

汇添富理财 7 天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	汇添富理财 7 天债券	
基金主代码	471007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 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	574,142,201.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
下属分级基金的交易代码:	471007	472007
报告期末下属分级基金的份额总额	406,876,238.20 份	167,265,962.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全，保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期控制在 127 天内。在控制利率风险的，尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。

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址	www.99fund.com
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 5 月 29 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日	
	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
本期已实现收益	19,204,199.25	6,907,150.94	39,201,883.35	11,251,206.10	60,388,873.95	12,926,123.76
本期利润	19,204,199.25	6,907,150.94	39,201,883.35	11,251,206.10	60,388,873.95	12,926,123.76
本期净值收益率	3.9278%	4.3863%	4.7642%	5.2255%	3.0025%	3.2716%
3.1.2 期末数据 和	2015 年末		2014 年末		2013 年末	

指标						
期末基金资产净值	406,876,238.20	167,265,962.92	618,280,814.60	155,962,290.43	1,350,550,967.18	150,043,600.77
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00

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、上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

汇添富理财 7 天债券 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
过去三个月	0.7756%	0.0055%	0.3403%	0.0000%	0.4353%	0.0055%
过去六个月	1.6180%	0.0060%	0.6805%	0.0000%	0.9375%	0.0060%
过去一年	3.9412%	0.0087%	1.3500%	0.0000%	2.5912%	0.0087%
自基金合同生效日起至今	12.1482%	0.0077%	3.5426%	0.0000%	8.6056%	0.0077%

汇添富理财 7 天债券 B

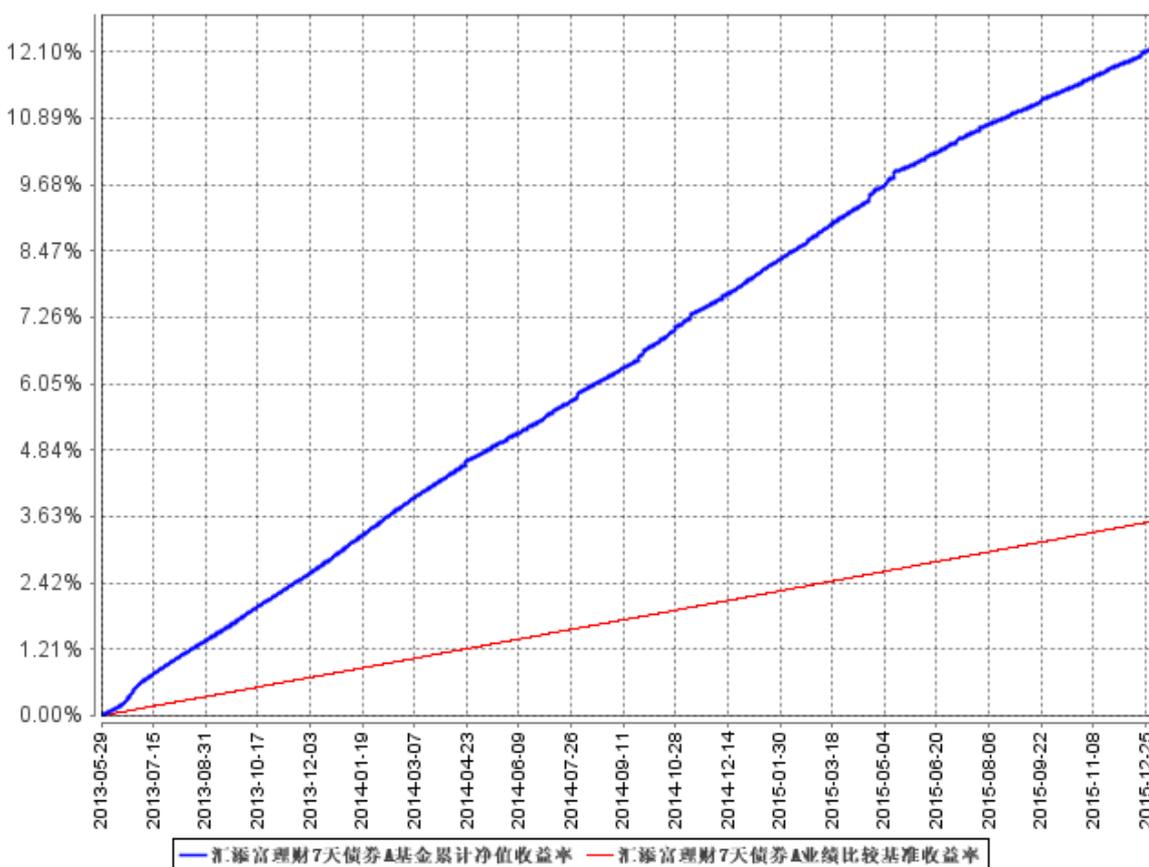
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去三个月	0.8874%	0.0055%	0.3403%	0.0000%	0.5471%	0.0055%
过去六个月	1.8436%	0.0060%	0.6805%	0.0000%	1.1631%	0.0060%
过去一年	4.4011%	0.0087%	1.3500%	0.0000%	3.0511%	0.0087%
自基金合同生效日起至 今	13.4347%	0.0077%	3.5426%	0.0000%	9.8921%	0.0077%

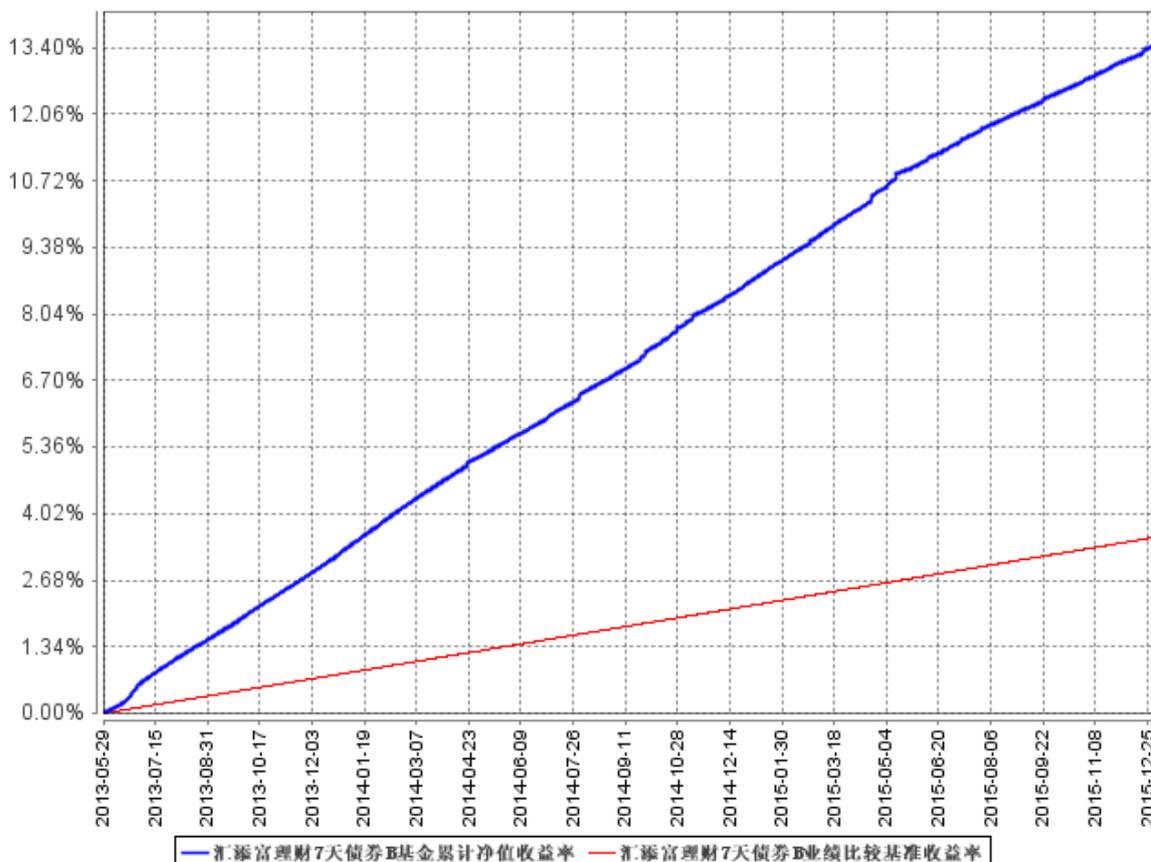
注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。3、本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日，至本报告期末未满三年。

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

汇添富理财7天债券A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



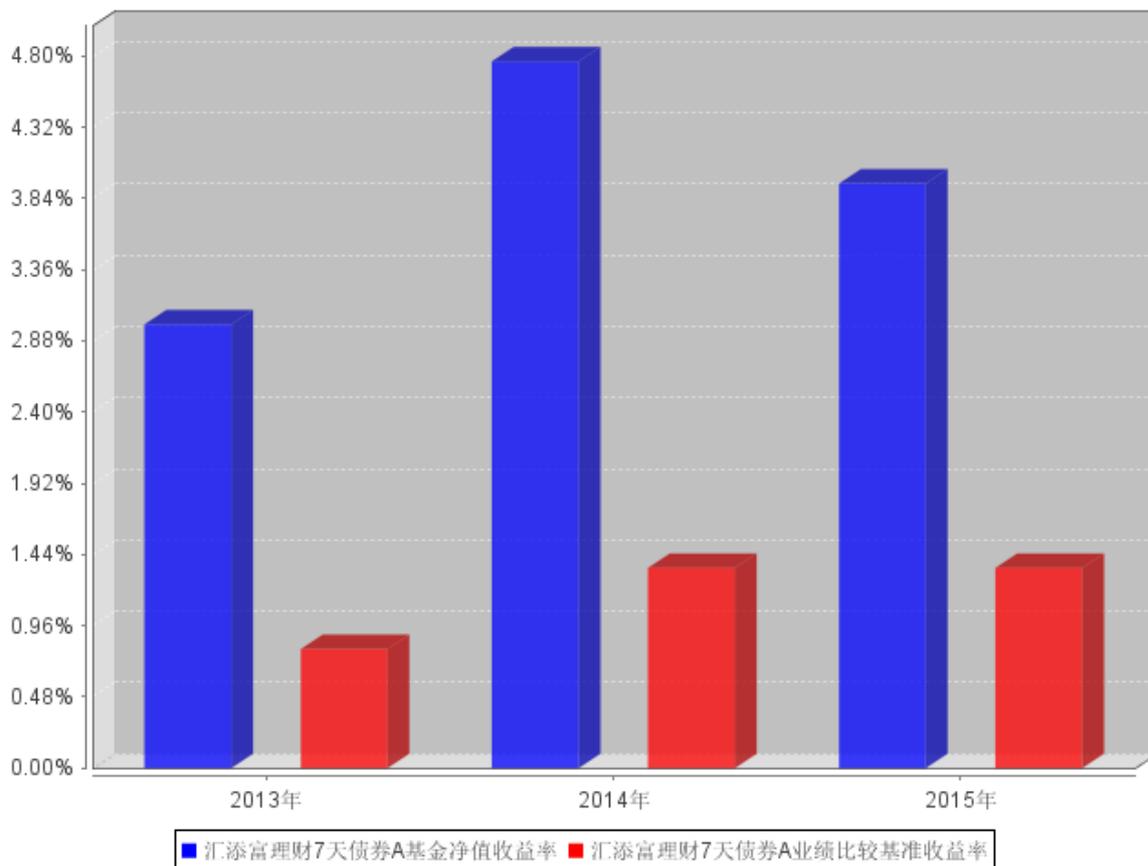
汇添富理财7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



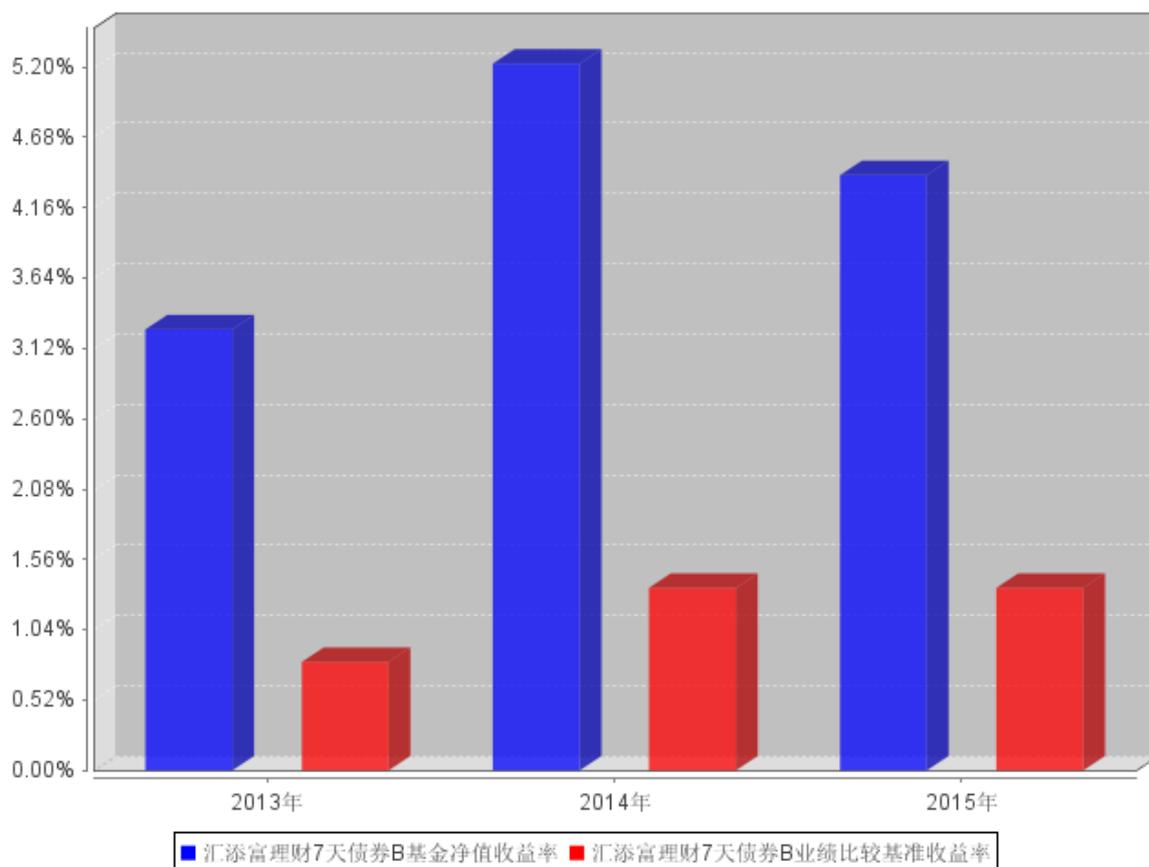
注：本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日，截至本报告期末，基金成立未满3年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年5月29日）起5日，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

汇添富理财7天债券A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



汇添富理财7天债券B自基金合同生效以来基金每年净值收益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5月29日，至本报告期末未满五年。

2、合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

单位：人民币元

汇添富理财7天债券A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2015	17,716,627.95	1,740,655.41	-253,084.11	19,204,199.25	
2014	35,638,456.55	4,113,957.86	-550,531.06	39,201,883.35	
2013	50,544,019.85	8,957,428.71	887,425.39	60,388,873.95	
合计	103,899,104.35	14,812,041.98	83,810.22	118,794,956.55	

单位：人民币元

汇添富理财7天债券B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2015	6,260,367.81	681,385.01	-34,601.88	6,907,150.94	
2014	9,477,539.49	1,818,431.28	-44,764.67	11,251,206.10	
2013	9,669,896.63	3,139,739.90	116,487.23	12,926,123.76	
合计	25,407,803.93	5,639,556.19	37,120.68	31,084,480.80	

§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、最佳证券公司奖、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		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇	2014 年 8 月 27 日	-	7 年	国籍：中国。学历：复旦大学法学学士。六年证券从业经验。曾任长江养老保险股份有限

	添富理财 7 天债券基金的基金经理。				公司债券交易员。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014 年 8 月 27 日至今任汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 11 月 26 日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理。2014 年 12 月 23 日至今任汇添富收益快钱货币基金经理。
曾刚	汇添富理财 21 天、理财 7 天、汇添富多元收益、可转换债	2013 年 5 月 29 日	2015 年 3 月 31 日	12 年	国籍：中国。学历：中国科技大学学士，清华大学 MBA。业

	<p>券、实业债债券、现金宝货币、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合基金的基金经理，理财 14 天的基金经理助理，固定收益投资副总监。</p>			<p>务资格： 基金从业资格。从业经历： 2008 年 5 月 15 日至 2010 年 2 月 5 日任华富货币基金的基金经理、 2008 年 5 月 28 日至 2011 年 11 月 1 日任华富收益增强基金的基金经理、 2010 年 9 月 8 日至 2011 年 11 月 1 日任华富强化回报基金的基金经理。 2011 年 11 月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、基金经理助理，现任固定收益投资副总监。 2012 年 5 月 9 日至 2014 年</p>
--	--	--	--	--

					<p>1 月 21 日任汇添富理财 30 天基金的基金经理，2012 年 6 月 12 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理财 60 天基金的基金经理，2012 年 9 月 18 日至今任汇添富多元收益基金的基金经理，2012 年 10 月 18 日至 2014 年 9 月 17 日任汇添富理财 28 天基金的基金经理，2013 年 1 月 24 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 21 天基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2013 年 5 月 29 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 7 天基金的基金经理，2013 年 6 月 14 日至今任汇添富实业债基金的基金经理，2013 年 9 月 12 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富现金宝货币基金基金经理，2013 年 12 月 3 日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理，2015 年 11 月 26 日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理。</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。

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，美国在“再工业化”的带动下经济复苏迹象明显，日本和欧洲经济体分别在“安倍经济学”和量化宽松计划的刺激下呈现弱复苏态势，同时美联储在 2015 年年底加息政策落地，显示其对未来经济的乐观，但新兴经济体经济增速下滑趋势并未得到遏制，国际贸易增速下降和大宗商品价格低迷都表明世界经济仍处于深度调整期。

2015 年国内经济增速不容乐观。居民消费价格指数 CPI 同比增速低位徘徊，生产价格指数 PPI 同比增速加速下滑。信贷社融低迷，银行风险偏好继续下降，M2 增速的上升与信贷数据出现背离，实体经济投资意愿弱，同时中国外汇占款余额大幅下滑。政府加大地方债的发行和置换力度，以求稳定经济增长。

针对经济增长、通胀、信贷均出现下滑以及人民币汇率贬值的局面，2015 年央行进行了多次降准降息，以期降低社会融资成本和提振经济。同时，央行通过 SLO、SLF、MLF、PSL 等工具对货币投放缺口进行对冲，并加大常规公开市场操作密度以熨平资金面波动。全年资金面维持宽松状态。在经济仍未企稳的情况下，央行维持了宽松的货币政策，债券收益率全年大幅下行，各

品种收益率均处于历史低位，权益市场全年巨幅震荡，转债市场在上半年跟随 A 股大幅上涨，下半年持续低迷。

操作上，本基金把握住了短端市场收益率下行的机会，通过波段操作加仓优质短融的配置比例以获取债券收益率下行带来的资本利得，合理错配存款到期日，在保证组合整体流动性的前提下锁定高息存款提高组合收益率；四季度适度加仓同业存单的配置比例，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，在提高基金静态收益率的同时为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本期间本基金 A 级净值收益率为 3.9412%，B 级净值收益率为 4.4011%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，从国内经济看，整体固定资产投资将继续萎缩，房地产仍处于去库存周期，在供给侧结构性改革的背景下，制造业投资热情不高，基建投资仍是第二产业的支柱，服务业中金融企业对经济的拉动作用将明显弱化，消费将逐步受到冲击。通胀将继续维持在较低水平。人民币贬值预期升温，外汇占款流出金额将进一步增大，汇率市场波动加大可能对国内流动性带来更大的扰动，央行将继续通过降息、降准、公开市场和创新工具等手段来维持基础货币投放和流动性平衡。

我们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，做好债券与存款之间的配置，延续相对积极的投资策略，保持投资收益吸引力，为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

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 and 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、固定收益部、集中交易室、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根据《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

本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

本基金期初应付收益 408,616.89 元，本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间累计分配收益 26,111,350.19 元，其中人民币 23,976,995.76 元以红利再投资方式结转入实收基金，人民币 2,422,040.42 元因基金赎回而支付给投资者，其余人民币 120,930.9 元为期末应付收益。

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理财 7 天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，汇添富理财 7 天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理财 7 天债券型证券投资基金的投资运作、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，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。

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理财 7 天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，注册会计师陈露、蔺育化于2016年3月25日签字出具了安永华明（2016）审字第60466941_B31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：汇添富理财7天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
资产：		
银行存款	150,301,350.82	351,594,433.97
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	408,654,062.21	350,257,881.25
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	408,654,062.21	350,257,881.25
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	30,026,446.80	78,000,757.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,383,350.57	8,526,396.37
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	595,365,210.40	788,379,468.59
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	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	20,499,789.75	12,999,860.50

应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	130,535.45	191,115.99
应付托管费	38,677.18	56,627.00
应付销售服务费	135,970.03	263,768.39
应付交易费用	26,557.10	18,250.34
应交税费	-	-
应付利息	1,248.87	1,773.11
应付利润	120,930.90	408,616.89
递延所得税负债	-	-
其他负债	269,300.00	196,351.34
负债合计	21,223,009.28	14,136,363.56
所有者权益：		
实收基金	574,142,201.12	774,243,105.03
未分配利润	-	-
所有者权益合计	574,142,201.12	774,243,105.03
负债和所有者权益总计	595,365,210.40	788,379,468.59

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额

574,142,201.12份，其中下属A类基金份额总额406,876,238.20份；B类基金份额总额167,265,962.92份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富理财7天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	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
一、收入	32,061,897.48	59,288,007.62
1.利息收入	27,986,986.37	53,861,003.82
其中：存款利息收入	14,185,946.23	33,316,967.22
债券利息收入	12,711,332.63	18,805,399.12
资产支持证券利息收入	82,416.43	-
买入返售金融资产收入	1,007,291.08	1,738,637.48
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,074,911.11	5,427,003.80
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,064,889.20	5,427,003.80
资产支持证券投资收益	10,021.91	-

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	5,950,547.29	8,834,918.17
1. 管理人报酬	1,777,257.64	2,883,309.70
2. 托管费	526,594.84	854,314.10
3. 销售服务费	2,211,791.37	3,809,280.04
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	1,087,622.87	932,056.17
其中：卖出回购金融资产支出	1,087,622.87	932,056.17
6. 其他费用	347,280.57	355,958.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	26,111,350.19	50,453,089.45

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富理财7天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）	774,243,105.03	-	774,243,105.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,111,350.19	26,111,350.19
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）	-200,100,903.91	-	-200,100,903.91
其中：1. 基金申购款	2,995,592,783.84	-	2,995,592,783.84
2. 基金赎回款	-3,195,693,687.75	-	-3,195,693,687.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-26,111,350.19	-26,111,350.19

回购、中期票据、资产支持证券、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、短期融资券，及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的投资目标为追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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。

7.4.5 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。

7.4.6 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。

7.4.7 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、基金销售机构、注册登记机构
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关键管理人员
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

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

	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	-	-	26,500,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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	1,777,257.64	2,883,309.70
其中：支付销售机构的 客户维护费	643,859.12	1,156,619.79

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.8.2.2 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	526,594.84	854,314.10

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 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		
	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B	合计
东方证券股份有限公司	6,287.32	0.00	6,287.32
中国工商银行股份有限公司	1,071,884.35	3,939.14	1,075,823.49
汇添富基金管理股份有限公司	222,822.65	8,838.47	231,661.12
合计	1,300,994.32	12,777.61	1,313,771.93
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		
	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B	合计
东方证券股份有限公司	26,818.77	47.87	26,866.64
中国工商银行股份有限公司	1,862,960.77	9,674.46	1,872,635.23
汇添富基金管理股份有限公司	329,510.49	7,941.89	337,452.38
合计	2,219,290.03	17,664.22	2,236,954.25

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。

本基金各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，A类基金的基金销售服务费按前一日

A类基金资产净值的0.45%的年费率计提；B类基金的基金销售服务费按前一日B类基金资产净值的0.01%的年费率计提。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出，分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	20,817,082.47	-	-	316,795,200.00	27,805.14
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	54,910,000.00	5,522.81

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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	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

	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	301,350.82	9,126.69	594,433.97	7,482,548.98

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 年度无结算备付金利息收入（2014 年度：人民币 212.50 元），2015 年末无结算备付金余额（2014 年末：无）。

7.4.8.6 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。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 20,499,789.75 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
090205	09 国开 05	2016 年 1 月 4 日	99.83	100,000	9,983,442.26
130212	13 国开 12	2016 年 1 月 4 日	98.65	105,000	10,358,183.80
合计				205,000	20,341,626.06

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 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二层次的余额为人民币 408,654,062.21 元，无划分为第一层次及第三层次的余额。（于 2014 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 350,257,881.25 元，无划分为第一层次及第三层次的余额）。

7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.10.1.2.3 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。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.10.4 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	固定收益投资	408,654,062.21	68.64
	其中：债券	408,654,062.21	68.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	30,026,446.80	5.04
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	30,026,446.80	5.04
3	银行存款和结算备付金合计	150,301,350.82	25.25
4	其他各项资产	6,383,350.57	1.07

5	合计	595,365,210.40	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 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	8.03	
	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	20,499,789.75	3.57
	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:本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

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 127 天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.3.2 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	15.75	3.57
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30天(含)—60天	8.66	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.44	-
3	60天(含)—90天	27.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	31.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	19.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.58	3.57

8.4 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	59,693,383.83	10.40
	其中：政策性金融债	59,693,383.83	10.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	269,829,003.21	47.00
6	中期票据	-	-
7	同业存单	79,131,675.17	13.78
8	其他	-	-
9	合计	408,654,062.21	71.18
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,729,873.91	3.44

8.5 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

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	041552008	15 桂建工 CP001	200,000	20,186,612.57	3.52
2	041558009	15 圣农 CP001	200,000	20,087,955.40	3.50
3	110212	11 国开 12	200,000	19,996,625.40	3.48

4	011599669	15 南方水泥 SCP007	200,000	19,993,970.34	3.48
5	011543003	15 中核建 SCP003	200,000	19,990,581.39	3.48
6	011599942	15 南方水泥 SCP008	200,000	19,989,501.53	3.48
7	011561003	15 五矿股 SCP003	200,000	19,983,310.33	3.48
8	041562042	15 南山集 CP001	200,000	19,967,302.28	3.48
9	090205	09 国开 05	200,000	19,966,884.52	3.48
10	041558061	15 魏桥铝电 CP001	200,000	19,945,583.51	3.47

8.6 “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	149
报告期内偏离度的最高值	0.4134%
报告期内偏离度的最低值	0.1363%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2773%

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 投资组合报告附注

8.8.1

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。

8.8.2

本报告期内本基金持有剩余期限小于 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。

8.8.3 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、处罚的情形。

8.8.4 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,383,350.57
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,383,350.57

§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
汇添富理财 7 天债券 A	9,744	41,756.59	3,871,574.98	0.95%	403,004,663.22	99.05%
汇添富理财 7 天债券 B	13	12,866,612.53	136,168,496.35	81.41%	31,097,466.57	18.59%
合计	9,757	12,908,369.12	140,040,071.33	24.39%	434,102,129.79	75.61%

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	汇添富理财 7 天债券 A	212,568.83	0.0522%
	汇添富理财 7 天债券 B	0.00	0.0000%
	合计	212,568.83	0.0370%

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	汇添富理财 7 天债券 A	0
	汇添富理财 7 天债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富理财 7 天债券 A	0
	汇添富理财 7 天债券 B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
基金合同生效日（2013 年 5 月 29 日）基金份额总额	2,070,253,810.67	915,533,919.40
本报告期期初基金份额总额	618,280,814.60	155,962,290.43
本报告期基金总申购份额	2,181,386,673.00	814,206,110.84
减:本报告期基金总赎回份额	2,392,791,249.40	802,902,438.35
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	406,876,238.20	167,265,962.92

注：总申购份额含红利再投份额。

§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，由汤从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 5 月 29 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币伍万元整。

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	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过证券公司交易单元进行股票交易。

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、本基金本报告期末新增或退租交易单元。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，汇添富现金宝货币市场基金，汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金，汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富互利分级债券证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金及汇添富添富通货币市场基金共用。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本期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
2016 年 3 月 29 日