# 汇添富添富通货币市场基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月21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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 汇添富添富通货币 | | |
| 交易代码 | 000366 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2015年1月16日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 5,736,224,277.45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、混合型基金和债券型基金。 | | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富添富通货币A | 汇添富添富通货币B | 汇添富添富通货币E |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - | 现金添富 |
| 下属分级基金的交易代码 | 000366 | 000980 | 511980 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 378,071,242.70份 | 5,239,385,349.14份 | 118,767,685.61份 |

注:1、汇添富添富通货币市场基金E类合同生效日为2015年10月16日;
2、汇添富添富通货币市场基金E类份额上市交易;
3、本基金A类、B类份额面值为人民币100元。

§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10月1日 — 2015年12月31日) | | |
|---|---|---|---|
| | 汇添富添富通货币A | 汇添富添富通货币B | 汇添富添富通货币E |
| 1. 本期已实现收益 | 2,502,055.00 | 23,777,215.55 | 46,146,991.03 |
| 2. 本期利润 | 2,502,055.00 | 23,777,215.55 | 46,146,991.03 |
| 3. 期末基金资产净值 | 378,071,242.70 | 5,239,385,349.14 | 11,876,768,560.58 |

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。由于货币市场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。
2、本基金收益分配按日结转份额。
3、自2015年10月16日起,汇添富添富通货币市场基金增设E类份额类别,本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

汇添富添富通货币A

| 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 | 0.6671% | 0.0013% | 0.0882% | 0.0000% | 0.5789% | 0.0013% |

汇添富添富通货币B

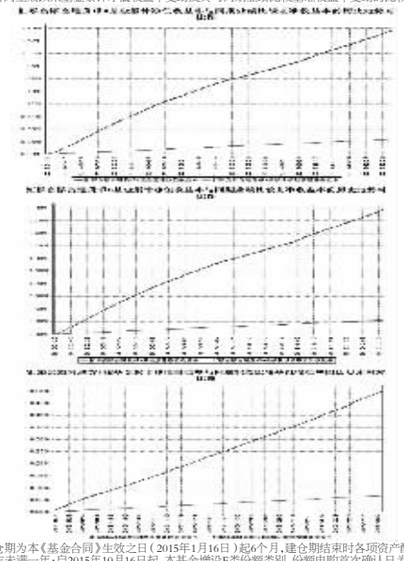
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.7281% | 0.0013% | 0.0882% | 0.0000% | 0.6399% | 0.0013% |

汇添富添富通货币E

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效日起至今 | 0.4999% | 0.0013% | 0.0681% | 0.0000% | 0.4318% | 0.0013% |

注:汇添富添富通货币市场基金E类合同生效日为2015年10月16日。

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(2015年1月16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,至本报告期末未满一年;自2015年10月16日起,本基金增设E类份额类别,份额申购首次确认日为2015年10月22日。

§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 | | |
| 汤从珊 | 汇添富货币基金、汇添富金额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富添富通货币基金的基金经理。 | 2015年1月16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日至今任汇添富金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的基金经理,2015年1月16日至今任汇添富添富通货币基金(原汇添富新收益债券基金)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2次,是组合投资策略原因导致。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

2015年四季度经济下行压力仍然较大,央行维持较为宽松的货币政策,资金利率低位运行。10月以来,由于季末因素的消除,资金面趋于宽松,存款收益率逐步下行,短融收益率也在资金成本下行的带动下走低,同时10月央行再次降准降息,使得货币市场利率水平进一步走低,流动性宽裕。11月初lpo宣布重启,年内28支新股按照原有规则缴款发行,对市场心理震动影响比较大,优质短融收益率一度上行超过9月底的利率高点,出现比较好的配置时点,lpo落地后,由于宽松的资金面和市场的提前反应,资金冲结期间资金面并没有太大冲击,短融收益率逐步回落,成交踊跃。12月有年末因素的干扰,出现比较好的存款配置时点,但资金面整体宽松,货币市场利率仍处于下行通道之中。

本基金在报告期安排了较大比例的流动性于月末、季末等可能发生流动性紧张的时点滚动操作,在短融收益率高企的时点战略性建仓,并持续改善组合持仓中短融的流动性。通过短融的波段性操作和合理错配存款到期日,在保证组合整体流动性的前提下,抓住资金利率高企的时间窗口锁定高息存款和优质短融提高组合收益率。通过这些前瞻性的操作,本基金有效应对了组合的规模变化,确保了组合的流动性和和合法合规运作,并抓住关键时点锁定了一部分较高收益的同业存款和短期债券获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金A类净值收益率为0.6671%,B类净值收益率为0.7281%,业绩比较基准收益率为0.0882%;本基金E类净值收益率为0.4999%,业绩比较基准收益率为0.0681%。

4.5 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 | 固定收益投资 | 5,998,537,898.71 | 34.28 |
| | 其中:债券 | 5,998,537,898.71 | 34.28 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 900,102,496.60 | 5.14 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 99,999,896.45 | 0.57 |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 10,521,579,802.19 | 60.13 |
| 4 | 其他资产 | 77,878,563.17 | 0.45 |
| 5 | 合计 | 17,498,098,760.67 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 3.10 |
| | 其中:买断式回购融资 | | 0.00 |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中:买断式回购融资 | 0.00 | 0.00 |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 95 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 105 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 45 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同规定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 22.41 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 12.68 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 26.73 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 22.01 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 15.75 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.58 | - |

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 | 摊余成本(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 | 630,832,370.57 | 3.61 |
| | 其中:政策性金融债 | 630,832,370.57 | 3.61 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 3,384,476,093.48 | 19.35 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,983,229,434.66 | 11.34 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 5,998,537,898.71 | 34.29 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 111519107 | 15恒丰银行CD107 | 3,000,000 | 297,959,405.78 | 1.70 |
| 2 | 111508212 | 15中信CD212 | 3,000,000 | 295,423,874.39 | 1.69 |
| 3 | 150419 | 15农发19 | 2,000,000 | 200,338,677.95 | 1.15 |
| 4 | 111509270 | 15浦发CD270 | 2,000,000 | 199,472,854.95 | 1.14 |
| 5 | 111508170 | 15中信CD170 | 2,000,000 | 199,456,404.07 | 1.14 |
| 6 | 111592734 | 15成都银行CD041 | 2,000,000 | 198,956,839.29 | 1.14 |
| 7 | 111593318 | 15盛京银行CD100 | 2,000,000 | 198,532,599.08 | 1.13 |
| 8 | 111593371 | 15徽商银行CD138 | 2,000,000 | 196,909,139.34 | 1.13 |
| 9 | 041558092 | 15远东租赁CP001 | 1,500,000 | 150,029,181.27 | 0.86 |
| 10 | 041554007 | 15洋河CP001 | 1,300,000 | 130,583,180.88 | 0.75 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0652% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0115% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0330% |

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3

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。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 77,878,563.17 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 77,878,563.17 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 汇添富添富通货币A | 汇添富添富通货币B | 汇添富添富通货币E |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 407,326,434.44 | 6,229,833,185.87 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 638,772,048.76 | 4,584,389,542.29 | 229,506,241.91 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 668,027,240.50 | 5,574,837,379.02 | 110,738,556.30 |
| 报告期期末基金份额总额 | 378,071,242.70 | 5,239,385,349.14 | 118,767,685.61 |

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。本基金E类合同生效日为2015年10月16日,基金份额面值为人民币100元,本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§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添富通货币市场基金募集的文件;
2、《汇添富添富通货币市场基金基金合同》;
3、《汇添富添富通货币市场基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、报告期内汇添富添富通货币市场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
2016年1月21日

# 汇添富现金宝货币市场基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月21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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富现金宝货币 |
| 交易代码 | 000330 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年9月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 44,066,963,421.79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 | 中国工商银行股份有限公司 |

§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10月1日 — 2015年12月31日) |
|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | 307,691,200.37 |
| 2. 本期利润 | 307,691,200.37 |
| 3. 期末基金资产净值 | 44,066,963,421.79 |

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。

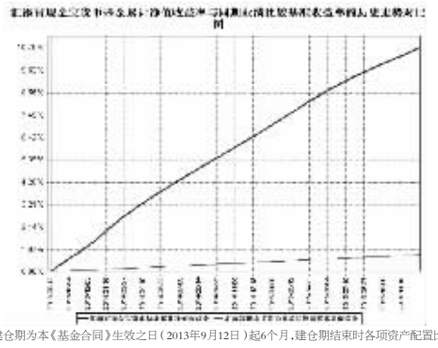
3.2 基金净值表现

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 | 0.7645% | 0.0010% | 0.0882% | 0.0000% | 0.6763% | 0.0010% |

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9月12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 | | |
| 蒋文玲 | 汇添富现金宝、理财14天、理财21天基金的基金经理、汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。 | 2015年3月10日 | - | 9年 | 国籍:中国,学历:上海财经大学经济学硕士,业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员,2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理,2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理助理,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财21天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2次,是组合投资策略原因导致。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

四季度宏观经济基本面仍无好转,工业增加值继续探底,固定资产投资仍在10%附近的增长率徘徊,进出口数据有所修复,但对经济拉动作用有限。央行在货币政策上继续推行积极的放松措施,包括"双降",下调公开市场操作的利率等,四季度债市涨势较好,其中10年金融债由3.7%大幅下行60个基点至3.1%左右,创全年新低。

与三季末相比,本基金规模继续上升,考虑到资金宽松局面仍将延续,本基金在投资策略上适当运用杠杆,拉长久期,增加了短融和大额同业存单的配置,并尽可能抓住重要时点,进行波段操作,为投资人获取更好的收益。在个券选择方面,回避可能有信用风险的中低评级债券,以流动性较好的AA+和AAA以上债券为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年四季度本基金净值收益率为0.7645%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.5 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 | 固定收益投资 | 17,297,935,316.64 | 39.24 |
| | 其中:债券 | 17,297,935,316.64 | 39.24 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 170,000,575.00 | 0.39 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 26,293,152,309.23 | 59.64 |
| 4 | 其他资产 | 324,076,442.68 | 0.74 |
| 5 | 合计 | 44,085,164,643.55 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 4.56 |
| | 其中:买断式回购融资 | | 0.00 |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 117 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 82 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 16.51 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.02 | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 9.62 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 23.15 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 1.09 | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 28.73 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 20.85 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 98.86 | - |

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 | 摊余成本(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 | 3,028,375,327.65 | 6.87 |
| | 其中:政策性金融债 | 3,028,375,327.65 | 6.87 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 12,322,765,892.87 | 27.96 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,946,794,096.12 | 4.42 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 17,297,935,316.64 | 39.25 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 489,154,496.80 | 1.11 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 041556022 | 15电网CP002 | 6,300,000 | 629,603,993.80 | 1.43 |
| 2 | 111508166 | 15中信CD166 | 5,000,000 | 498,682,137.34 | 1.13 |
| 3 | 111593340 | 15苏州银行CD024 | 5,000,000 | 496,291,033.75 | 1.13 |
| 4 | 011537008 | 15中建材SCP008 | 4,500,000 | 450,684,840.39 | 1.02 |
| 5 | 041551063 | 15联通CP001 | 4,500,000 | 449,734,707.90 | 1.02 |
| 6 | 011599692 | 15陕延油SCP003 | 4,000,000 | 400,983,624.27 | 0.91 |
| 7 | 150413 | 15农发13 | 4,000,000 | 400,138,134.37 | 0.91 |
| 8 | 130242 | 13国开42 | 3,100,000 | 312,354,455.71 | 0.71 |
| 9 | 130241 | 13国开41 | 3,100,000 | 310,562,206.40 | 0.70 |
| 10 | 150211 | 15国开11 | 3,000,000 | 300,433,267.32 | 0.68 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1608% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0941% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1295% |

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 324,076,442.68 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 324,076,442.68 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 43,559,197,644.82 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 167,379,441,642.56 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 166,871,675,865.59 |
| 报告期期末基金份额总额 | 44,066,963,421.79 |

注:总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 22-申购 | 2015年10月12日 | 150,000,000.00 | 150,000,000.00 | 0.00% |
| 2 | 24-赎回 | 2015年10月19日 | 20,000,000.00 | -20,000,000.00 | 0.00% |
| 3 | 24-赎回 | 2015年10月22日 | 20,000,000.00 | -20,000,000.00 | 0.00% |
| 4 | 24-赎回 | 2015年10月22日 | 20,000,000.00 | -20,000,000.00 | 0.00% |
| 5 | 22-申购 | 2015年10月27日 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | 0.00% |
| 6 | 22-申购 | 2015年11月3日 | 80,000,000.00 | 80,000,000.00 | 0.00% |
| 7 | 22-申购 | 2015年11月4日 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | 0.00% |
| 8 | 24-赎回 | 2015年11月18日 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | 0.00% |
| 9 | 24-赎回 | 2015年11月18日 | 20,000,000.00 | -20,000,000.00 | 0.00% |
| 10 | 24-赎回 | 2015年11月20日 | 60,000,000.00 | -60,000,000.00 | 0.00% |
| 11 | 24-赎回 | 2015年11月20日 | 70,000,000.00 | -70,000,000.00 | 0.00% |
| 12 | 24-赎回 | 2015年11月20日 | 70,000,000.00 | -70,000,000.00 | 0.00% |
| 13 | 22-申购 | 2015年12月4日 | 180,000,000.00 | 180,000,000.00 | 0.00% |
| 14 | 22-申购 | 2015年12月10日 | 150,000,000.00 | 150,000,000.00 | 0.00% |
| 15 | 24-赎回 | 2015年12月18日 | 160,000,000.00 | -160,000,000.00 | 0.00% |
| 16 | 24-赎回 | 2015年12月28日 | 80,000,000.00 | -80,000,000.00 | 0.00% |
| 合计 | | | 1,150,000,000.00 | 90,000,000.00 | |

§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现金宝货币市场基金募集的文件;
2、《汇添富现金宝货币市场基金基金合同》;
3、《汇添富现金宝货币市场基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、报告期内汇添富现金宝货币市场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
2016年1月21日

# 汇添富外延增长主题股票型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月21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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富外延增长股票 |
| 交易代码 | 000925 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年12月8日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,923,607,680.69份 |
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选外延增长主题股票,重点挖掘外延式增长的投资机会,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金为股票型基金,投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略,其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘通过持续重组活动实现企业外延式增长的上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×80%+中债综合指数×20% |
| 风险