

汇添富添富通货币市场基金 2015 年半年 度报告摘要

2015 年 6 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 8 月 29 日

§1 重要提示

1.1 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 8 月 27 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。

汇添富添富货币市场基金由汇添富新收益债券型证券投资基金转型而来。2015 年 1 月 9 日汇添富新收益债券型证券投资基金以现场方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于汇添富新收益债券型证券投资基金转型的议案》，内容包括汇添富新收益债券型证券投资基金调整基金投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、估值方法以及修订基金合同等，并同意将汇添富新收益债券型证券投资基金更名为“汇添富添富货币市场基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2015 年 1 月 16 日起，《汇添富添富货币市场基金基金合同》生效，《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》同日起生效。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原汇添富新收益债券型证券投资基金报告期自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日止，汇添富添富货币市场基金报告期自 2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型前:	
基金简称	汇添富新收益债券
基金主代码	000366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 10 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
报告期末基金份额总额	15,081,956.52 份
基金合同存续期	不定期

注：上表中“报告期末”指2015年1月15日。

转型后:		
基金简称	汇添富添富货币	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	541,487,368.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富添富货币 A	汇添富添富货币 B
下属分级基金的交易代码	000366	000980
报告期末下属分级基金的份额总额	457,938,197.69 份	83,549,171.29 份

注：上表中“报告期末”指2015年6月30日。

2.2 基金产品说明

转型前:	
投资目标	本基金主要投资于债券资产，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上适度参与权益类品种投资，力争实现资产的长期稳定增值。
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%；股票资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，持有的现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金通过参与一级市场新股申购、股票增发，以及因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票，不超过基金资产的 20%；本基金通过二级市场直

本期已实现收益	32,218.34
本期利润	2,428.34
加权平均基金份额本期利润	0.0001
本期基金份额净值增长率	0.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年1月15日)
期末可供分配基金份额利润	0.0882
期末基金资产净值	16,411,447.28
期末基金份额净值	1.088

注：1、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。

2、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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

4、汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富货币市场基金。截至本报告期末(2015 年 6 月 30 日)，汇添富添富货币市场基金转型时间未满半年。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 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

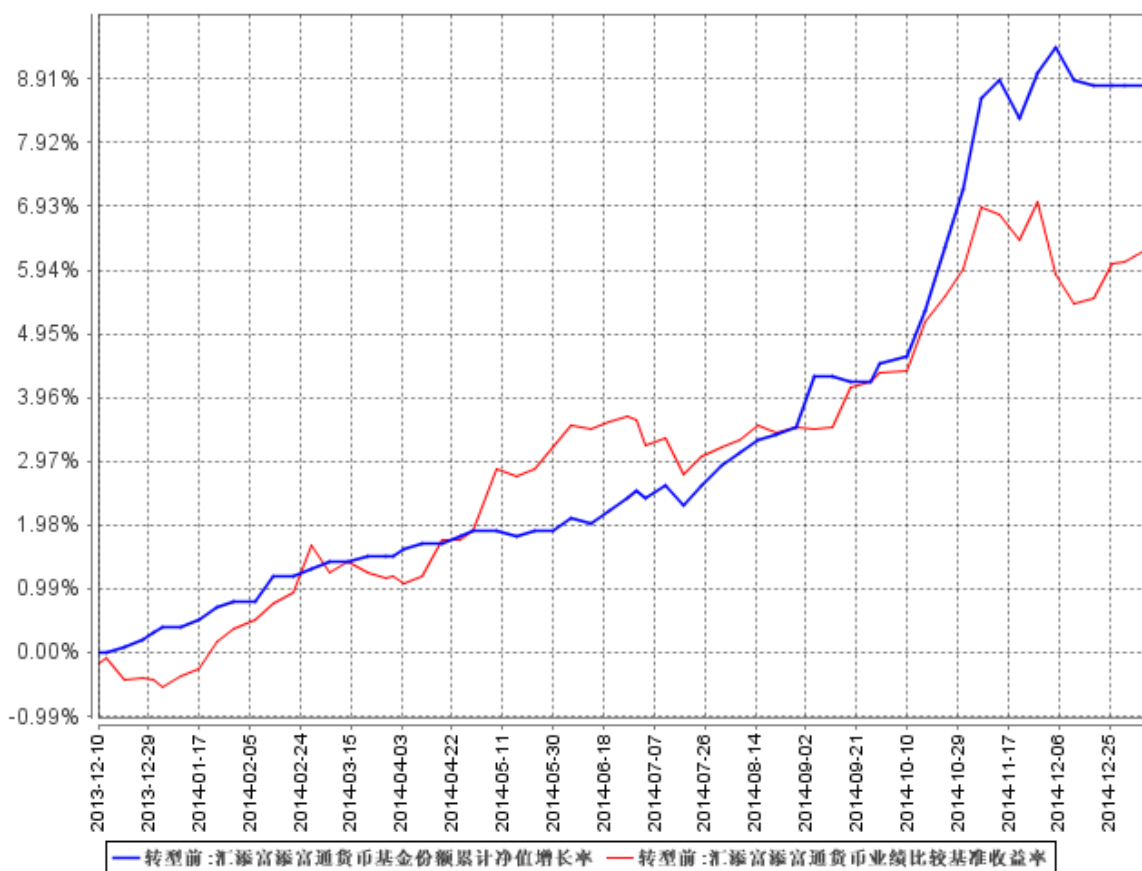
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自 2014-12-16 至 2015-01-15	-0.07%	0.06%	1.20%	0.06%	-1.27%	0.00%
自 2014-10-16 至 2015-01-15	3.74%	0.18%	1.61%	0.16%	2.13%	0.02%
自 2014-07-16 至 2015-01-15	6.17%	0.15%	3.30%	0.13%	2.87%	0.02%
自 2015-01-01 至 2015-01-15	0.02%	0.02%	0.53%	0.05%	-0.51%	-0.03%
自 2014-01-16 至 2015-01-15	8.28%	0.12%	6.94%	0.11%	1.34%	0.01%
自 2013-12-10 至 2015-01-15	8.82%	0.11%	6.64%	0.11%	2.18%	0.00%

01-15					
-------	--	--	--	--	--

注：汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富货币市场基金, 本表列示的是基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为中债综合指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

汇添富添富货币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富货币市场基金。

3.3 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

基金级别	汇添富添富货币 A	汇添富添富货币 B
3.3.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 16 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 16 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,378,088.02	2,849,131.52
本期利润	2,378,088.02	2,849,131.52

本期净值收益率	1.5271%	1.6103%
3.3.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	457,938,197.69	83,549,171.29
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注：1、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。

2、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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

4、汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富货币市场基金。截至本报告期末(2015 年 6 月 30 日)，汇添富添富货币市场基金转型时间未满半年。

3.4 基金净值表现（转型后）

3.4.1 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

汇添富添富货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2367%	0.0032%	0.0288%	0.0000%	0.2079%	0.0032%
过去三个月	0.7729%	0.0021%	0.0873%	0.0000%	0.6856%	0.0021%
自基金合同生效日起至今	1.5271%	0.0022%	0.1592%	0.0000%	1.3679%	0.0022%

汇添富添富货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2560%	0.0032%	0.0288%	0.0000%	0.2272%	0.0032%
过去三个月	0.8325%	0.0021%	0.0873%	0.0000%	0.7452%	0.0021%
自基金合同生效日起至今	1.6103%	0.0026%	0.1592%	0.0000%	1.4511%	0.0026%

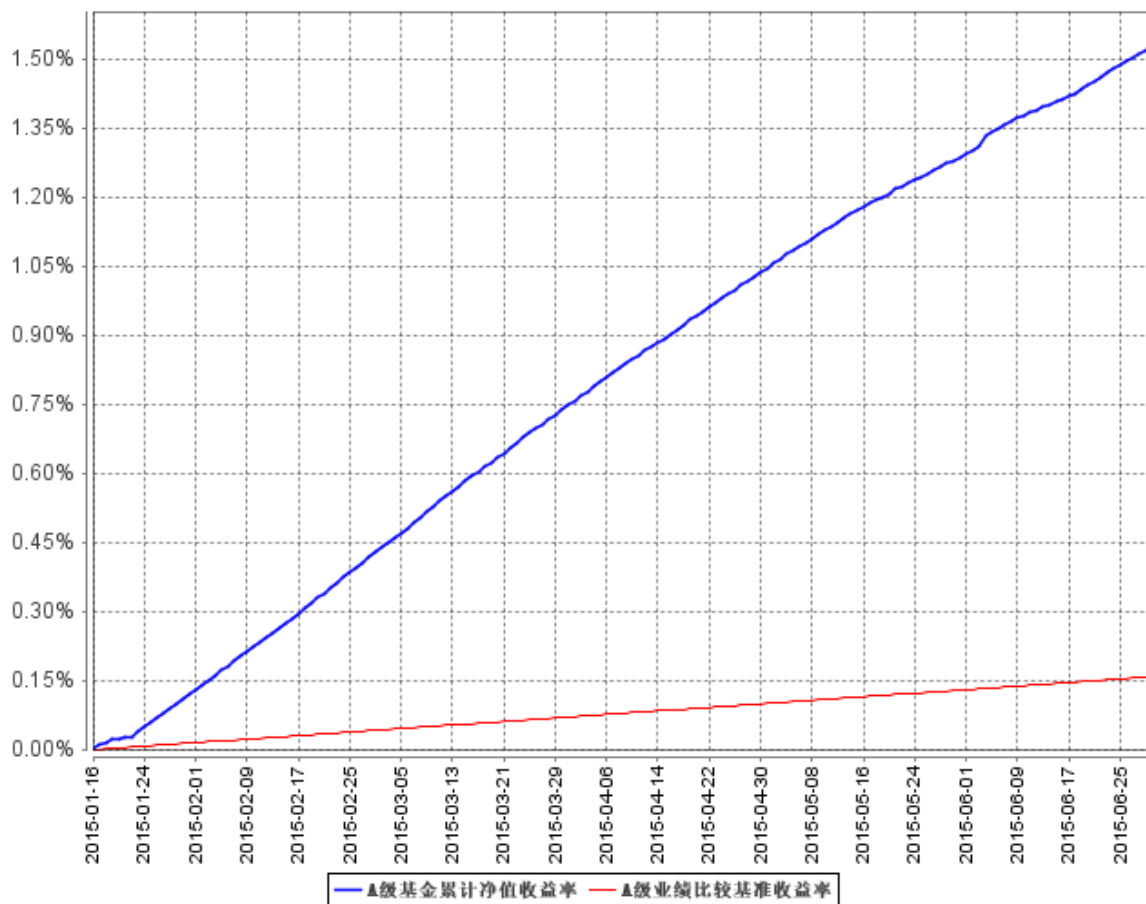
注：1、汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富货币市场基金，本表列示的是基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

2、过去一个月指 2015 年 6 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日，过去三个月指 2015 年 4 月 1 日至

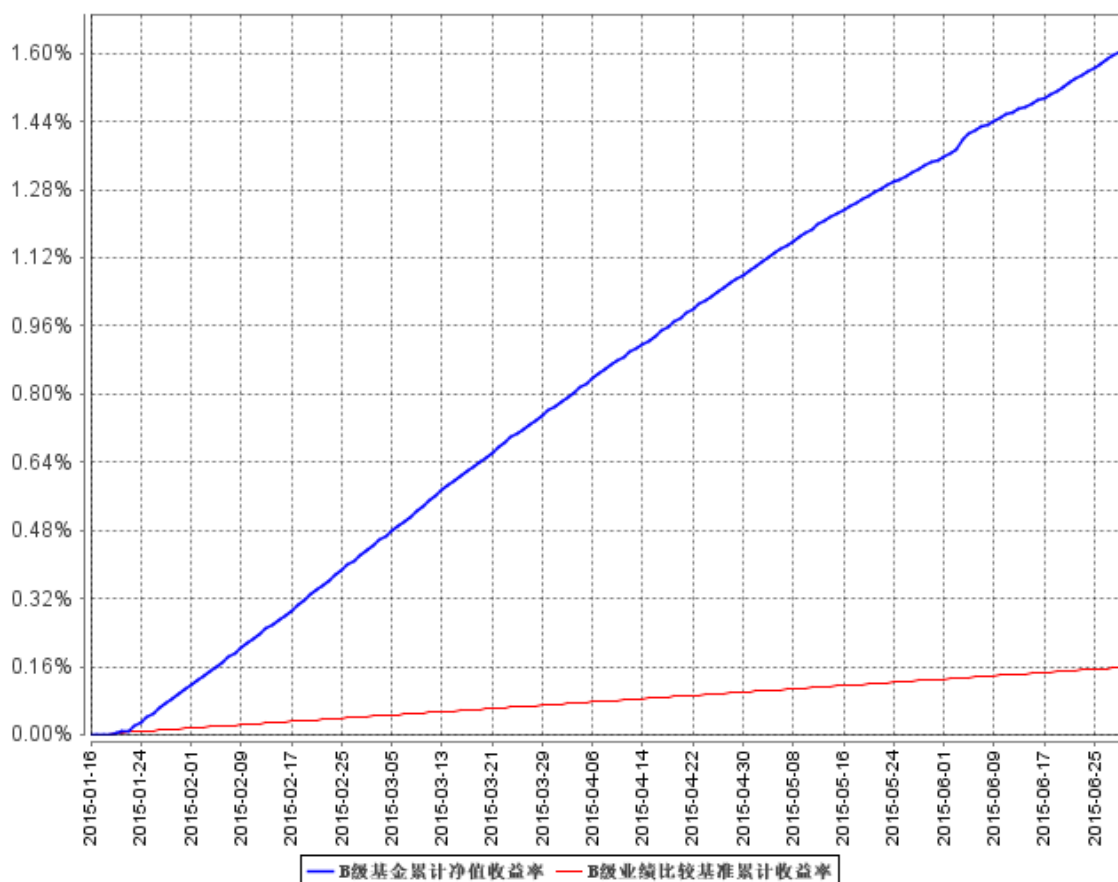
2014 年 6 月 30 日。

3.4.2 自基金转型以来基金份额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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：汇添富添富货币市场基金由汇添富新收益债券型证券投资基金转型而来。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本为1亿元人民币。截止到2015年6月30日，公司管理证券投资基金规模约2,198.54亿元，有效客户数约600万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理53只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄

金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁珂	汇添富可转换债券基金、汇添富新收益债券基金的基金经理。	2013 年 12 月 11 日	2015 年 1 月 15 日	7 年	国籍：中国。学历：北京大学概率论及数理统计学学士、硕士，经济学双学位。相关业务资格：基金从业资格，特许金融分析师（CFA）。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。2012 年

					<p>11 月加入汇添富基金管理股份有限公司从事固定收益研究。</p> <p>2013 年 3 月 28 日至今任汇添富可转换债券债券的基金经理，</p> <p>2013 年 12 月 10 日至 2015 年 1 月 15 日任汇添富新收益债券基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、汇添富余额宝货币基金、汇添富理财 30 天债券基金、汇添富理财	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

	<p>60 天债券基金、汇添富和聚宝货币基金、汇添富添富货币基金的基金经理。</p>			<p>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 日至今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货币基</p>
--	--	--	--	---

					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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，是由于投资流动性的需求导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对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 一季度经济下行压力仍然较大，3 月金融数据比较疲弱，出口数据较弱，社融的非信贷部分继续萎缩。整个一季度来看，货币条件没有如市场预期放松甚至继续收紧，包括货币增速仍处于下滑通道，叠加综合有效汇率偏强以及实际利率偏高，对经济不利，前期的稳增长政策对经济周期的影响不足。虽然央行采取宽松的货币政策，但实际利率并未如预期引导下行，且受到股票 IPO 和股市上涨的挤压效应影响，银行间流动性较紧，协议存款利率持续较高。现券方面，由于资金成本较高和流动性冲击的影响，短融收益率逐步上行，信用利差有所扩大。

2015 二季度央行维持较为宽松的货币政策，引导资金利率下行。2015 年 4 月以来，资金面迅速放松，尤其短期回购利率出现了大幅的下行，同时带动存款利率和短融利率下行，资金面有加速宽松的趋势，市场在资金利率低位加杠杆以短养长。短期融资券收益率快速回落后在 5 月中旬开始反弹，尤其是在一级发行压力持续，IPO 冲击时反弹明显，期限利差和信用利差回升。机构对资金面的乐观预期也使得 6 月初 IPO 对资金利率的扰动明显，6 月中下旬季末因素和 IPO 的叠加使得市场出现较好的锁定中长期存款和建仓短融的机会。

本基金在报告期安排了较大比例的流动性于 IPO 期间和月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

自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日，汇添富新收益债券型证券投资基金的净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准增长率为 0.53%。

自 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日，汇添富汇添富添富货币市场基金的 A 级净值增长率为 1.5271%，同期业绩比较基准增长率为 0.1592%。B 级净值增长率 1.6103%，同期业绩比较基准增长率为 0.1592%。

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 2015 年下半年，货币市场短期资金成本和资金面的稳定性已经成为短期债券利率快速下行的推手。央行目前还维持宽松的货币环境，货币政策还有空间，下半年债市仍有较好的交易性机会，但需要紧密观察经济复苏的情况以判断货币政策放松的幅度和速度。

同时 7 月初以来，半年末效应消除，打新暂停，部分打新资金暂时重回债市，资金面重回宽松的态势，同时股市大跌使得投资者风险偏好降低，腾出部分仓位配置短期信用债，短融收益率和存款利率将快速下行，信用利差压缩，挑战 5 月的利率低点。同时，由于 IPO 只是暂停，且下半年资金面相对上半年更为谨慎，如果市场情绪过于乐观，需要防范资金的超预期收紧带来的收益率波动。

鉴于此，本基金将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下，综合分析本基金的份额变动，提前做好债券与存款之间的配置计划，保持组合的较高流动性和安全性，积极把握市场结构性机会，通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位博取资本利得收入为投资者创造更多额外收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中进行支付。

2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日期间累计分配收益 5,227,219.54 元，均为以红利再投资方式结转入实收基金。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富添富货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富添富货币市场基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富添富货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富添富货币市场基金 2015 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 转型前

6.1.1 资产负债表

会计主体：汇添富新收益债券证券投资基金

报告截止日：2015 年 1 月 15 日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	16,355,986.07	1,357,942.88
结算备付金	369,736.67	210,008.87
存出保证金	8,252.65	8,920.25
交易性金融资产	-	20,028,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	-	20,028,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	2,645,725.57
应收利息	6,514.11	643,210.01
应收股利	-	-
应收申购款	-	52,476.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	16,740,489.50	24,946,283.82
负债和所有者权益	本期末	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	500,679.41
应付管理人报酬	9,391.19	22,726.80
应付托管费	2,683.19	6,493.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,351.49	1,001.49
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	315,616.35	300,225.51
负债合计	329,042.22	831,126.58
所有者权益：		
实收基金	15,081,956.52	22,164,804.22
未分配利润	1,329,490.76	1,950,353.02
所有者权益合计	16,411,447.28	24,115,157.24
负债和所有者权益总计	16,740,489.50	24,946,283.82

报告截止日 2015 年 1 月 15 日，基金份额净值 1.088 元，基金份额总额 15,081,956.52 份。

6.1.2 利润表

会计主体：汇添富新收益债券证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	30,474.07	4,678,787.94
1.利息收入	32,904.10	3,047,522.84
其中：存款利息收入	4,997.25	1,638,464.73
债券利息收入	27,906.85	532,308.01
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	876,750.10
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	18,270.00	1,248,215.01
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	18,270.00	1,248,215.01
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-29,790.00	299,533.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	9,089.97	83,516.93
减：二、费用	28,045.73	945,186.17
1. 管理人报酬	9,391.19	560,197.18
2. 托管费	2,683.19	160,056.32

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	350.00	986.58
5. 利息支出	-	12,599.62
其中：卖出回购金融资产支出	-	12,599.62
6. 其他费用	15,621.35	211,346.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,428.34	3,733,601.77

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富新收益债券证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,164,804.22	1,950,353.02	24,115,157.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,428.34	2,428.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-7,082,847.70	-623,290.60	-7,706,138.30
其中：1.基金申购款	28,617,982.60	2,518,382.47	31,136,365.07
2.基金赎回款	-35,700,830.30	-3,141,673.07	-38,842,503.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	15,081,956.52	1,329,490.76	16,411,447.28
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	398,350,312.89	1,223,115.00	399,573,427.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	3,733,601.77	3,733,601.77

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-326,448,843.06	-3,190,972.03	-329,639,815.09
其中：1.基金申购款	4,358,464.03	54,211.08	4,412,675.11
2.基金赎回款	-330,807,307.09	-3,245,183.11	-334,052,490.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	71,901,469.83	1,765,744.74	73,667,214.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 张晖	_____ 陈灿辉	_____ 韩从慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

汇添富新收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1197号文《关于核准汇添富新收益债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2013年11月18日至2013年12月6日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第60466941_B60号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年12月10日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币398,301,585.21元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币48,727.68元，以上实收基金(本息)合计人民币398,350,312.89元，398,350,312.89份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于债券资产，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上，适度参与权益类品种投资，力争实现资产的长期稳定增值。本基金业绩比较基准：中债综合指数。

6.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.1.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.1.5 税项

印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得

全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

6.1.5.1 关联方关系

6.1.5.1.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.1.5.1.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批的关键管理人

6.1.5.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.5.2.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.5.2.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末和上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行股票交易。

6.1.5.2.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年1月15日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
东方证券股份 有限公司	-	-	283,049,874.51	100.00%

6.1.5.2.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年1月15日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东方证券股份 有限公司	-	-	5,133,500,000.00	100.00%

6.1.5.2.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末和上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行权证交易。

6.1.5.2.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期末和上年度可比期间均未有应支付关联方佣金。

6.1.5.2.2 关联方报酬

6.1.5.2.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 1月15日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	9,391.19	560,197.18
其中：支付销售机构的 客户维护费	1,746.34	173,661.25

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每个月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

6.1.5.2.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年1月15日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付 的托管费	2,683.19	160,056.32

6.1.5.2.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

6.1.5.2.4 各关联方投资本基金的情况

6.1.5.2.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.1.5.2.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度可比期间未投资本基金。

6.1.5.2.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年1月15日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	16,355,986.07	4,785.06	633,018.74	53,132.85

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015年1月1日至2015年1月15日止期间获得的利息收入为人民币206.46元，2015年1月15日结算备付金余额为人民币369736.67元。2014年1月1日至2014年6月30日止期间获得的利息收入为人民币34,722.33元，2014年6月末结算备付金余额为人民币3,083,384.48元。

6.1.5.2.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.1.5.2.7 其他关联交易事项的说明

6.1.5.3 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.5.3.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.1.5.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.1.5.3.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.5.3.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.1.5.3.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.1.5.4 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.2 转型后**6.2.1 资产负债表**

会计主体：汇添富添富货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 6 月 30 日
资 产：	
银行存款	382,708,881.00
结算备付金	-
存出保证金	2,628.53
交易性金融资产	70,004,683.07
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	70,004,683.07
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	59,900,409.85
应收证券清算款	-
应收利息	1,952,273.27
应收股利	-
应收申购款	59,303,952.87
递延所得税资产	-
其他资产	17,241.72
资产总计	573,890,070.31
负债和所有者权益	本期末 2015 年 6 月 30 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	31,999,752.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	91,191.38
应付托管费	30,397.12
应付销售服务费	61,029.95
应付交易费用	5,462.03

应交税费	-
应付利息	17,431.56
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	197,437.29
负债合计	32,402,701.33
所有者权益：	
实收基金	541,487,368.98
未分配利润	-
所有者权益合计	541,487,368.98
负债和所有者权益总计	573,890,070.31

报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 541,487,368.98 份，其中，A 级份额 457,938,197.69 份，B 级份额 83,549,171.29 份。

6.2.2 利润表

会计主体：汇添富添富货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	6,327,089.54
1.利息收入	6,276,368.23
其中：存款利息收入	4,894,467.57
债券利息收入	1,172,202.75
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	209,697.91
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	50,721.31
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	50,721.31
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-

减：二、费用	1,099,870.00
1. 管理人报酬	450,385.72
2. 托管费	150,113.62
3. 销售服务费	192,078.88
4. 交易费用	-
5. 利息支出	82,869.38
其中：卖出回购金融资产支出	82,869.38
6. 其他费用	224,422.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,227,219.54

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富添富通货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,411,447.28	-	16,411,447.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,227,219.54	5,227,219.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	525,075,921.70	-	525,075,921.70
其中：1. 基金申购款	2,777,189,057.67	-	2,777,189,057.67
2. 基金赎回款	-2,252,113,135.97	-	-2,252,113,135.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-5,227,219.54	-5,227,219.54
五、期末所有者权益（基金净值）	541,487,368.98	-	541,487,368.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

陈灿辉

韩从慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

汇添富添富货币市场基金由汇添富新收益债券型证券投资基金转型而来。2015 年 1 月 9 日汇添富新收益债券型证券投资基金以现场方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于汇添富新收益债券型证券投资基金转型的议案》，内容包括汇添富新收益债券型证券投资基金调整基金投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、估值方法以及修订基金合同等，并同意将汇添富新收益债券型证券投资基金更名为“汇添富添富货币市场基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2015 年 1 月 16 日起，《汇添富添富货币市场基金基金合同》生效，《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》同日起生效。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在承担合理风险和保持资产流动性的基础上适度参与权益类品种投资，力争实现资产的长期稳定增值。本基金业绩比较基准：活期存款利率（税后）。

6.2.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。

2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

6.2.4.4.1 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.2.4.4.2 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日止。

6.2.4.4.3 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.2.4.4.4 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债。

6.2.4.4.5 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.2.4.4.6 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有

重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

4) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.50% 的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.2.4.4.7 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.2.4.4.8 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.2.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提；

(3) 基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有

人，年销售服务费率应自其降级的确认日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级的确认日起享受 B 类基金份额的费率。；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.2.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3、“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理。因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

4、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

5、本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额；其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其赎回基金份额对应的累计收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

6、基金管理人有权在基金注册登记机构条件允许的情形下，将全部或部分基金份额的收益分配由“每日分配，按月支付”提升为“每日分配，按日支付”并予以公告； 7、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更的说明。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，自 2015 年 4 月 3 日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.2.4.6 税项

1. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

2. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定：自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.2.4.7 关联方关系

6.2.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.2.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东

汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批的关键管理人

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.2.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.2.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.2.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.2.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.2.4.8.2 关联方报酬

6.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	450,385.72
其中：支付销售机构的客户维护费	149,072.32

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每个月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

6.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	150,113.62
----------------	------------

6.2.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富添富货币 A	汇添富添富货币 B	合计
汇添富基金管理股份有限公司	22,445.03	4,919.04	27,364.07
东方证券股份有限公司	74.87	-	74.87
中国工商银行股份有限公司	76,731.46	740.40	77,471.86
合计	99,251.36	5,659.44	104,910.80

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级的确认日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级的确认日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.2.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.2.4.8.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度可比期间未投资本基金。

6.2.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	708,881.00	10,667.06

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年 1 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 316.16 元，2015 年 6 月末无结算备付金余额。

6.2.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.2.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.2.4.9.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.9.1.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.2.4.9.1.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.2.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 转型前

7.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	16,725,722.74	99.91
7	其他各项资产	14,766.76	0.09
8	合计	16,740,489.50	100.00

7.1.2 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。

7.1.3 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。

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.1.5 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。

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.1.7 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。

7.1.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.10.1 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。

7.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.1.10.3 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。

7.1.11 投资组合报告附注

7.1.11.1

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。

7.1.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.1.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,252.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,514.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,766.76

7.1.11.4 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。

7.1.11.5 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。

7.2 转型后

7.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	70,004,683.07	12.20
	其中：债券	70,004,683.07	12.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	59,900,409.85	10.44
	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	382,708,881.00	66.69
4	其他各项资产	61,276,096.39	10.68
5	合计	573,890,070.31	100.00

7.2.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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		1.83
	其中：买断式回购融资		-
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	31,999,752.00	5.91
	其中：买断式回购融资	-	-

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%。

7.2.3 基金投资组合平均剩余期限

7.2.3.1 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	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

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。

7.2.3.2 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	53.48	5.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	7.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	9.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	9.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	94.67	5.91

7.2.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,013,443.15	5.54
	其中：政策性金融债	30,013,443.15	5.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	39,991,239.92	7.39
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	70,004,683.07	12.93
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.2.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	140223	14 国开 23	200,000	20,015,391.84	3.70
2	041564010	15 西矿集 CP001	200,000	19,994,461.85	3.69
3	041554009	15 北部湾 CP001	100,000	10,000,476.28	1.85
4	150202	15 国开 02	100,000	9,998,051.31	1.85
5	011598007	15 浙物产 SCP007	100,000	9,996,301.79	1.85

7.2.6 “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	0.19%
报告期内偏离度的最低值	-0.02%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.06%

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.2.8 投资组合报告附注**7.2.8.1**

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。

7.2.8.2

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。

7.2.8.3

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。

7.2.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,628.53
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,952,273.27
4	应收申购款	59,303,952.87
5	其他应收款	-
6	待摊费用	17241.72
7	其他	-
8	合计	61,276,096.39

§8 基金份额持有人信息**8.1 转型前****8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
787	19,163.86	0.00	0.00%	15,081,956.52	100.00%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	24,521.58	0.16%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.2 转型后

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富添富货币 A	7,932	57,733.01	49,835.50	0.01%	45,888,362.19	99.99%
汇添富添富货币 B	4	20,887,292.82	60,030,196.31	71.85%	23,518,974.98	28.15%
合计	7,936	68,231.78	60,080,031.81	11.10%	481,407,337.17	88.90%

8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金的基金管理人从业人员本报告期末未持有本基金。

8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富添富货币 A	0
	汇添富添富货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富添富货币 A	0
	汇添富添富货币 B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

9.1 转型前:

单位: 份

基金合同生效日 (2013 年 12 月 10 日) 基金份额总额	398,350,312.89
本报告期期初基金份额总额	22,164,804.22
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	28,617,982.60
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	35,700,830.30
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	15,081,956.52

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。

9.2 转型后:

单位: 份

	汇添富添富货币 A	汇添富添富货币 B
基金合同生效日 (2015 年 1 月 16 日) 基金份额总额	16,411,447.28	-
本报告期期初基金份额总额	16,411,447.28	0.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,777,429,674.39	999,759,383.28
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,335,902,923.98	916,210,211.99
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	0.00	0.00
本报告期末基金份额总额	457,938,197.69	83,549,171.29

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2015 年 1 月 9 日, 汇添富新收益债券型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司以现场方式召集召开了本基金的基金份额持有人大会。

出席本次大会的汇添富新收益债券型证券投资基金基金份额持有人 (或其代理人) 所代表份额共计 27,572,610.29 份, 占权益登记日基金总份额 48,331,171.83 份的 57.05%, 达到全部有效凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上 (含 50%), 满足法定开会条件。会议审议通过了《关于汇添富新收益债券型证券投资基金转型相关事项的议案》, 本次大会决议自该日起生效。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，汪洋先生不再担任汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF 基金的基金经理，由吴振翔先生单独管理上述基金。
- 2、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富深证 300ETF、汇添富深证 300ETF 联接基金的基金经理。同时，汪洋先生不再担任上述基金的基金经理。
- 3、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，与叶从飞先生共同管理该基金。
- 4、基金管理人 2015 年 1 月 31 日公告，增聘李威先生担任汇添富外延增长股票基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
- 5、基金管理人 2015 年 2 月 5 日公告，增聘刘闯先生担任汇添富医药保健股票基金的基金经理，与周睿先生共同管理该基金。
- 6、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 16 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
- 7、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 21 天债券基金的基金经理，与曾刚先生共同管理上述基金。
- 8、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，与王栩先生共同管理该基金。
- 9、《汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2015 年 3 月 24 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
- 10、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富收益快线货币基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
- 11、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富全额宝货币基金的基金经理，由汤丛珊女士单独管理该基金。
- 12、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 21 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理上述基金。
- 13、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，王栩先生不再担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。
- 14、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富理财 7 天债券基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
- 15、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，新任李文先生为董事长，潘鑫军先生不再担任董事长。
- 16、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，林利军先生不再担任法定代表人和总经理，由李文先生代为履行法定代表人职责，由张晖先生代为履行总经理职责。
- 17、基金管理人 2015 年 5 月 27 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富香港优势股票基金的基金经理，与王致人先生共同管理该基金。
- 18、基金管理人 2015 年 6 月 16 日公告，王致人先生不再担任汇添富香港优势股票基金的基金经理，由赖中立先生单独管理该基金。
- 19、《汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 18 日正式生效，刘江先生任该基金的基金经理。
- 20、基金管理人 2015 年 6 月 27 日公告，新任李文先生为法定代表人，新任张晖先生为总经理。新任李鹏先生为督察长，李文先生不再担任督察长，张晖先生不再担任副总经理。
- 21、本报告期，基金托管人中国工商银行股份有限公司的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

2015 年 1 月 16 日原“汇添富新收益债券型证券投资基金”转型为“汇添富添富货币市场基金”。汇添富添富货币市场基金的投资目标、投资范围、投资策略请详见本公司刊登在 2015 年 1 月 16 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司网站的《汇添富添富货币市场基金基金合同》。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 1 月，针对上海证监局出具的整改措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。2015 年 4 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 转型前：

10.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督；
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例；
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础

上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%；

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据；

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批；

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成；

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、以上 2 个交易单元与汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，汇添富理财 30 天债券型证券投资基金，汇添富理财 7 天债券型证券投资基金，汇添富互利分级债券型证券投资基金，汇添富现金宝货币市场基金，汇添富增强收益债券型证券投资基金及汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金共用。报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：本基金本报告期末新增或退租交易单元。

10.7.2 转型后：

10.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督；

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例；

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%；

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据；

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监

审批：

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成；

（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、此 2 个交易单元与汇添富现金宝货币市场基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金共用。本报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

汇添富基金管理股份有限公司
2015 年 8 月 29 日