

# 汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

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

送出日期：2016 年 3 月 29 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富年年利定期开放债券	
基金主代码	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	
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	1,068,344,890.57 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	871,114,379.41 份	197,230,511.16 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	洪渊
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网	www.99fund.com
--------------------	----------------

址	
基金年度报告备置地点	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

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年		2014 年		2013 年 9 月 6 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 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	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	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
本期已实现收益	17,855,844.42	7,354,743.33	17,209,462.45	7,915,543.72	5,601,473.71	2,284,343.82
本期利润	30,200,196.01	11,541,658.61	20,579,176.30	9,802,204.24	5,229,585.60	2,118,571.06
本期加权平均净值利润率	7.93%	8.37%	6.89%	6.75%	1.39%	1.26%
本	9.53%	9.02%	7.59%	7.21%	1.40%	1.30%

期 基 金 份 额 净 值 增 长 率						
3.1. 2 期 末 数 据 和 指 标	2015 年末		2014 年末		2013 年末	
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0.1515	0.1414	0.0774	0.0722	0.0140	0.0127
期 末 基 金 资 产 净 值	1,040,670,78 4.62	233,591,427 .99	168,723,518 .13	121,291,163 .50	379,031,863 .17	168,906,390 .69
期 末 基 金 份 额	1.195	1.184	1.091	1.086	1.014	1.013

净值						
----	--	--	--	--	--	--

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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 9 月 6 日，至本报告期末未满三年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2015 年 12 月 31 日数据，特此说明。

## 3.2 基金净值表现

### 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

汇添富年年利定期开放债券 A

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
过去三个月	1.88%	0.07%	0.70%	0.01%	1.18%	0.06%
过去六个月	3.64%	0.11%	1.48%	0.01%	2.16%	0.10%
过去一年	9.53%	0.12%	3.32%	0.01%	6.21%	0.11%
自基金合同生效日起至 今	19.50%	0.11%	8.84%	0.01%	10.66%	0.10%

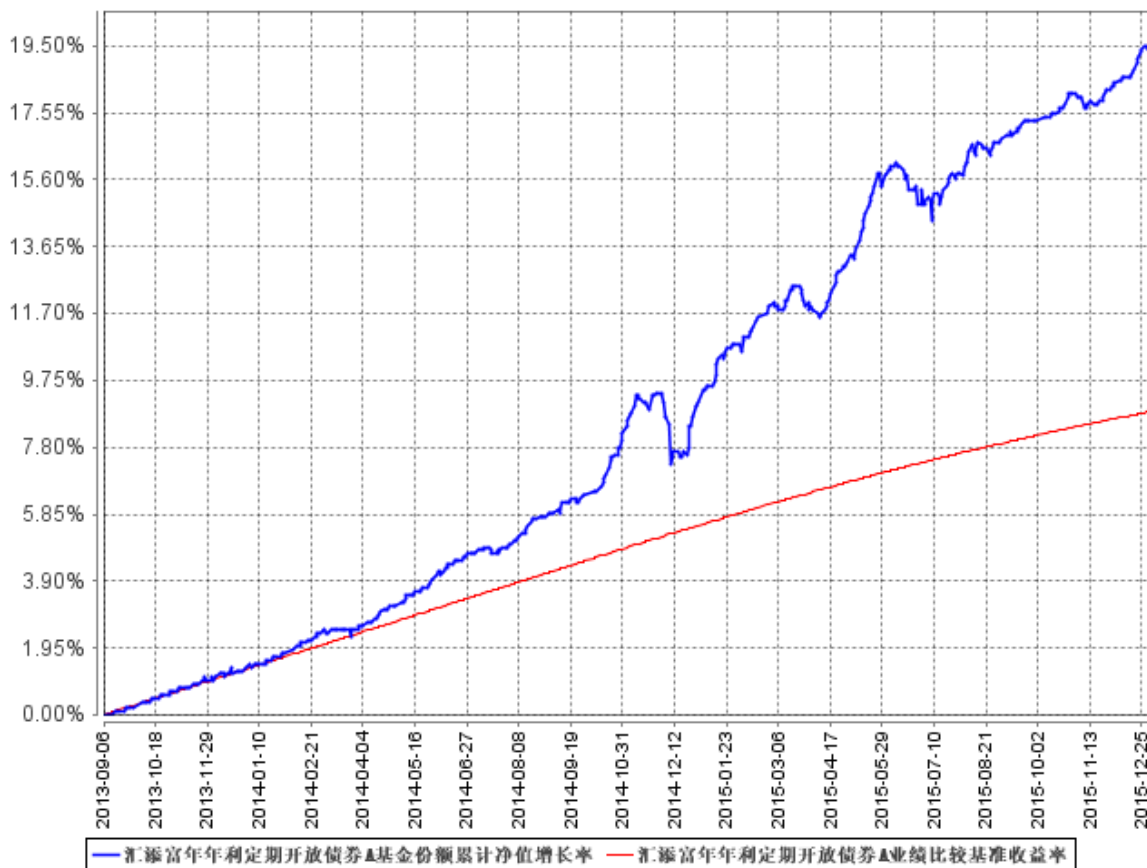
汇添富年年利定期开放债券 C

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
过去三个月	1.72%	0.07%	0.70%	0.01%	1.02%	0.06%
过去六个月	3.41%	0.11%	1.48%	0.01%	1.93%	0.10%
过去一年	9.02%	0.12%	3.32%	0.01%	5.70%	0.11%
自基金合同生效日起至 今	18.40%	0.11%	8.84%	0.01%	9.56%	0.10%

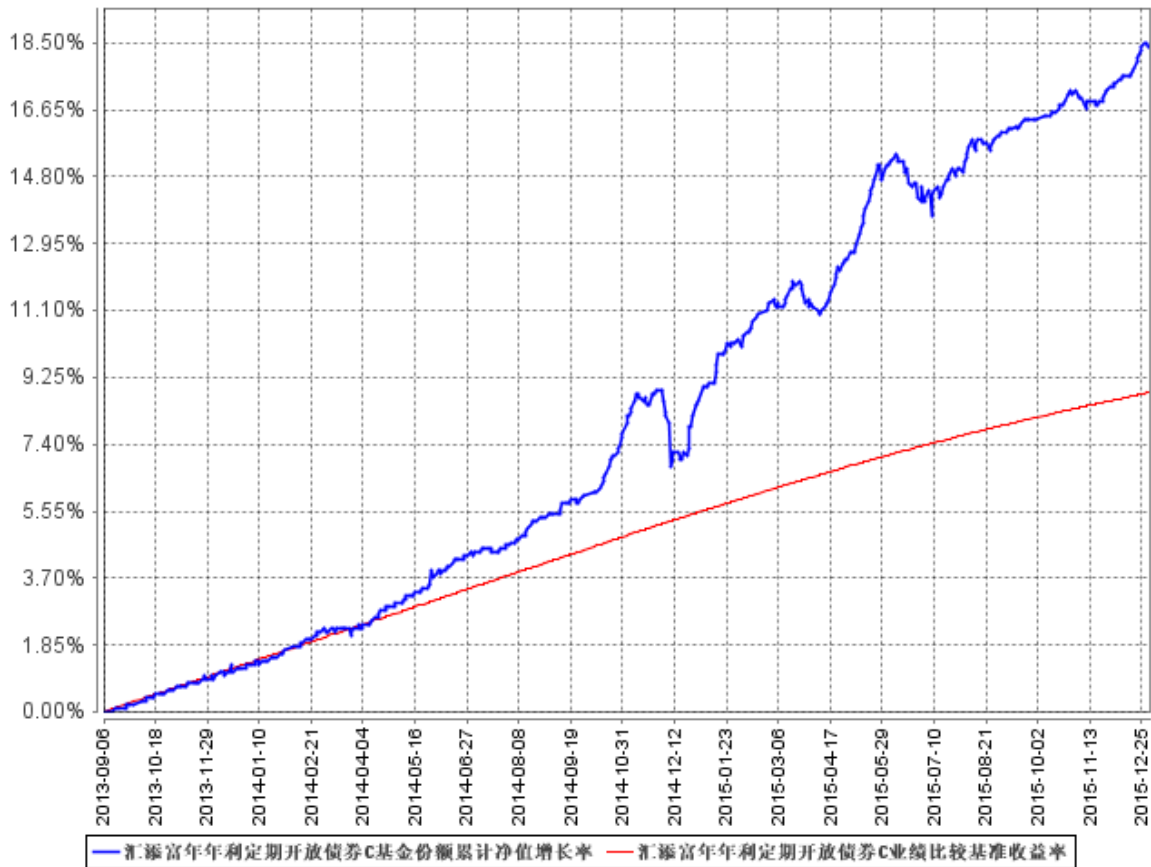
注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 9 月 6 日，至本报告期末未满三年。

### 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

汇添富年年利定期开放债券A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



汇添富年年利定期开放债券C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

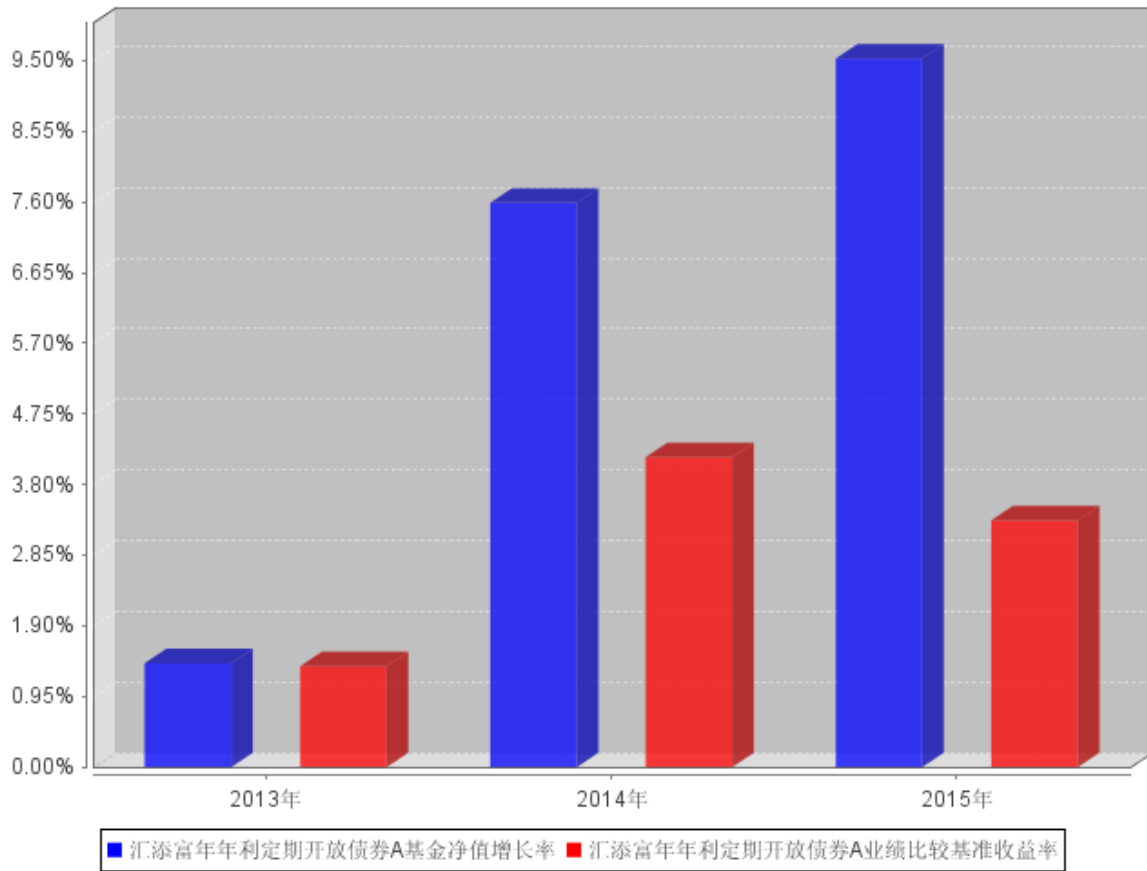


注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 9 月 6 日，截至本报告期末，基金成立未满三年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 9 月 6 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

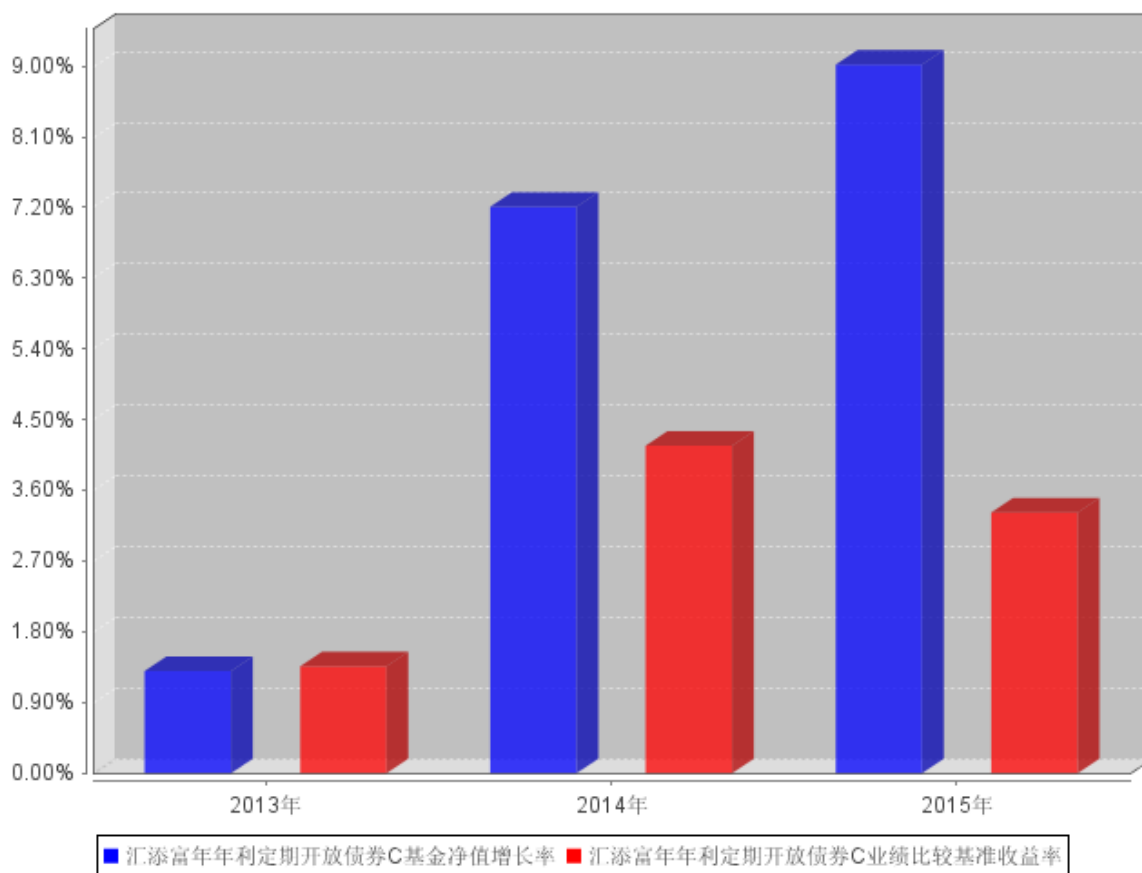


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富年年利定期开放债券A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



**汇添富年年利定期开放债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 9 月 6 日，至本报告期末未满足五年。

2、同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

**3.3 过去三年基金的利润分配情况**

注：本基金成立于 2013 年 9 月 6 日，截至本报告期末本基金未进行利润分配。

**§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成立于 2005 年 2 月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京、南方、上海虹桥机场及成都四个分公司，以及两个子公司—汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)和汇添富资本管理有限公司。

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII 业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人。截至目前，汇添富已经构建

起公募、专户、养老金、国际业务、融资业务及互联网金融六大业务板块协同发展的统一的管理服务平台。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2015年,汇添富保持了优秀的投资业绩:2015年,公司旗下偏股型基金全年平均涨幅达到71.97%,在大型基金公司当中稳居第一(数据来源:银河基金研究中心)。民营活力、蓝筹稳健和优势精选在同类基金中收益排名前十(数据来源:WIND)。公司中长期投资业绩同样表现十分优秀,旗下权益类基金3年期、5年期整体业绩位居前十五大基金公司之首(数据来源:银河基金研究中心)。

2015年,汇添富基金新发8只基金,包括3只股票型基金,2只指数基金,以及3只混合型基金。其中,添富快钱和现金添富基金分别在深交所和上交所上市,进一步完善了公司场内货基金产品线。全年,公司公募基金产品达到58只,涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品,为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2015年,汇添富基金坚持自有平台与对外合作双面协同发展,互联网金融取得长足进步。截止年底,公司电商平台已与三十余家大型互联网企业开展战略合作,成为迄今为止在电子商务领域对外合作最多的基金公司;公司互联网金融保有量突破1000亿元,客户数量超过1800万人,2015年全年电商平台成交量超过12000亿元,保持行业领先水平。

2015年,汇添富基金机构业务稳步推进。截至年底,公司服务机构客户数量超过200家,资产管理规模同比增长超过150%;公司受托管理19家保险机构的资产委托账户,并于2015年6月,成为社保基金境外配售组合的投资管理人,成为基金行业仅有的两家获得此项资格的机构之一。

2015年,公司积极开展渠道销售和培训工作。优秀的投资业绩、专业的投顾服务以及良好的渠道口碑带来了汇添富品牌影响力的巨大提升。全年,渠道新发基金首募规模在同期发行基金中保持行业领先地位。全年渠道公募保有量同比增长超过100%。

2015年,汇添富基金继续提升客户服务能力,通过持续完善客户平台建设,持续优化电话、短信等服务通道建设,丰富服务渠道,提高客服体验。

2015年,香港子公司国际业务取得重大突破。香港子公司与台湾最大券商签订沪港通投顾合约,与韩国两家排名前十的大型基金管理公司开展投顾合作。此外,公司两地基金互认业务也走在行业前列,截至年底已有3只南下基金获香港证监会销售批准。

2015 年，公司持续加强公益事业建设，践行企业社会责任。8 月，“生命之光”汇添富乡村医生助飞项目启动，公司邀请多位优秀专家深入宁夏泾源县和青海互助县，为当地一线医务工作者提供专业培训指导，并面向农村百姓开展义诊活动。11 月，公司赞助的第 20 届上海国际马拉松赛首度引入公益元素，与“河流·孩子”项目合作，推出“全马完赛公益捐赠”活动，将筹得善款用于改善“河流·孩子”项目学校学生的生活条件。

2015 年，汇添富荣获了包括明星基金奖、金牛基金奖、上海金融创新二等奖、最佳债券公司奖、最佳电子交易平台等多个重要奖项。

2016 年是“十三五”的开局之年，资本市场改革进一步深化，财富管理行业在混业竞争和互联网金融的双重推动下将面临更大的挑战与机遇。汇添富基金将始终坚信长期的力量，开拓进取、奋勇前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
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，理财 14 天的基金经理助理。	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

					<p>益投资负责人。</p> <p>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，</p> <p>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。</p> <p>2012 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部高级经理、基金经理助理。</p> <p>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，</p> <p>2013 年 2 月 7 日至今任汇</p>
--	--	--	--	--	--

					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 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

### 4.3.2 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。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部、集中交易室、投资研究部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的监控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3日、5日）同向交易的样本，利用统计分析的方法和工具，根据对样本个数、差价率是否为0的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占比等原因进行综合分析，未发现旗

下投资组合之间存在不公平交易现象。

### 4.3.3 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 5 次，其中一次是由于流动性原因，一次是由于合规控制调整原因，三次是因为投资策略原因。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的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年是股市大幅震荡、债市总体上涨的一年。1 季度前两个月，由于经济仍然趋弱，降准、降息预期较强烈，一般债券收益率再次下行，10 年国开债 4.07% 下降到 2 月底的 3.67%，5 年 AA+ 城投债 5.62% 下降到 2 月底的 4.97%，3 月份在央行再次降息后，由于市场对再次降息的预期大幅减弱，而对经济可能逐步筑底的预期增强，尤其对财政部地方债置换可能引发类利率债供给大幅上升的预期，一般债券收益率开始上行，降息操作形成了加息的效果，10 年国开债收益率 3 月份上升到 4.16%，5 年 AA+ 城投债收益率反弹到 5.52%。权益类市场 1 季度则充满了对改革所带来的美好前景的憧憬，尽管经济仍然较弱，1 季度下半期原来推动市场上涨的无风险利率甚至有所上行，创业板指数大涨 59.93%，上证综指振荡上行 15.87%。转债在这场狂欢中由于估值压制，以及行业分布的原因，市场热度远不及去年 4 季度，中证转债指数小幅上涨 2.45%。2 季度，由于市场预期宏观经济短期内难有大的起色，通胀压力小，央行仍会放松，7 年 AA 评级的城投债收益率下行 33bp，由 6.34% 下降到 6.01%，3 年 AAA 评级企业债由 4.86% 下降到 4.06%，下滑 80 个 bp，10 年国开债收益率，由于伴随央行的放松，市场预期有所波动，尤其是地方债放量供给，对利率债市场还是形成一定的干扰，但整体上仍然下行 9bp。但是股票市场在清查配资的引发下，高估值的股票价格大幅下挫，进而造成高杠杆到中低杠杆配资投资账户的连锁强平，股价简直是一泻千里，连续跌停。2 季度上证综指最高上涨 36.4%，随后短时间内下跌 16.9%，创业板指数最高上涨 70.3%，后短期内下跌 25.5%。股市开始暴跌后，为防范系统性风险，政府开始入场救市，初期效果不明显。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%。4 季度，债券市场方面，尽管债券的绝对收益或利差，均处于历史低位，但显然债券投资者坚定认为，在转型背景下，尤其随着供给侧改革的推进，政府对短期经济降速的容忍度上升，未来一段时间经济会更差，央行会更松，债券收益率也可更低。同时，避险资金不断涌入债市。期间，10 年期国开债收益率下行 57bp，7 年 AA 评级城投债收益率下行 97bp。类权益类市场方面，经历前期的大幅下挫，许多创业板、中小板股票估值风险已得到较大释放，一些高股息的蓝筹股投资价值开始显现，在救市政策的维稳、推动下，权益市场振荡反弹，上证综指上涨 24.68%，创业板上涨 29.33%，可转债跟随正股反弹，转债稀缺性对转债估值形成良好支撑，但在后期伴随转债 IPO 放开预期的上升，转债估值有所回落，期间，中证转债指数上涨 4.97%。

本基金根据市场变化以及基金特点、持有人需求，一般债券上很坚定地进行了加仓加杠杆的操作，未参与二级市场可转债。成立 2 个封闭期以来，总体上较好把握住了市场机会，规避了市场风险，大幅超额完成目标收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，汇添富年年利定期开放债券 A 净值增长 9.53%，汇添富年年利定期开放债券 C 净值增长 9.02%，同期业绩比较基准收益率 3.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来 5 年是我国发展的重要窗口期，也是证券市场发展的重要时期，一定程度上，能否避开“陷阱”，实现伟大梦想，在此一举，确实需要“壮士断腕”以强力推进改革。展望后市，在强力推进以供给侧改革为主的各项改革措施的背景下，经济肯定还是要面临很大的压力，央行受制于汇率，放松的空间受限，一般债券创历史新低后，虽然还有空间，但确实需要关注风险，尤其信用风险；

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

##### （一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对

相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

#### （二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

#### （三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

### 4.7 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验，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。

#### **4.8 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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本年度本基金未进行利润分配。

#### **4.9 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年年利定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他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，汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

### **5.3 托管人对本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股份有限公司编制和披露的汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师汤骏、蔺育化于 2016 年 3 月 25 日签字出具了安永华明(2016)审字第 60466941\_B39 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日: 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	30,238,948.44	2,977,548.75
结算备付金	9,473,019.99	8,875,113.54
存出保证金	15,709.72	21,218.96
交易性金融资产	1,683,803,888.25	442,791,081.44
其中: 股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,683,803,888.25	437,791,081.44
资产支持证券投资	-	5,000,000.00
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	-	16,768,022.28
应收利息	23,270,602.41	8,116,144.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,746,802,168.81	479,549,129.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
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	469,999,182.50	188,847,181.92
应付证券清算款	1,006,900.50	19,405.44
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	753,394.36	171,047.45
应付托管费	215,255.53	48,870.69
应付销售服务费	78,930.41	40,881.98
应付交易费用	9,030.09	6,133.18
应交税费	-	-
应付利息	77,262.81	100,927.46
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	400,000.00	300,000.00
负债合计	472,539,956.20	189,534,448.12
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,068,344,890.57	266,266,247.92
未分配利润	205,917,322.04	23,748,433.71
所有者权益合计	1,274,262,212.61	290,014,681.63
负债和所有者权益总计	1,746,802,168.81	479,549,129.75

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.193 元，基金份额总额 1,068,344,890.57 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.195 元，份额总额 871,114,379.41 份；C 类基金份额净值 1.184 元，份额总额 197,230,511.16 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	52,064,408.36	38,486,601.84
1.利息收入	30,165,858.67	26,273,008.97
其中：存款利息收入	384,178.63	5,417,651.95
债券利息收入	29,685,091.86	19,822,075.24
资产支持证券利息收入	-	698,208.22
买入返售金融资产收入	96,588.18	335,073.56
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”号填列）	5,307,125.51	6,899,485.78
其中：股票投资收益	37,224.11	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,214,901.40	6,774,674.83

资产支持证券投资收益	55,000.00	124,810.95
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）	16,531,266.87	5,256,374.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	60,157.31	57,732.72
<b>减：二、费用</b>	<b>10,322,553.74</b>	<b>8,105,221.30</b>
1. 管理人报酬	3,625,455.11	3,108,516.54
2. 托管费	1,035,844.30	888,147.59
3. 销售服务费	553,074.77	581,687.05
4. 交易费用	12,742.96	18,125.01
5. 利息支出	4,636,651.93	3,061,516.08
其中：卖出回购金融资产支出	4,636,651.93	3,061,516.08
6. 其他费用	458,784.67	447,229.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>41,741,854.62</b>	<b>30,381,380.54</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	266,266,247.92	23,748,433.71	290,014,681.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,741,854.62	41,741,854.62
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）	802,078,642.65	140,427,033.71	942,505,676.36
其中：1. 基金申购款	1,003,863,275.11	172,061,606.05	1,175,924,881.16
2. 基金赎回款	-201,784,632.46	-31,634,572.34	-233,419,204.80
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）	1,068,344,890.57	205,917,322.04	1,274,262,212.61
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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）	540,590,097.20	7,348,156.66	547,938,253.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,381,380.54	30,381,380.54
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）	-274,323,849.28	-13,981,103.49	-288,304,952.77
其中：1. 基金申购款	193,085,924.05	11,544,457.00	204,630,381.05
2. 基金赎回款	-467,409,773.33	-25,525,560.49	-492,935,333.82
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）	266,266,247.92	23,748,433.71	290,014,681.63

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富年年利定期开放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]701号文《关于核准汇添富年年利定期开放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有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于2013年09月06日正式生效，首次设立募集规模为540,590,097.20份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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固定收益类金融工具，包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款），以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证，也不参与一级市场新股申购。本基金的投资目标为在严格管理风险和保持资产流动性的基础上，努力实现资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为银行一年期定期存款税后利率+1.2%。

#### 7.4.2 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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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相一致的说明

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相一致。

##### 7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈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〉的通知》的规



定，自 2015 年 4 月 3 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

#### 7.4.4.3 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。

### 7.4.5 税项

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.6 关联方关系

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、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
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	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关键管理人员

#### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券股份有限公司	245,165.69	100.00%	-	-

#### 7.4.7.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	356,156,783.44	100.00%	515,531,172.40	100.00%

#### 7.4.7.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	27,764,398,000.00	100.00%	10,635,312,000.00	100.00%

#### 7.4.7.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	223.20	100.00%	-	-

注：本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 7.4.7.2 关联方报酬

### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,625,455.11	3,108,516.54
其中：支付销售机构的客户维护费	1,588,226.34	1,270,599.52

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

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，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、公休假等，支付日期顺延。

### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,035,844.30	888,147.59

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 7.4.7.2.3 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 1 日至 2015 年 12 月 31 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
中国工商银行股份有限公司	-	405,324.33	405,324.33
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,221.79	1,221.79
合计	-	406,546.12	406,546.12
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
东方证券股份有限公司	-	918.50	918.50
中国工商银行股份有限公司	-	490,574.77	490,574.77
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,580.81	1,580.81
合计	-	493,074.08	493,074.08

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.7.4.1 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内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.7.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

### 7.4.7.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	30,238,948.44	208,930.51	2,977,548.75	142,394.19

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 年度获得的利息收入为人民币 175,074.79 元（2014 年度：62,232.92 人民币元），2015 年末结算备付金余额为人民币 9,473,019.99 元（2014 年末：人民币 8,875,113.54 元）。

### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

### 7.4.8 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
136078	15 禹洲 01	2015 年 12 月 9 日	2016 年 1 月 7 日	新债未上市	99.97	99.97	310,000	30,989,604.38	30,989,604.38	
112303	15 京威债	2015 年 12 月 11 日	2016 年 1 月 5 日	新债未上市	99.98	99.98	500,000	49,990,136.98	49,990,136.98	
136101	15 合景 01	2015 年 12 月 17 日	2016 年 1 月 18 日	新债未上市	99.99	99.99	300,000	29,996,751.78	29,996,751.78	
136109	15 康达债	2015 年 12 月 21 日	2016 年 2 月 4 日	新债未上市	99.95	99.95	400,000	39,980,712.33	39,980,712.33	
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 23 日	2016 年 1 月 8 日	新债未上市	99.99	99.99	6,520	651,957.13	651,957.13	

#### 7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 224,999,182.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150218	15 国开 18	2016 年 1 月 4 日	105.02	300,000	31,506,000.00
140216	14 国开 16	2016 年 1 月 4 日	102.72	250,000	25,680,000.00
150210	15 国开 10	2016 年 1 月 5 日	108.36	1,400,000	151,704,000.00
150016	15 付息国债 16	2016 年 1 月 6 日	105.73	300,000	31,719,000.00
合计				2,250,000	240,609,000.00

#### 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，基金从事上海证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 160,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 6 日到期。基金从事深圳证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 85,000,000.00 元，其中人民币 50,000,000.00 元于 2016 年 1 月 6 日到期，人民币 35,000,000.00 元于 2016 年 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.9.1 公允价值

##### 7.4.9.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.9.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.9.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 30,299,103.10 元，属于第二层次的余额为人民币 1,653,504,785.15 元，无划分为第三层次的余额（于 2014 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 145,454,238.65 元，属于第二层次的余额为人民币 297,336,842.79 元，无划分为第

三层次的余额)。

7.4.9.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈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〉的通知》的规定，自2015年4月3日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

7.4.9.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.9.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.9.3 其他事项

截至资产负债表日，除在附注7.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本基金期末持有航信转债数量800张，停牌日期2015年10月12日，成本总额人民币80,000.00元，估值总额人民币103,872.00元。航信转债因重大资产重组停牌，截至报告日，尚未复牌。

7.4.9.4 财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月25日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	1,683,803,888.25	96.39



	其中：债券	1,683,803,888.25	96.39
	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	39,711,968.43	2.27
7	其他各项资产	23,286,312.13	1.33
8	合计	1,746,802,168.81	100.00

## 8.2 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。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603993	洛阳钼业	207,941.58	0.07

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603993	洛阳钼业	245,165.69	0.08

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	207,941.58
卖出股票收入（成交）总额	245,165.69

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	74,011,000.00	5.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	237,620,300.00	18.65
	其中：政策性金融债	237,620,300.00	18.65
4	企业债券	697,123,697.12	54.71
5	企业短期融资券	583,170,000.00	45.77
6	中期票据	70,979,000.00	5.57
7	可转债	20,899,891.13	1.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,683,803,888.25	132.14

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150210	15 国开 10	1,400,000	151,704,000.00	11.91
2	150016	15 付息国债 16	700,000	74,011,000.00	5.81
3	136093	15 华信债	700,000	70,112,000.00	5.50
4	122276	13 魏桥 01	550,590	58,819,529.70	4.62
5	041554007	15 洋河 CP001	500,000	50,545,000.00	3.97

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.10.3 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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	15,709.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,270,602.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,286,312.13

### 8.11.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113008	电气转债	586,474.20	0.05
2	110030	格力转债	117,283.00	0.01
3	110031	航信转债	103,872.00	0.01
4	132001	14 宝钢 EB	1,808.22	0.00

### 8.11.3 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不存在流通受限的情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	5,480	158,962.48	-	0.00%	871,114,379.41	100.00%

富年年利定期开放债券 A						
汇添富年年利定期开放债券 C	1,133	174,078.12	-	0.00%	197,230,511.16	100.00%
合计	6,613	161,552.23	-	0.00%	1,068,344,890.57	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇添富年年利定期开放债券 A	23,728.05	0.00%
	汇添富年年利定期开放债券 C	0.00	-
	合计	23,728.05	0.00%

### 9.3 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	汇添富年年利定期开放债券 A	0
	汇添富年年利定期开放债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富年年利定期开放债券 A	0
	汇添富年年利定期开放债券 C	0
	合计	0

## §10 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
基金合同生效日（2013 年 9 月 6 日）基金份额总额	373,802,277.57	166,787,819.63
本报告期期初基金份额总额	154,598,430.33	111,667,817.59
本报告期基金总申购份额	827,322,367.06	176,540,908.05
减:本报告期基金总赎回份额	110,806,417.98	90,978,214.48
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	871,114,379.41	197,230,511.16

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

### 11.2 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混合基金的基金经理，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混合基金的基金经理，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混合基金的基金经理，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、基金管理人 2015 年 7 月 18 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富可转债债券基金的基金经理，与曾刚、梁珂先生共同管理该基金。

22、《汇添富国企创新股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 10 日正式生效，李威先生、劳杰男先生任该基金的基金经理。

23、基金管理人 2015 年 7 月 24 日公告，梁珂先生不再担任汇添富可转债债券基金的基金经理，由曾刚先生、吴江宏先生管理该基金。

24、基金管理人 2015 年 7 月 31 日公告，叶从飞先生不再担任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，由雷鸣先生单独管理该基金；汤从珊女士不再担任汇添富和聚宝货币基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

25、基金管理人 2015 年 8 月 5 日公告，朱晓亮先生不再担任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，由韩贤旺先生、叶从飞先生、顾耀强先生管理该基金。

26、基金管理人 2015 年 8 月 5 日公告，增聘过蓓蓓女士担任汇添富消费 ETF、金融 ETF、能源 ETF、医药 ETF、消费 ETF 联接基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

27、基金管理人 2015 年 8 月 6 日公告，经汇添富基金管理股份有限公司第二届董事会第三次会议决议，公司聘任袁建军先生为公司副总经理。

28、《汇添富民营新动力股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 7 日正式生效，谭志强先生任该基金的基金经理。

29、基金管理人 2015 年 8 月 19 日公告，增聘过蓓蓓女士担任汇添富深 300ETF、深 300ETF 联接基金的基金经理，与赖中立先生共同管理该基金。

30、基金管理人 2015 年 8 月 29 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富信用债债券基金的基金经理，由何旻先生单独管理该基金。

31、基金管理人 2015 年 10 月 29 日公告，增聘倪健先生担任汇添富香港优势混合基金的基金经理，与赖中立先生共同管理该基金。

32、基金管理人 2015 年 11 月 3 日公告，吴振翔先生不再担任汇添富消费 ETF、金融 ETF、能源 ETF、医药 ETF 基金的基金经理，由过蓓蓓女士单独管理该基金。

33、基金管理人 2015 年 11 月 19 日公告，增聘劳杰男先生担任汇添富价值精选混合基金的基金经理，与陈晓翔先生共同管理该基金。

34、基金管理人 2015 年 11 月 19 日公告，增聘李怀定先生担任汇添富季季红定期开放债券基金、互利分级债券基金的基金经理，与陆文磊先生共同管理上述基金。

35、《汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 26 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

36、基金管理人 2015 年 11 月 26 日公告，增聘许一尊先生担任汇添富成长多因子量化策略股票基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

37、《汇添富新兴消费型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 2 日正式生效，雷鸣先

生、刘伟林先生任该基金的基金经理。

38、《汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 2 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

39、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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2013 年 9 月 6 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付当期审计费用为人民币捌万元整。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	245,165.69	100.00%	223.20	100.00%	-

#### 11.7.2 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例



				的比例		
东方证券	356,156,783.44	100.00%	27,764,398,000.00	100.00%	-	-

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、汇添富收益快线货币市场基金、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添富通货币市场基金共用。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。

汇添富基金管理股份有限公司  
2016 年 3 月 29 日