

汇添富理财 30 天债券型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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

送出日期：2016 年 8 月 27 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。本半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 8 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金简称 | 汇添富理财 30 天债券 | |
| 基金主代码 | 470030 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012 年 5 月 9 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 | 585,635,240.31 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 30 天债券 A | 汇添富理财 30 天债券 B |
| 下属分级基金的交易代码: | 470030 | 471030 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 492,852,967.41 份 | 92,782,272.90 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 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 | 将采用积极管理型的投资策略，原则上将投资组合的平均剩余期限控制在 150 天以内，在控制利率风险、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 | 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

| | |
|----------------------|--|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 汇添富理财 30 天债券 A | 汇添富理财 30 天债券 B |
|---------------|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 8,250,676.12 | 1,563,406.08 |
| 本期利润 | 8,250,676.12 | 1,563,406.08 |
| 本期净值收益率 | 1.4687% | 1.6150% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) | |
| 期末基金资产净值 | 492,852,967.41 | 92,782,272.90 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |

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、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 5 月 9 日，至本报告期末未满五年。

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 30 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 |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1887% | 0.0002% | 0.1107% | 0.0000% | 0.0780% | 0.0002% |
| 过去三个月 | 0.6328% | 0.0031% | 0.3357% | 0.0000% | 0.2971% | 0.0031% |
| 过去六个月 | 1.4687% | 0.0081% | 0.6713% | 0.0000% | 0.7974% | 0.0081% |
| 过去一年 | 3.1534% | 0.0084% | 1.3564% | 0.0000% | 1.7970% | 0.0084% |

| | | | | | | |
|-----------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去三年 | 13.3005% | 0.0079% | 4.1115% | 0.0000% | 9.1890% | 0.0079% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 18.0418% | 0.0069% | 5.7266% | 0.0000% | 12.3152% | 0.0069% |

汇添富理财 30 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 |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.2125% | 0.0002% | 0.1107% | 0.0000% | 0.1018% | 0.0002% |
| 过去三个月 | 0.7053% | 0.0031% | 0.3357% | 0.0000% | 0.3696% | 0.0031% |
| 过去六个月 | 1.6150% | 0.0081% | 0.6713% | 0.0000% | 0.9437% | 0.0081% |
| 过去一年 | 3.4530% | 0.0084% | 1.3564% | 0.0000% | 2.0966% | 0.0084% |
| 过去三年 | 14.2886% | 0.0079% | 4.1115% | 0.0000% | 10.1771% | 0.0079% |
| 自基金合同 生效日起至 今 | 19.4670% | 0.0069% | 5.7266% | 0.0000% | 13.7404% | 0.0069% |

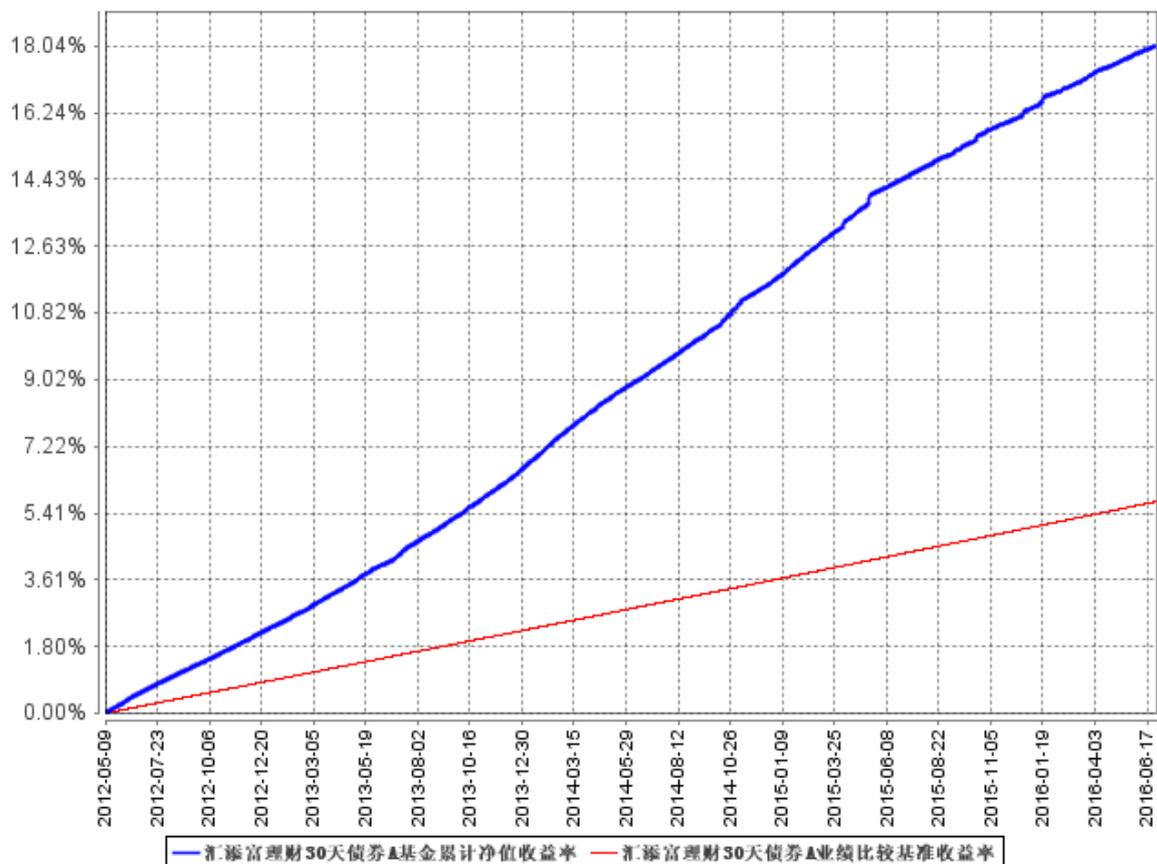
注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。

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。

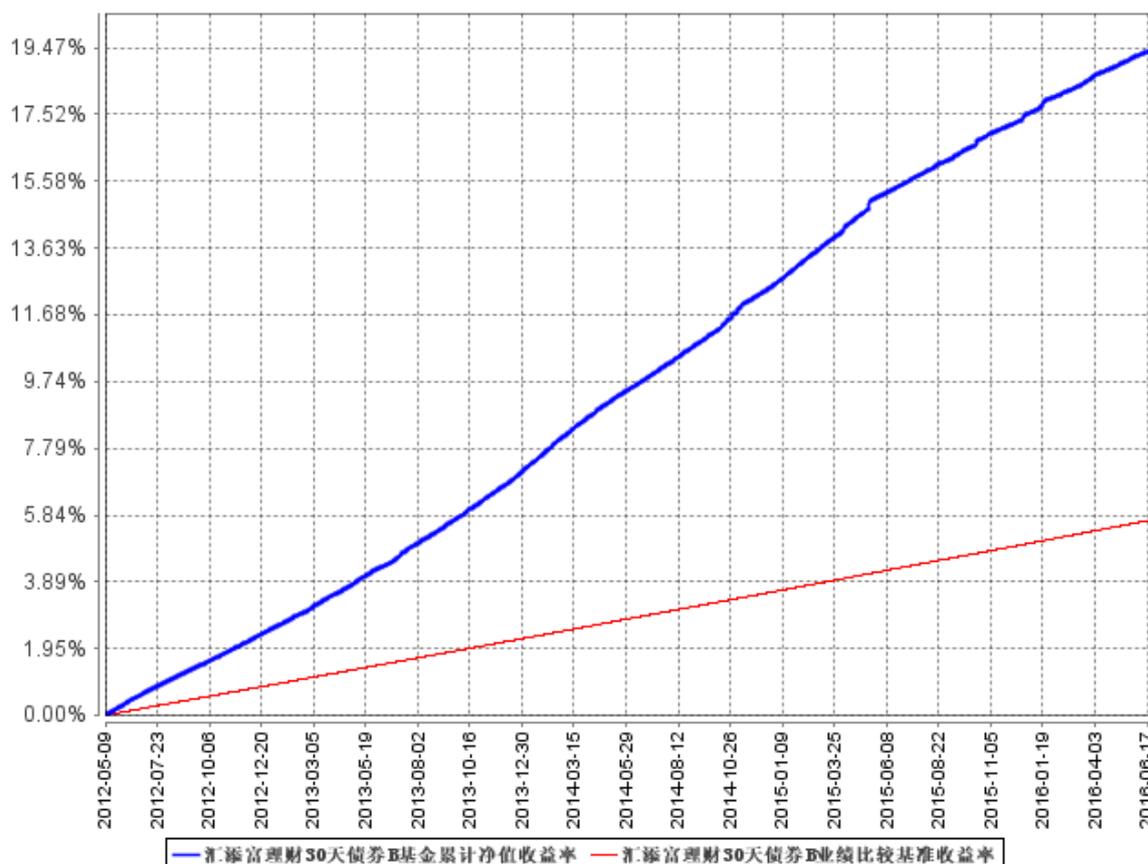
3、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 5 月 9 日，至本报告期末未满五年。

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30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30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2012年5月9日，截至本报告期末，基金成立未满五年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2012年5月9日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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11762.2978万元人民币。截止到2016年6月30日，公司管理证券投资基金规模约2857亿元，有效客户数约1200万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理63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、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、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、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、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 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、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、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、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 混合型证券投资基金、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、汇添富添富通货币市场基金、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、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、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、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 | | |
| 蒋文玲 | 汇添富货 | 2016 年 6 月 | - | 10 年 | 国籍：中国。学历： |

| | | | | | |
|-----|---|-----------------|----------------|-----|--|
| | <p>币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、理财 14 天债券基金、理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金、实业债债券基金、优选回报混合基金的基金经理。</p> | 7 日 | | | <p>上海财经大学经济学硕士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012 年 11 月 30 日至 2014 年 1 月 7 日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014 年 1 月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014 年 4 月 8 日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理，2015 年 3 月 10 日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 14 天债券基金、汇添富优选回报混合基金（原理财 21 天债券基金）的基金经理，2016 年 6 月 7 日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金、实业债债券基金的基金经理。</p> |
| 汤丛珊 | <p>汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财 30 天债券基金、汇添富理财 60 天债券基金、汇添富添富通货币基金的基金</p> | 2014 年 1 月 21 日 | 2016 年 6 月 7 日 | 8 年 | <p>国籍：中国，学历：上海财经大学管理学硕士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：2008 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013 年 7 月 31 日至今任汇添富货币基金的基金经理，2013 年 12 月 13 日至今任汇添富全额宝货币基金的</p> |

| | | | | |
|--|-----|--|--|---|
| | 经理。 | | | 基金经理。2014 年 1 月 21 日至今任汇添富理财 30 天债券、理财 60 天债券基金的基金经理。2014 年 5 月 28 日至 2015 年 7 月 30 日任汇添富和聚宝货币基金的基金经理。2015 年 1 月 16 日至今任汇添富添富通货币基金（原汇添富新收益债券基金）的基金经理。 |
|--|-----|--|--|---|

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，由于组合投资策略导致。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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债市波动加大，走出“过山车”行情，1 季度收益率快速下行后触底反弹，整体波动不大，但是 3-4 月中下旬在铁物资、中城建等企业爆出违约事件后，市场情绪悲观，收益率窜升 50-60BP 以上，5 月份又在强劲配置需求的推动下快速下行，至 6 月底再度逼近一季末的低点。截至半年末，10 年金融债收益率为 3.18%左右，与去年末相比上行约 5-6BP，短融收益率则上行 7-8BP 至 2.90%，企业债和公司债则基本持平，收益率曲线进一步平坦化，不同信用资质的个券表现则有所分化。

考虑到本基金绝对规模偏低，加上今年债市波动频繁、短期资金面易受到冲击的特点，在投资策略上趋于谨慎，注重组合的流动性管理，在个券选择方面，回避可能有信用风险的中低评级债券，以流动性较好的 AA+和 AAA 以上债券为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年本基金 A 级净值收益率为 1.4687%，B 级净值的收益率为 1.6150%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年的阶段，债市仍未摆脱纠结的局面，虽然经济短暂企稳后再次掉头向下得到印证，个位数的固定资产投资增速大幅低于市场预期，房地产开工和投资增速也显著放缓，基本面仍然利好债市，但是从央行的表态和动作来看，为控制杠杆率的高企，避免资产价格进一步泡沫化，降准降息等宽松货币政策出台的可能性极小，MLF 和公开市场操作投放短期资金的方式更加具备操控性和精准性。我们注意到近期人民币再次出现“渐进式”大幅贬值，也说明在全球金融市场动荡的格局下，央行的政策重心暂时仍放在汇率上，名义宽松实际稳健的货币政策短期内不会有

大的调整。债市在收益率绝对水平偏低的情况下难有想象空间，交易盘的过于集中和脆弱导致其波动频繁，区间狭窄。

另一方面，在经济持续低迷的市场环境中，企业违约的爆发频率在提升，信用风险的防范仍然不可掉以轻心。

理财类基金整体都面临规模较小、持续缩水的局面。我们将根据本基金的份额变动规律，合理搭配回购、同业存款、同业存单、短融、金融债等品种，力争在注重流动性的同时提高组合收益，同时会针对债券市场风险频发的现状，做好债券资质的筛查，避免出现所投资债券评级下调、到期无法兑现的情况。

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。

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、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

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：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 1,096,832.88 元，本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间累计分配收益 9,814,082.20 元，其中人民币 9,013,349.55 元以红利再投资方式结转入实收基金，人民币 1,287,925.11 元因基金赎回而支付给投资者，其余人民币 609,640.42 元为期末应付收益。

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理财 30 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 30 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 30 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股份有限公司编制和披露的汇添富理财 30 天债券型证券投资基金 2016 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富理财 30 天债券型证券投资基金
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 342,978,073.39 | 201,288,726.11 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 239,037,238.52 | 420,462,819.34 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 239,037,238.52 | 420,462,819.34 |
| 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 | - | - |
| 应收利息 | 3,879,677.75 | 9,873,056.28 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 882,000.00 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 586,776,989.66 | 631,624,601.73 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 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 | - | 18,999,790.50 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 137,019.52 | 142,969.75 |
| 应付托管费 | 40,598.38 | 42,361.46 |
| 应付销售服务费 | 125,492.38 | 154,959.26 |
| 应付交易费用 | 10,409.49 | 15,572.49 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | 1,171.55 |
| 应付利润 | 609,640.42 | 1,096,832.88 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 218,589.16 | 269,300.00 |
| 负债合计 | 1,141,749.35 | 20,722,957.89 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 585,635,240.31 | 610,901,643.84 |

| | | |
|------------|----------------|----------------|
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 585,635,240.31 | 610,901,643.84 |
| 负债和所有者权益总计 | 586,776,989.66 | 631,624,601.73 |

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 585,635,240.31 份，其中 A 级份额 492,852,967.41 份，B 级份额 92,782,272.90 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富理财 30 天债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| 一、收入 | 12,141,958.10 | 24,878,016.78 |
| 1.利息收入 | 9,483,432.37 | 20,865,196.60 |
| 其中：存款利息收入 | 4,740,472.86 | 11,002,358.66 |
| 债券利息收入 | 4,742,959.51 | 9,131,560.96 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 731,276.98 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 2,658,525.73 | 4,012,820.18 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,658,525.73 | 4,012,820.18 |
| 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 | 2,327,875.90 | 3,242,284.96 |
| 1. 管理人报酬 | 893,345.13 | 1,214,532.52 |
| 2. 托管费 | 264,694.85 | 359,861.48 |
| 3. 销售服务费 | 847,872.18 | 1,267,380.87 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 145,083.70 | 232,618.78 |

| | | |
|----------------------------|---------------------|----------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 145,083.70 | 232,618.78 |
| 6. 其他费用 | 176,880.04 | 167,891.31 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 9,814,082.20 | 21,635,731.82 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 9,814,082.20 | 21,635,731.82 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富理财 30 天债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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） | 610,901,643.84 | - | 610,901,643.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 9,814,082.20 | 9,814,082.20 |
| 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） | -25,266,403.53 | - | -25,266,403.53 |
| 其中：1.基金申购款 | 483,314,897.03 | - | 483,314,897.03 |
| 2.基金赎回款 | -508,581,300.56 | - | -508,581,300.56 |
| 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） | - | -9,814,082.20 | -9,814,082.20 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 585,635,240.31 | - | 585,635,240.31 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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） | 1,090,459,954.61 | - | 1,090,459,954.61 |
| 二、本期经营活动产生 | - | 21,635,731.82 | 21,635,731.82 |

| | | | |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| 的基金净值变动数（本期净利润） | | | |
| 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） | -306,815,687.67 | - | -306,815,687.67 |
| 其中：1.基金申购款 | 690,043,654.37 | - | 690,043,654.37 |
| 2.基金赎回款 | -996,859,342.04 | - | -996,859,342.04 |
| 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） | - | -21,635,731.82 | -21,635,731.82 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 783,644,266.94 | - | 783,644,266.94 |

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖
基金管理人负责人

张晖
主管会计工作负责人

韩从慧
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富理财 30 天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[2012]556 号文《关于核准汇添富理财 30 天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）作为发起人于 2012 年 5 月 2 日至 2012 年 5 月 7 日向社会公开募集。基金合同于 2012 年 5 月 9 日正式生效。首次设立募集规模为 24,441,718,012.59 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与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。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、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、短期融资券及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。本基金采用积极管理型的投资策略，原则上将投资组合的平均剩余期限控制在 150 天以内，在控制利率风险、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。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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。

6.4.7 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、基金注册登记机构 |
| 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 |
| 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 |

注：1、经本公司 2016 年第二次股东大会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准，本

公司的股东文汇新民联合报业集团已变更为上海上报资产管理有限公司。本公司已于 2016 年 8 月 13 日就上述股东变更事项进行公告。

2、以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本期未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 893,345.13 | 1,214,532.52 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 286,989.35 | 421,539.83 |

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 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|------------------------------------|------------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 264,694.85 | 359,861.48 |

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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 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 | | |
|----------------|---------------------------------|----------------|------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 汇添富理财 30 天债券 A | 汇添富理财 30 天债券 B | 合计 |
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 37,063.51 | 2,066.50 | 39,130.01 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 497,928.16 | 147.43 | 498,075.59 |
| 东方证券股份有限公司 | 876.98 | - | 876.98 |
| 合计 | 535,868.65 | 2,213.93 | 538,082.58 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 汇添富理财 30 天债券 A | 汇添富理财 30 天债券 B | 合计 |
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 44,326.70 | 2,053.90 | 46,380.60 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 724,075.99 | 229.08 | 724,305.07 |

| | | | |
|------------|------------|----------|------------|
| 司 | | | |
| 东方证券股份有限公司 | 3,766.27 | - | 3,766.27 |
| 合计 | 772,168.96 | 2,282.98 | 774,451.94 |

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基金资产净值的 0.30% 的年费率计提；B 类基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 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：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

R 为该类基金份额的销售服务费率

各类基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户。由注册登记机构分别支付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.8.3 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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 | - | - | - | - | 92,970,000.00 | 8,201.74 |

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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在本报告期内及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 | 978,073.39 | 10,155.73 | 1,355,232.97 | 7,738.71 |

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，2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止无利息收入（上年度可比期间：人民币 298.33 元），2016 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 0 元（上年度可比期间：人民币 0 元）。

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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金融资产款余额。

6.4.10 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 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 | 239,037,238.52 | 40.74 |
| | 其中: 债券 | 239,037,238.52 | 40.74 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 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 | 342,978,073.39 | 58.45 |
| 4 | 其他各项资产 | 4,761,677.75 | 0.81 |
| 5 | 合计 | 586,776,989.66 | 100.00 |

7.2 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 | 1.88 | |
| | 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 | - | - |
| | 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。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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 | 102 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 130 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 74 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 150 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.3.2 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 | 21.51 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 11.95 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 16.54 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 14.41 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 5.02 | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天 (含) | 34.96 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.37 | - |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 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 | 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 | 69,372,738.84 | 11.85 |
| | 其中：政策性金融债 | 69,372,738.84 | 11.85 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 149,800,075.02 | 25.58 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 19,864,424.66 | 3.39 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 239,037,238.52 | 40.82 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

7.6 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 | 011699761 | 16 中粮 SCP004 | 300,000 | 29,972,763.29 | 5.12 |
| 2 | 120227 | 12 国开 27 | 300,000 | 29,393,104.26 | 5.02 |
| 3 | 041653010 | 16 如意科技 CP001 | 200,000 | 19,992,318.67 | 3.41 |
| 4 | 160401 | 16 农发 01 | 200,000 | 19,988,778.13 | 3.41 |
| 5 | 041651016 | 16 大唐租赁 CP002 | 200,000 | 19,936,434.15 | 3.40 |
| 6 | 041663004 | 16 首钢 CP002 | 200,000 | 19,901,508.02 | 3.40 |
| 7 | 111691519 | 16 广州农村商业银行 CD017 | 200,000 | 19,864,424.66 | 3.39 |
| 8 | 150419 | 15 农发 19 | 100,000 | 10,004,076.64 | 1.71 |
| 9 | 041558072 | 15 仙琚 CP001 | 100,000 | 10,003,820.41 | 1.71 |

| | | | | | |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|------|
| 10 | 041558056 | 15 圣泽 CP002 | 100,000 | 10,002,253.22 | 1.71 |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|------|

7.7 “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 | 55 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.4436% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0960% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.2426% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内，本基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内，本基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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。

7.9.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 3,879,677.75 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收申购款 | 882,000.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,761,677.75 |

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 30 天债券 A | 12,041 | 40,931.23 | 1,519,008.41 | 0.31% | 491,333,959.00 | 99.69% |
| 汇添富理财 30 天债券 B | 5 | 18,556,454.58 | 75,839,167.47 | 81.74% | 16,943,105.43 | 18.26% |
| 合计 | 12,046 | 48,616.57 | 77,358,175.88 | 13.21% | 508,277,064.43 | 86.79% |

8.2 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。

8.3 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 30 天债券 A | 0 |
| | 汇添富理财 30 天债券 | 0 |

| | | |
|-----------------|----------------|---|
| | 券 B | |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 汇添富理财 30 天债券 A | 0 |
| | 汇添富理财 30 天债券 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 汇添富理财 30 天债券 A | 汇添富理财 30 天债券 B |
|-------------------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 5 月 9 日）基金份额总额 | 21,536,882,695.72 | 2,904,835,316.87 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 599,760,453.25 | 11,141,190.59 |
| 本报告期基金总申购份额 | 317,761,735.50 | 165,553,161.53 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 424,669,221.34 | 83,912,079.22 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 492,852,967.41 | 92,782,272.90 |

注：表内“总申购份额”含红利再投份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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 2016 年 1 月 14 日公告，陈晓翔先生不再担任汇添富价值精选混合型证券投资基金的基金经理，由劳杰男先生单独管理该基金。

2、《汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 1 月 21 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

3、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 11 日正式生效，何旻

先生和李怀定先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2016 年 3 月 12 日公告，增聘马翔先生担任汇添富民营活力混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。

5、《汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 16 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2016 年 4 月 2 日公告，陈灿辉先生不再担任副总经理。

7、基金管理人 2016 年 4 月 9 日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富消费行业混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。

8、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 19 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 3 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

11、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

12、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

13、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

14、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富添富通货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

15、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

16、本报告期，基金托管人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

本基金投资策略未发生改变。

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

本报告期内，针对中国证监会出具的责令改正措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性的制定、实施整改措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前公司已完成相关整改工作。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | 3 | - | - | - | - | - |

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 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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

以上 3 个交易单元与汇添富理财 7 天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、汇添富互利分级债券证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富收益快线货币市场基金共用。本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：东方证券（上交所交易单元）。

10.8 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 8 月 27 日