,333,000.00	3.43
10	002385	大北农	3,299,946	33,461,452.44	3.25

注:本基金持有的瑞康医药处于停牌状态,受基金净值波动影响,瑞康医药占基金资产净值比被动超过10%,本基金管理人将在该股票复牌后,按照法律法规及基金合同的相关规定及时做出调整。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,518,681.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,811.56
5	应收申购款	818,525.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,351,018.35

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002589	瑞康医药	140,093,307.90	13.61	重大事项停牌
2	002018	华信国际	48,429,627.52	4.70	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	827,514,019.47
报告期期间基金总申购份额	335,869,754.11
减:报告期期间基金总赎回份额	553,540,928.27
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	609,842,845.31

注:其中"总申购份额"含红利再投、转换入份额;"总赎回份额"含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富逆向投资混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富逆向投资混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富逆向投资混合型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富逆向投资混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年10月27日

汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富年年利定期开放债券
交易代码	000221
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月6日
报告期末基金份额总额	948,477,895.26份
投资目标	在追求本金安全的基础上,本基金力争创造超越业绩比较基准的长期稳健收益。
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制,本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	银行一年期定期存款税后利率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	汇添富年年利定期开放债券A / 汇添富年年利定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000221 / 000222
报告期末下属分级基金的份额总额	761,435,741.21份 / 187,042,154.05份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
1.本期已实现收益	3,315,093.02	1,958,127.85
2.本期利润	2,771,655.80	1,673,297.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0180	0.0188
4.期末基金资产净值	893,335,118.90	217,767,218.44
5.期末基金份额净值	1.173	1.164

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富年年利定期开放债券A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.73%	0.14%	0.78%	0.01%	0.95%	0.13%

汇添富年年利定期开放债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.66%	0.14%	0.78%	0.01%	0.88%	0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年9月6日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈加荣	汇添富双利债券基金、汇添富信用债债券基金、汇添富高息债债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。	2013年9月6日	-	14年	国籍:中国,学历:天津大学管理工程硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾在中国平安集团任债券研究员,交易员及本外币投资经理,国联安基金公司任基金经理助理,债券组合经理,农银汇理基金公司任固定收益投资负责人,2008年12月23日到2011年3月2日任农银汇理恒久增利债券基金的基金经理,2009年4月2日到2010年5月9日任农银汇理平衡双利混合基金的基金经理,2012年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任全融工程部高级经理,基金经理助理,2012年12月21日至2014年1月21日任汇添富收益快线货币基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富双利债券基金的基金经理,2013年2月7日至2015年8月28日任汇添富信用债债券基金的基金经理,2013年6月27日至今任汇添富高息债债券基金的基金经理,2013年9月6日至今任汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为1次,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度,债券市场方面,由于宏观经济走势低于预期,市场认识到经济更可能呈现"L"型走势,通胀尽管由于猪肉价格有所反弹,但不足惧,为维稳经济、降低社会融资成本,央行应该偏向进一步放松。与此同时,在股市暴跌打击投资者风险偏好的情况下,资金陆续转向债券市场。银行间7天回购利率下行50bp,10年期国开债收益率下行39bp,7年AA评级城投债收益率下行54bp。类权益类市场方面,受估值偏高、清理配资以及救市博弈的多重影响,上证综指下跌24.68%,创业板下跌22.57%,可转债跟随正股调整,但在转债整体稀缺以及转债基金等最低仓位要求的支撑下,转债跌幅相对较小,中证转债下跌11.56%。

本基金针对市场变化,一般债券方面,3季度前期大力增仓利率债,保持信用债高仓位,到季度后期,考虑到即将开放,随一些债券到期,适当降低仓位。很好地把握住了市场机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年3季度本基金A级净值收益率为1.73%,C级净值收益率为1.66%,同期业绩比较基准收益率为0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,经济大概率继续"L"型走势,市场可能开始关注通缩风险,央行继续放松,政府刺激经济的力度可能加大。债券市场仍有空间。权益类市场在目前估值趋向合理、对经济前景预期差可能转好以及市场风险偏好可能略有提升的情况下,最悲观的阶段应该已经过去,前景值得期待。从更长期看,TPP等引发市场对中国前景的热议,我们相信我们中国人的智慧,明天更好。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	843,027,139.32	72.99
	其中:债券	838,027,139.32	72.56
	资产支持证券	5,000,000.00	0.43
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	70,000,225.00	6.06
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	77,271,164.29	6.69
7	其他资产	164,627,675.20	14.25
8	合计	1,154,926,203.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,062,700.00	10.63
	其中:政策性金融债	118,062,700.00	10.63
4	企业债券	224,191,860.82	20.18
5	企业短期融资券	491,583,000.00	44.24
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,189,578.50	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	838,027,139.32	75.42

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150210	15国开10	600,000	62,424,000.00	5.62
2	041554007	15洋河CP001	500,000	50,600,000.00	4.55
3	011599281	15雅砻江SCP001	500,000	50,160,000.00	4.51
4	011590008	15苏交通SCP008	500,000	50,025,000.00	4.50
5	011599639	15龙源电力SCP009	500,000	49,995,000.00	4.50

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119109	14新盛01	50,000	5,000,000.00	0.45

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,987.67
2	应收证券清算款	1,050.69
3	应收股利	-
4	应收利息	14,837,202.44
5	应收申购款	149,786,434.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	164,627,675.20

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	558,699.00	0.05
2	110030	格力转债	110,627.50	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	127,164,520.24	85,848,478.77
报告期期间基金总申购份额	696,650,556.14	151,919,558.48
减:报告期期间基金总赎回份额	62,379,335.17	50,725,883.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	761,435,741.21	187,042,154.05

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金合同》;

3、《汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼汇添富基金管理股份有限公司

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年10月27日

汇添富全额宝货币市场基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富全额宝货币
交易代码	000397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月13日
报告期末基金份额总额	10,657,654,548.41份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	94,534,750.74
2.本期利润	94,534,750.74
3.期末基金资产净值	10,657,654,548.41

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

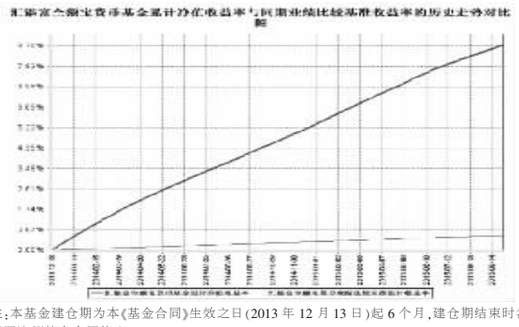
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8795%	0.0021%	0.0882%	0.0000%	0.7913%	0.0021%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年12月13日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汤丛珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富添通货币基金的基金经理。	2013年12月13日	-	7年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士,相关业务资格:基金从业资格,从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员、固定收益交易主管,2013年7月31日至今任汇添富货币基金的基金经理,2013年12月13日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至今任汇添富理财30天债券、理财60天债券基金的基金经理,2014年5月28日至2015年7月30日任汇添富和聚宝货币基金