

# 汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资 基金 2016 年半年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业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、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

汇添富信用债债券型证券投资基金于 2016 年 02 月 17 日变更注册为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变，其中 A 类份额基金代码为“470088”，C 类份额基金代码为“470089”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

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。其中，2016 年 2 月 17 日起，“汇添富信用债债券型证券投资基金”转型为“汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金”。汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金合同及托管协议即日生效。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况（转型前）.....	5
2.1 基金基本情况（转型后）.....	5
2.2 基金产品说明（转型前）.....	5
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现（转型前）.....	8
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>22</b>
6.1 资产负债表(转型前).....	22
6.2 利润表(转型前).....	23
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
6.4 报表附注.....	25
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>45</b>
6.1 资产负债表（转型后）.....	45
6.2 利润表.....	46
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	47
6.4 报表附注.....	48
<b>§7 投资组合报告(转型前)</b> .....	<b>70</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	70
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	70
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	71

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	72
7.6 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.....	72
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	73
7.8 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.....	73
7.9 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.....	73
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
7.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§7 投资组合报告(转型后).....</b>	<b>74</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	74
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	74
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后).....	75
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	77
7.6 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.....	77
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	78
7.8 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.....	78
7.9 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.....	78
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	78
7.12 投资组合报告附注 .....	78
<b>§8 基金份额持有人信息(转型前).....</b>	<b>79</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
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.....	79
<b>§8 基金份额持有人信息(转型后).....</b>	<b>80</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	80
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	80
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.....	80
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>81</b>
<b>转型后: .....</b>	<b>81</b>
<b>转型前: .....</b>	<b>81</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>81</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	81
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.....	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	83
10.4 基金投资策略的改变 .....	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	83
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 .....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后).....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前).....	85
10.8 其他重大事件 (转型后) .....	88
10.8 其他重大事件 (转型前) .....	90
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>90</b>

11.1 备查文件目录 .....90  
 11.2 存放地点 .....91  
 11.3 查阅方式 .....91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	汇添富信用债债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富信用债债券	
基金主代码	470088	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 12 月 20 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,622,579,429.74 份	
基金合同存续期（若有）	不定期	
下属分级基金的基金简称：	汇添富信用债 A	汇添富信用债 C
下属分级基金的交易代码：	470088	470089
报告期末下属分级基金的份额总额	1,617,915,878.89 份	4,663,550.85 份

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富 6 月红定期开放债券	
基金主代码	470088	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 2 月 17 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,622,579,429.74 份	
基金合同存续期（若有）	不定期	
下属分级基金的基金简称：	汇添富 6 月红定期开放债券 A	汇添富 6 月红定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码：	470088	470089
报告期末下属分级基金的份额总额	1,617,915,878.89 份	4,663,550.85 份

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金主要投资于信用债券类固定收益品种，在严格管理投资风险、保持资产流动性的基础上，为基金份额持有人追求资产的长期稳定增值。
------	--

投资策略	本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的资产不低于基金固定收益类资产的 80%；股票等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准（若有）	中债综合指数
风险收益特征（若有）	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种，在严格管理投资风险，保持资产的流动性的基础上，为基金份额持有人追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，在严格控制风险的基础上，动态调整基金大类资产的投资比例，力争为基金资产获取稳健回报。
业绩比较基准（若有）	中债综合指数*90%+沪深 300 指数*10%
风险收益特征（若有）	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	林葛
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		李文	周慕冰

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

## § 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	报告期(2016 年 1 月 1 日- 2016 年 2 月 16 日)	
	汇添富信用债 A（转型前）	汇添富信用债 C（转型前）
本期已实现收益	46,898,282.63	175,660.13
本期利润	36,188,374.60	126,055.18
加权平均基金份额本期利润	0.0362	0.0325
本期加权平均净值利润率	3.06	2.79
本期基金份额净值增长率	-0.59%	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 2 月 16 日）	
期末可供分配利润	59,083,776.79	111,016.84
期末可供分配基金份额利润	0.0365	0.0238
期末基金资产净值	1,617,915,878.89	4,663,550.85
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 2 月 16 日）	
基金份额累计净值增长率	-0.51%	-0.57%

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 2 月 17 日- 2016 年 6 月 30 日)	
	汇添富信用债 A（转型后）	汇添富信用债 C（转型后）
本期已实现收益	30,514,785.29	80,997.52
本期利润	38,404,115.15	103,712.14
加权平均基金份额本期利润	0.0237	0.0222
本期加权平均净值利润率	2.35%	2.20%
本期基金份额净值增长率	2.40%	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）	

期末可供分配利润	30,514,785.29	80,997.52
期末可供分配基金份额利润	0.0189	0.0174
期末基金资产净值	1,656,319,994.04	4,767,262.99
期末基金份额净值	1.024	1.022
3.1.3 累计期末指标 报告期末(2016年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	2.40%	2.20%

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、汇添富信用债债券型证券投资基金从 2016 年 02 月 17 日起正式转型为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富信用债 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
自 2016-01-01 至 2016-02-16	-0.59%	0.16%	0.06%	0.10%	-0.65%	0.06%
自 2015-07-01 至 2016-02-16	4.34%	0.24%	3.02%	0.08%	1.32%	0.16%
自 2013-07-01 至 2016-02-16	10.20%	0.27%	6.03%	0.10%	4.17%	0.17%
自 2011-12-20 至 2016-02-16	20.12%	0.22%	7.47%	0.09%	12.65%	0.13%

汇添富信用债 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

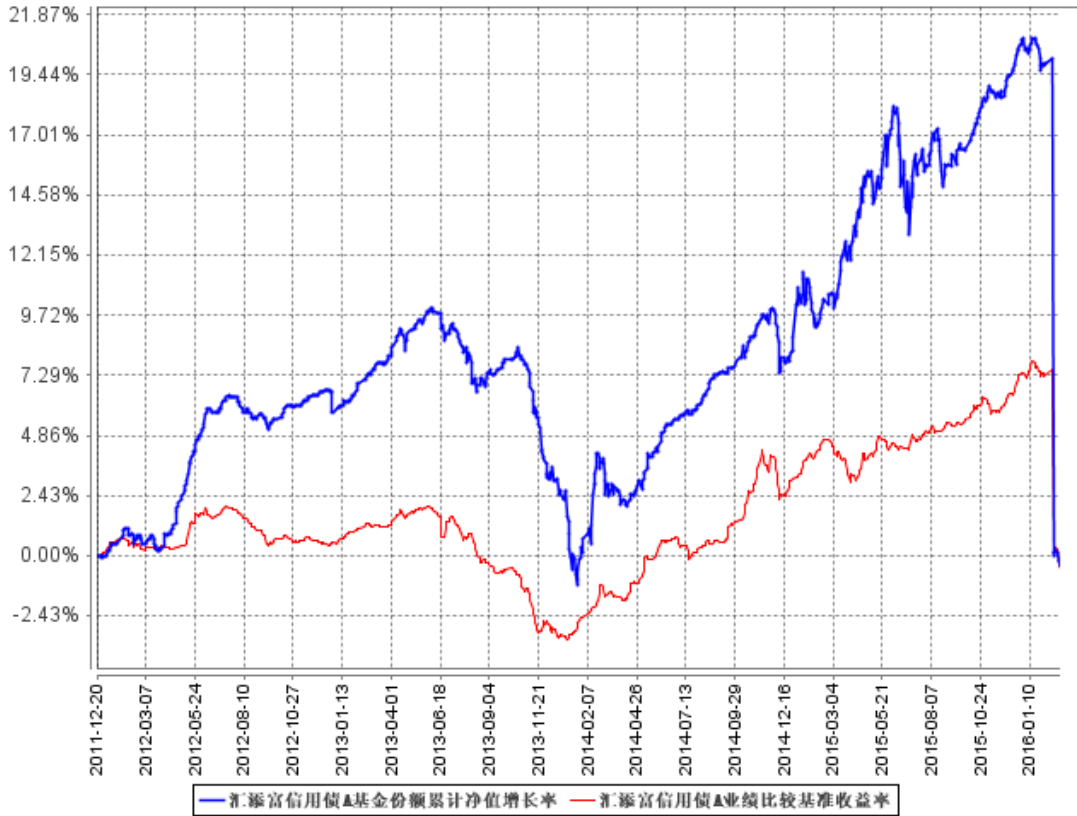


		准差②	率③	④		
自 2016-01-01 至 2016-02-16	-0.60%	0.16%	0.06%	0.10%	-0.66%	0.06%
自 2015-07-01 至 2016-02-16	4.21%	0.24%	3.02%	0.08%	1.19%	0.16%
自 2013-07-01 至 2016-02-16	9.22%	0.27%	6.03%	0.10%	3.19%	0.17%
自 2011-12-20 至 2016-02-16	18.50%	0.22%	7.47%	0.09%	11.03%	0.13%

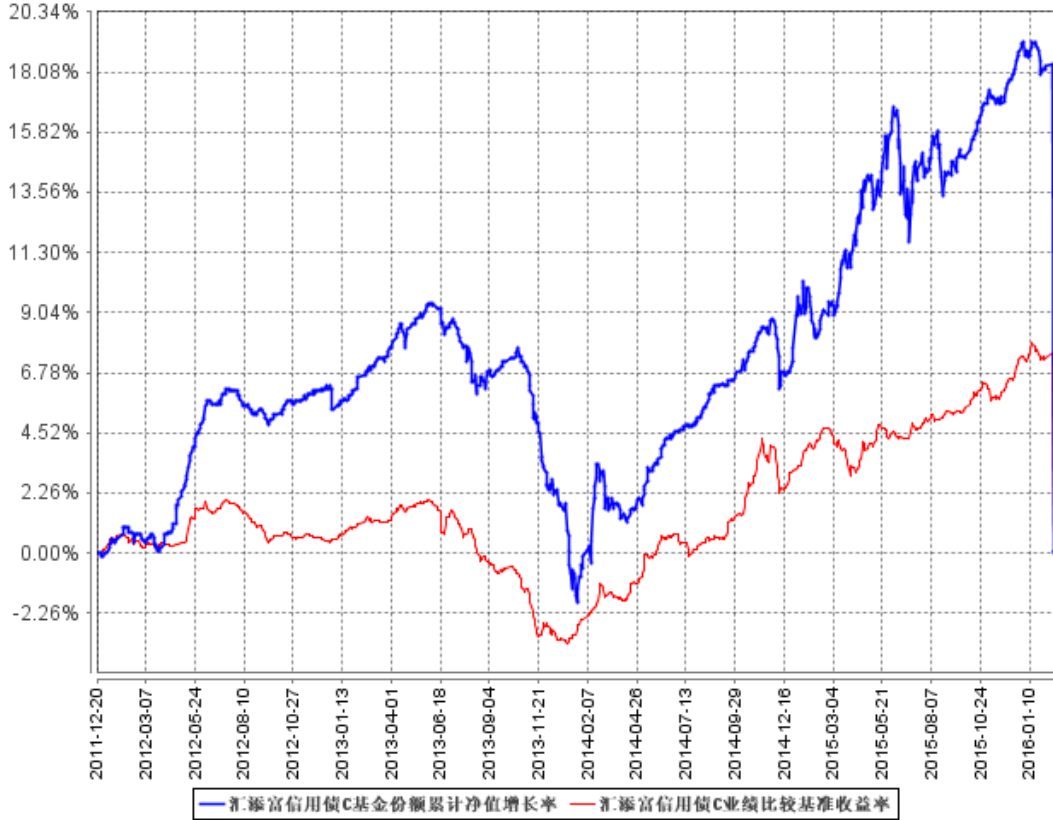
注：汇添富信用债债券型证券投资基金于 2016 年 02 月 17 日变更注册为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金。本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为中债综合指数。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富信用债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



汇添富信用债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： 本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年12月20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；本基金从2016年02月17日变更注册为汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金。

3.2 基金净值表现（转型后）

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 6 月红定期开放债券 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
过去一个月	0.99%	0.11%	0.28%	0.12%	0.71%	-0.01%
过去三个月	0.99%	0.12%	-0.66%	0.12%	1.65%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.40%	0.13%	0.14%	0.15%	2.26%	-0.02%

汇添富 6 月红定期开放债券 C

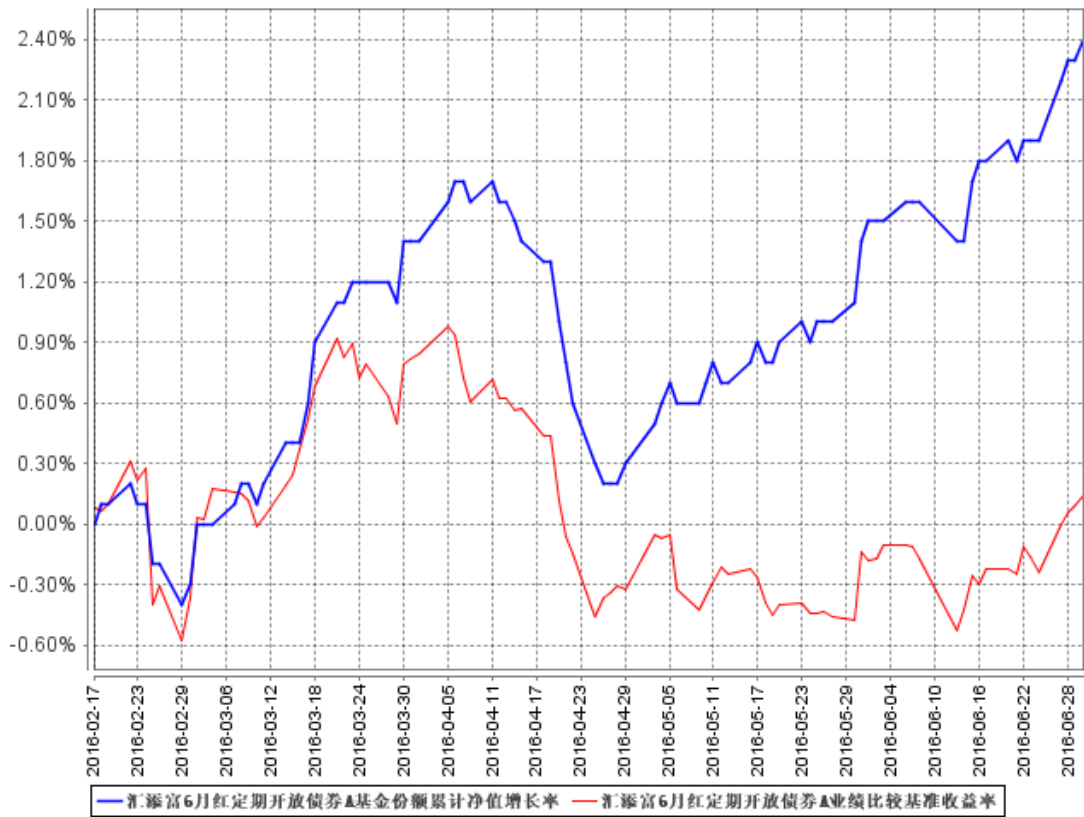
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.89%	0.12%	0.28%	0.12%	0.61%	0.00%

过去三个月	0.79%	0.13%	-0.66%	0.12%	1.45%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.13%	0.14%	0.15%	2.06%	-0.02%

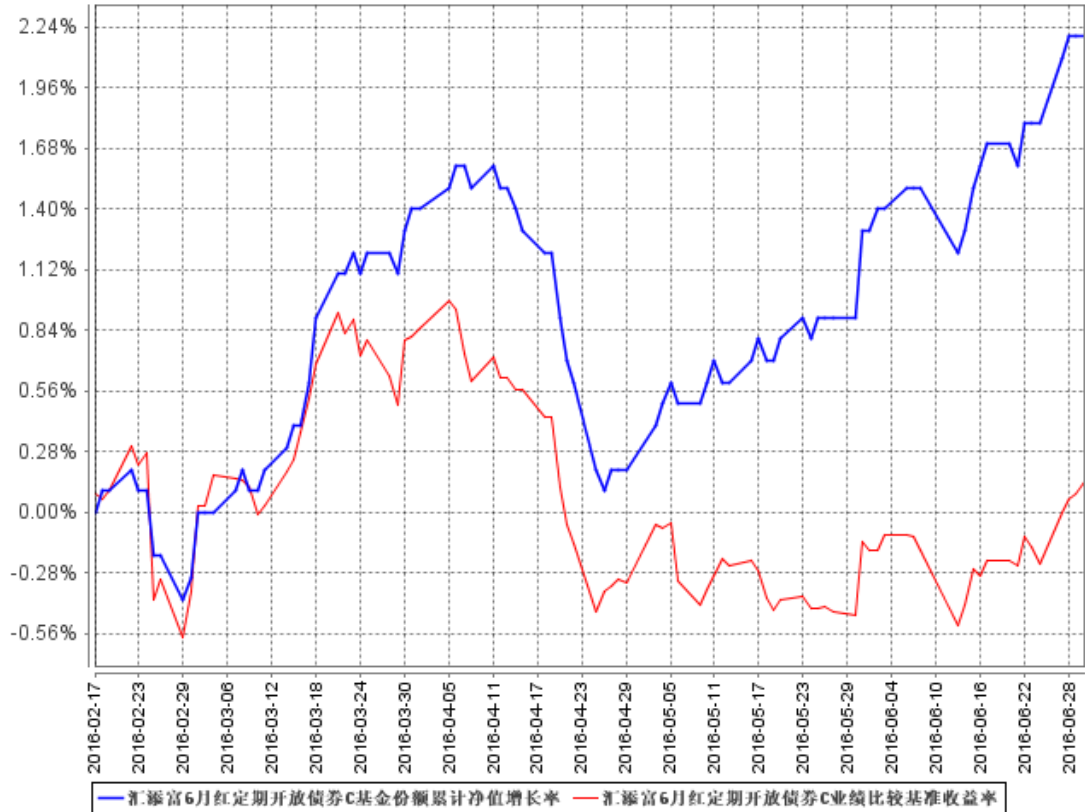
注：本基金的《基金合同》生效日为 2016 年 2 月 17 日，至本报告期末未满一年。

### 3.2.2 自基金转型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 6 月红定期开放债券 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6月红定期开放债券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：1、本基金的《基金合同》生效日为 2016 年 2 月 17 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016 年 2 月 17 日）起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## § 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

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、汇添富收益快线货币市场基金、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		

何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富 6 月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理。	2014 年 1 月 21 日		18 年	<p>国籍：中国。学历：英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。</p> <p>相关业务资格：基金从业资格、特许金融分析师（CFA），财务风险经理（FRM）。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理，固定收益部负责人；金元比联基金管理有限公司基金经理。2004 年 10 月 28 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金龙债券基金的基金经理，2005 年 10 月 27 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金象保本基金的基金经理，2006 年 4 月 28 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007 年 8 月 15 日至 2010 年 12 月 29 日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理，2008 年 9 月 3 日至 2009 年 3 月 10 日担任金元比联成长动力混</p>
----	--	-----------------	--	------	---

					合基金的基金经理，2009 年 3 月 29 日至 2010 年 12 月 29 日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011 年 1 月加入汇添富资产管理（香港）有限公司，2012 年 2 月 17 日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2013 年 11 月 22 日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理，2014 年 1 月 21 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金（原汇添富信用债债券基金）的基金经理，2016 年 3 月 11 日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理。
曾刚	汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添	2016 年 2 月 17 日		15 年	国籍：中国。学历：中国科技大学学士，清华大学 MBA。业务资格：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



	<p>利定期开放债券基金、汇添富 6 月红定期开放债券基金、汇添富盈安保本基金的基金经理，固定收益投资副总监。</p>			<p>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，现任固定收益投资副总监。2012 年 5 月 9 日至 2014 年 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</p>
--	---	--	--	---

					<p>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 至 2015 年 3 月 31 日任汇添富现金宝货币基金的基金经理, 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, 2016 年 2 月 17 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金的基金经理, 2016 年 3 月 16 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理, 2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益, 无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为, 本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 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，基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易次数为 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

2016 年上半年，央行的货币政策宽松力度较去年有所减弱，仅 2 月底对国内的人民币存款准备金率下调一次，第二季度央行并未实施进一步的降准或者降息的政策。这一改变，主要是受到国内房地产市场价格预期、人民币汇率贬值预期以及美国联储加息预期的影响。进入 2016 年之后，国内一二线城市的商品房价格加速上涨，多个城市相继出台限购政策来控制房价进一步过快上涨。由于猪肉和蔬果价格的上涨，CPI 在一季度也有上升趋势，第二季度消费者价格指数逐月走低，6 月份已经回落至 2% 以下。PPI 的同比降幅缩窄，反映了国内经济在短期内略有复苏的迹象。工业企业盈利同比增速略有回落，可能预示今年的企业盈利高点已过。M1 同比增速明显回升，而 M2 同比增速却逐月回落，M1 的持续走高一方面反映了流动性的充裕程度，另一方面也体现了实体投资意愿的不足。人民币汇率在年初略有贬值，之后转为波动中略有升值。第二季度，人民币相对于美元的汇率持续走低，特别是在 6 月底英国脱欧、美元走强之后，汇率贬值加速。上半年，沪深 300 指数下跌 15.47%。债券市场上，中债综合指数上涨 1.57%。

本基金在第一季度增加了股票和转债的投资比例，债券组合中缩短久期，降低持有债券的信用等级，调低杠杆率，从而提高组合静态收益率，减少市场波动带来的影响。在第二季度，略增加了股票的比例，转债比例基本未变。债券组合中久期有所加长，提高了持有债券的信用等级，杠杆率略有增加，组合静态收益率不变。在第二季度中，卖出了信用资质较低的中期票据和公司债，买入了 AAA 等级的公司债和中票。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自 2 月 17 日转型成立至上半年底，A 级净值增长率为 2.40%，C 级净值增长率为 2.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，我们认为，央行总体上会保持中性的货币政策，可能考虑到汇率等因素，会有一次降准。消费者价格指数维持在 2% 的水平，生产者价格指数反弹力度会减弱，整体来看，物价没有通胀之忧。制造业部门的盈利可能会恶化，供给侧改革重点进行的周期性行业中，一些公司的债券仍然可能陆续出现信用风险。美国非农数据可能会超出市场预期，但薪资增长水平低于预期，美联储年内加息概率并未明显上升，人民币有望阶段性企稳。我们预计，债券市场的收益率在下半年仍然会逐级下降，期间会出现短暂的向上波动。从债券品种来看，我们更看好中低等级的公司债券。本基金的操作上，股票方面以精选个股为主，债券方面以买入中等级信用债券为主。

#### 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

转型前，汇添富信用债债券型证券投资基金基金《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，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 20%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

转型后：汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于其面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于其面值。

本基金于 2016 年 8 月 12 日实施利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.19 元人民币。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务

指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

### 6.1 资产负债表(转型前)

会计主体：汇添富信用债债券型证券投资基金

报告截止日： 2016 年 2 月 16 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

资产	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	167,839,767.88	7,865,595.14
结算备付金		14,686,556.60	9,745,278.11
存出保证金		44,010.77	62,100.17
交易性金融资产	6.4.7.2	1,534,868,173.39	1,439,720,284.99
其中：股票投资		15,316,832.94	33,952,428.72
基金投资		-	-
债券投资		1,519,551,340.45	1,405,767,856.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	60,000,000.00	-
应收证券清算款		32,269,368.65	4,986,435.91
应收利息	6.4.7.5	33,530,880.54	39,515,742.53
应收股利		-	-
应收申购款		72,739.28	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,843,311,497.11	1,501,895,436.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>报告期初至转型前</b>	<b>上年度末 2015 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		22,000,000.00	374,999,260.00
应付证券清算款		196,837,992.14	20,097.27
应付赎回款		813,335.20	323.52
应付管理人报酬		492,557.32	663,057.28
应付托管费		140,730.65	189,444.93

应付销售服务费		879.15	1,305.05
应付交易费用	6.4.7.7	13,059.03	53,084.79
应交税费		24,570.00	24,570.00
应付利息		-	83,937.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	408,943.88	341,481.44
负债合计		220,732,067.37	376,376,561.72
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,622,579,429.74	948,695,601.10
未分配利润	6.4.7.10	-	176,823,274.03
所有者权益合计		1,622,579,429.74	1,125,518,875.13
负债和所有者权益总计		1,843,311,497.11	1,501,895,436.85

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2016 年 02 月 16 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 1,622,579,429.74 份，其中 A 类基金份额总额 1,617,915,878.89 份，份额净值 1.000 元；C 类基金份额总额 4,663,550.85 份，份额净值 1.000 元。

## 6.2 利润表(转型前)

会计主体：汇添富信用债债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-3,097,880.28	60,037,209.27
1.利息收入		10,229,406.68	22,540,398.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	121,515.54	191,091.02
债券利息收入		9,996,853.84	22,062,395.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		111,037.3	286,911.50
其他利息收入			-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-2,570,272.32	21,086,449.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,741,653.84	12,257,520.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,171,381.52	7,990,588.53
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16		838,340.33

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,759,512.98	16,374,368.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,498.34	35,992.93
<b>减：二、费用</b>		2,631,506.22	6,530,092.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,159,190.66	3,440,415.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	331,197.31	982,976.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,399.33	10,458.39
4. 交易费用	6.4.7.19	23,061.67	94,392.17
5. 利息支出		1,037,345.45	1,814,417.11
其中：卖出回购金融资产支出		1,037,345.45	1,814,417.11
6. 其他费用	6.4.7.20	78,311.8	187,433.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,729,386.50	53,507,116.42

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富信用债债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 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）	948,695,601.10	176,823,274.03	1,125,518,875.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,729,386.50	-5,729,386.50
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）	427,385,302.62	75,404,638.49	502,789,941.11
其中：1. 基金申购款	433,214,060.24	76,422,639.12	509,636,699.36
2. 基金赎回款	-5,828,757.62	-1,018,000.63	-6,846,758.25
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）	246,498,526.02	-246,498,526.02	-
五、期末所有者权益（基金	1,622,579,429.74	-	1,622,579,429.74



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
净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	528,895,532.79	35,907,233.55	564,802,766.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,507,116.42	53,507,116.42
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)	420,290,083.67	34,005,367.35	454,295,451.02
其中: 1. 基金申购款	550,902,681.63	45,511,758.40	596,414,440.03
2. 基金赎回款	-130,612,597.96	-11,506,391.05	-142,118,989.01
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)	949,185,616.46	123,419,717.32	1,072,605,333.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富信用债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[2011]1800号文《关于核准汇添富信用债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 2011 年 12 月 20 日正式生效,首次设立募集规模为 719,620,588.36 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金以宏观经济分析和深入的基本面研究为基础,根据经济发展不同阶段的特点,精选高质量的信用债券进行组合投资,以获得长期稳健的投资收益。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括中小企业私募债券、公司债、企业债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、国债、金融债、债券回购、央行票据、银行存款,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。本基金可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，但不直接从二级市场上买入股票和权证。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

#### 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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会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 2 月 16 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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

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

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 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。

## 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。

## 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 2 月 16 日
活期存款	167,839,767.88
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	
合计：	167,839,767.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 2 月 16 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,600,756.86	15,316,832.94	-6,283,923.92
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	787,130,340.45	17,872,059.92
	银行间市场	732,421,000.00	22,978,555.37
	合计	1,519,551,340.45	40,850,615.29
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,500,301,482.02	1,534,868,173.39	34,566,691.37

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 2 月 16 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	60,000,000.00	-
合计	60,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年2月16日
应收活期存款利息	87,890.08
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	32,873.31
应收债券利息	33,360,644.03
应收买入返售证券利息	39,230.97
应收申购款利息	10,077.51
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	164.64
合计	33,530,880.54

注：“其他”为应收交易保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年2月16日
交易所市场应付交易费用	9,519.05
银行间市场应付交易费用	3,539.98
合计	13,059.03

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年2月16日
应付赎回费	419.86
应付审计费	90,273.26
应付信息披露费	248,250.76
应付持有人大会费用	60,000.00

应付公证费	10,000.00
合计	408,943.88

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富信用债 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	945,429,582.31	945,429,582.31
本期申购	430,254,636.62	430,254,636.62
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,614,759.29	-3,614,759.29
基金拆分/份额折算变动份额	245,846,419.25	245,846,419.25
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,617,915,878.89	1,617,915,878.89

汇添富信用债 C		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,266,018.79	3,266,018.79
本期申购	2,959,423.62	2,959,423.62
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,213,998.33	-2,213,998.33
基金拆分/份额折算变动份额	652,106.77	652,106.77
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	4,663,550.85	4,663,550.85

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富信用债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,824,602.50	141,444,822.87	176,269,425.37
本期利润	5,005,967.09	-10,709,908.03	-5,703,940.94
本期基金份额交易产生的变动数	19,253,207.20	56,027,727.62	75,280,934.82
其中：基金申购款	19,410,683.44	56,516,435.58	75,927,119.02
基金赎回款	-157,476.24	-488,707.96	-646,184.20

本期已分配利润	-59,083,776.79	-186,762,642.46	-245,846,419.25
本期末	-	-	-

汇添富信用债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	69,970.55	483,878.11	553,848.66
本期利润	24,159.39	-49,604.95	-25,445.56
本期基金份额交易产生的变动数	16,886.90	106,816.77	123,703.67
其中：基金申购款	69,809.19	425,710.91	495,520.10
基金赎回款	-52,922.29	-318,894.14	-371,816.43
本期已分配利润	-111,016.84	-541,089.93	-652,106.77
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年2月16日
活期存款利息收入	82,813.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,488.01
其他	10,214.15
合计	121,515.54

注：表中“其他”为结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年2月16日
卖出股票成交总额	10,280,561.11
减：卖出股票成本总额	15,022,214.95
买卖股票差价收入	-4,741,653.84

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年2月16日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	115,706,226.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	110,149,589.74
减：应收利息总额	3,385,254.80
买卖债券差价收入	2,171,381.52

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期末未投资衍生工具。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期末未投资衍生工具。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期间无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年2月16日
1. 交易性金融资产	-10,759,512.98
——股票投资	-3,613,380.83
——债券投资	-7,146,132.15
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-10,759,512.98



#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日
基金赎回费收入	2,498.34
合计	2,498.34

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日
交易所市场交易费用	20,861.67
银行间市场交易费用	2,200.00
合计	23,061.67

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日
审计费用	10,273.26
信息披露费	28,250.76
银行划款费用	1,739.22
公证费	4,074.08
持有人大会费用	24,444.48
帐户维护费	9,530.00
合计	78,311.80

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

2016 年 1 月 11 日，汇添富信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了关于汇添富信用债债券型证券投资基金转型相关事项的议案。该大会决议自该日起生效，基金管理人在五日内向中国证监会履行相应备案手续。2016 年 2 月 16 日，基金管理人就汇添富信用债债券型证券投资基金进行份额折算。自汇添富信用债债券型证券投资基金基金份

额折算日次日（即 2016 年 2 月 17 日）起，《汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效，《汇添富信用债债券型证券投资基金基金合同》同时失效，汇添富信用债债券型证券投资基金正式变更为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金，本基金基金合同当事人将按照《汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

#### 6.4.9 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
中国农业银行股份有限公司	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
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
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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	2,766,633.46	26.91%	41,988,799.71	100.00%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东方证券股份	7,219,689.85	28.97%	452,230,224.47	100.00%

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东方证券股份 有限公司	1,227,000,000.00	38.06%	12,142,000,000.00	100.00%

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未发生权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 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	2,521.26	26.49%	2,521.26	26.49%
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 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	38,226.35	100.00%	38,226.35	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 16 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	1,159,190.66	3,440,415.99

的管理费		
其中：支付销售机构的客 户维护费 <sup>1</sup>	1,986.31	8,623.27

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 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 2 月 16 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	331,197.31	982,976.02

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

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 2 月 16 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富信用债 A	汇添富信用债 C	合计
中国农业银行股份有限公司		321.25	321.25
汇添富基金管理股份有限公司		1,478.96	1,478.96
东方证券股份有限公司		0	0
合计		1,800.21	1,800.21
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	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		
	汇添富信用债 A	汇添富信用债 C	合计
中国农业银行股份有限公司	0.00	2,169.81	2,169.81
汇添富基金管理股份有限公司	0.00	5,349.19	5,349.19
东方证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	7,519.00	7,519.00

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

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.3 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 2 月 16 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
中国农业银行股份有限公司	-	-	-	-	60,000,000.00	68,350.68
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
中国农业银行股份有限公司	-	20,311,446.30	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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区间未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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 2 月 16 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
中国农业银行股份有限公司	167,839,767.88	82,813.38	16,902,164.27	103,996.32

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 2 月 16 日期间获得的利息收入为人民币 28,488.01（2015 年度：人民币 61,173.32 元），2016 年 2 月 16 日结算备付金余额为人民币 14,686,556.6 元（2015 年 12 月 31 日余额为 19,106,372.12 元）。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016 年 2 月 16 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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
112336	16 太安债	2016 年 2 月 3 日	2016 年 4 月 7 日	新债未上市	100.00	99.98	200,000	19,995,633.97	19,995,633.97	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 2 月 16 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证券款余额。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 2 月 16 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 22,000,000.00 元，于 2016 年 2 月 17 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 02 月 16 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	180,151,000.00	40,040,000.00
合计	180,151,000.00	40,040,000.00

注：未评级债券为超短期融资券、国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 02 月 16 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
--------	-------------------------	--------------------------

AAA	153,805,184.20	132,628,609.60
AAA 以下	1,147,935,889.75	1,132,686,069.17
未评级	37,659,267.50	100,413,177.50
合计	1,339,400,341.45	1,365,727,856.27

注：未评级债券为国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持有的部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于年末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性要求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、部分应收申购款及债券投资等；生息负债主要为卖出回购金融资产款。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016 年 2 月 16 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	167,839,767.88	-	-	-	-	-	167,839,767.88
结算备付金	14,686,556.60	-	-	-	-	-	14,686,556.60



存出保证金	44,010.77	-	-	-	-	-	44,010.77
交易性金融资产	8,009,600.00	128,805,400.00	131,926,150.40	777,330,330.25	473,479,859.80	15,316,832.94	1,534,868,173.39
买入返售金融资产	60,000,000.00	-	-	-	-	-	60,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	32,269,368.65	32,269,368.65
应收利息	-	-	-	-	-	33,530,880.54	33,530,880.54
应收申购款	12,023.33	-	-	-	-	60,715.95	72,739.28
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	250,591,958.58	128,805,400.00	131,926,150.40	777,330,330.25	473,479,859.80	81,177,798.08	1,843,311,497.11
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	22,000,000.00	-	-	-	-	-	22,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	196,837,992.14	196,837,992.14
应付赎回款	-	-	-	-	-	813,335.20	813,335.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	492,557.32	492,557.32
应付托管费	-	-	-	-	-	140,730.65	140,730.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-	879.15	879.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,059.03	13,059.03
应交税费	-	-	-	-	-	24,570.00	24,570.00
其他负债	-	-	-	-	-	408,943.88	408,943.88
负债总计	22,000,000.00	-	-	-	-	198,732,067.37	220,732,067.37

利率敏感 度缺 口	228,591,958.58	128,805,400.00	131,926,150.40	777,330,330.25	473,479,859.80	-117,554,269.29	1,622,579,429.74
上年度 末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,865,595.14	-	-	-	-	-	7,865,595.14
结算备 付金	9,745,278.11	-	-	-	-	-	9,745,278.11
存出保 证金	62,100.17	-	-	-	-	-	62,100.17
交易性 金融资 产	20,002,000.00	49,069,980.00	78,284,496.82	1,028,863,752.58	229,547,626.87	33,952,428.72	1,439,720,284.99
应收证 券清算 款	-	-	-	-	-	4,986,435.91	4,986,435.91
应收利 息	-	-	-	-	-	39,515,742.53	39,515,742.53
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-
资产总 计	37,674,973.42	49,069,980.00	78,284,496.82	1,028,863,752.58	229,547,626.87	78,454,607.16	1,501,895,436.85
负债							
卖出回 购金融 资产款	374,999,260.00	-	-	-	-	-	374,999,260.00
应付证 券清算 款	-	-	-	-	-	20,097.27	20,097.27
应付赎 回款	-	-	-	-	-	323.52	323.52
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	663,057.28	663,057.28
应付托 管费	-	-	-	-	-	189,444.93	189,444.93
应付销 售服务	-	-	-	-	-	1,305.05	1,305.05

费							
应付交易费用						53,084.79	53,084.79
应付利息						83,937.44	83,937.44
应交税费						24,570.00	24,570.00
其他负债						341,481.44	341,481.44
负债总计	374,999,260.00					1,377,301.72	376,376,561.72
利率敏感度缺口	-337,324,286.58	49,069,980.00	78,284,496.82	1,028,863,752.58	229,547,626.87	77,077,305.44	1,125,518,875.13

注：表统计了本基金资产及负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年02月16日）	上年度末（2015年6月30日）
	基准利率增加 25 个基点	-10,869,289.44	-11,799,461.24
	基准利率减少 25 个基点	11,004,139.83	11,965,904.14

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的

公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具。本基金可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 2 月 16 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	15,316,832.94	0.94	33,952,428.72	3.02
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,519,551,340.45	93.65	1,405,767,856.27	124.90
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,534,868,173.39	94.59	1,439,720,284.99	127.92

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关；		
	对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 2 月 16 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	49,895,720.10	3,554,300.44
沪深 300 指数下跌 5%	-49,895,720.10	-3,554,300.44	

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)

### 6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：汇添富 6 月红添利定期开放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	附注号	转型后至报告期末
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	830,689.65
结算备付金		891,252.99
存出保证金		110,820.06
交易性金融资产	6.4.7.2	1,809,989,389.84
其中：股票投资		84,271,502.45
基金投资		-
债券投资		1,725,717,887.39
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	25,006,257.50
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,836,828,410.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>转型后至报告期末</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		175,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		-
应付托管费		270,612.75
应付销售服务费		1,553.56
应付交易费用	6.4.7.7	153,525.69

应交税费		24,570.00
应付利息		41,711.54
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	249,179.47
负债合计		175,741,153.01
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,622,579,429.74
未分配利润	6.4.7.10	38,507,827.29
所有者权益合计		1,661,087,257.03
负债和所有者权益总计		1,836,828,410.04

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.024 元，基金份额总额 1,622,579,429.74 份，其中 A 类基金份额总额 1,617,915,878.89 份，份额净值 1.024 元；C 类基金份额总额 4,663,550.85 份，份额净值 1.022 元。

3、由于本基金于 2016 年 02 月 17 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2016 年 06 月 30 日的数据。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		41,038,801.30
1. 利息收入		29,006,096.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	143,961.84
债券利息收入		28,850,786.61
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		11,348.42
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,120,659.95
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-858,082.21
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	4,879,013.38
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	99,728.78

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,912,044.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		<b>2,530,974.01</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,199,468.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,889.92
4. 交易费用	6.4.7.19	422,919.63
5. 利息支出		773,534.29
其中：卖出回购金融资产支出		773,534.29
6. 其他费用	6.4.7.20	128,162.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>38,507,827.29</b>

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、由于本基金于 2016 年 02 月 17 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 17 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)	1,622,579,429.74	-	1,622,579,429.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,507,827.29	38,507,827.29
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-	-	-
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)	1,622,579,429.74	38,507,827.29	1,661,087,257.03

注：由于本基金于 2016 年 02 月 17 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金

净值) 变动表只列示本期数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富 6 月红添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[2015]2686 号文《关于准予汇添富信用债债券型证券投资基金变更注册的批复》的核准, 由汇添富信用债债券型证券投资基金于 2016 年 2 月 17 日变更注册为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金。基金合同于 2016 年 2 月 17 日正式生效。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, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于固定收益类金融工具, 并适度参与权益类品种投资, 以在承担合理风险的基础上, 力争实现资产的长期稳定增值。本基金的投资范围主要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、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券、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), 和股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为: 中债综合指数\*90%+沪深 300 指数\*10%。

### 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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会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 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间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

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

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 2 月 17 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

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

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；本基金目前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主要为股票投资和债券投资；本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

##### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

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

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的

金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

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

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同

利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 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，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### **6.4.6 税项**

#### **6.4.6.1 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[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。

#### **6.4.6.2 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。

#### **6.4.6.3 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[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。

#### **6.4.6.4 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[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[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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	830,689.65
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	
合计：	830,689.65

注：本基金本期末未投资于定期存款。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	78,401,704.25	84,271,502.45	5,869,798.20
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	853,657,253.03	869,100,887.39	15,443,634.36
	银行间市场	835,451,696.71	856,617,000.00	21,165,303.29
	合计	1,689,108,949.74	1,725,717,887.39	36,608,937.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,767,510,653.99	1,809,989,389.84	42,478,735.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	18,942.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	360.99
应收债券利息	24,986,909.22
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	44.82
合计	25,006,257.50

注：表中“其他”为应收存出保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日



交易所市场应付交易费用	150,125.99
银行间市场应付交易费用	3,399.70
合计	153,525.69

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	249,179.47
合计	249,179.47

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富 6 月红定期开放债券 A		
项目	本期 2016年2月17日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,617,915,878.89	1,617,915,878.89
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,617,915,878.89	1,617,915,878.89

汇添富 6 月红定期开放债券 C		
项目	本期 2016年2月17日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,663,550.85	4,663,550.85
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	4,663,550.85	4,663,550.85
-----	--------------	--------------

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

汇添富 6 月红定期开放债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	30,514,785.29	7,889,329.86	38,404,115.15
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,514,785.29	7,889,329.86	38,404,115.15

汇添富 6 月红定期开放债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	80,997.52	22,714.62	103,712.14
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,997.52	22,714.62	103,712.14

#### 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期
	2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	105,228.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,031.86
其他	701.85
合计	143,961.84

注：表中“其他”为保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	117,732,246.98
减：卖出股票成本总额	118,590,329.19
买卖股票差价收入	-858,082.21

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月17日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	503,114,194.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	486,591,972.89
减：应收利息总额	11,643,208.08
买卖债券差价收入	4,879,013.38

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末持有资产支持证券。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末持有贵金属投资。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	99,728.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	99,728.78

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,912,044.48
——股票投资	12,153,722.12

——债券投资	-4,241,677.64
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	7,912,044.48

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期未有其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月17日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	418,594.63
银行间市场交易费用	4,325.00
合计	422,919.63

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月17日至2016年6月30日
审计费用	29,508.30
信息披露费	81,147.15
银行划款费用	8,056.72
帐户维护费	9,450.00
合计	128,162.17

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、半年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：

本基金于 2016 年 8 月 12 日（权益登记日、除息日）每 10 份基金份额派发红利 0.19 元，共

分配收益 30,829,009.22 元，其中红利再投资方式为 71,155.40 元，现金红利为 30,757,853.82 元。

除以上情况外，本基金并无其它须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司	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

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。

#### 6.4.10 本报告期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日	
	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	153,231,041.63	52.28%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日
-------	--

	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	328,529,358.83	95.81%

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月17日至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	764,000,000.00	23.37%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月17日至2016年6月30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	139,639.71	51.73%	61,266.35	40.81%

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月17日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	
其中：支付销售机构的客户维护费	

注：本基金收取浮动年管理费率，即本基金管理费的适用费率（m）是根据封闭期内 A 类基金份额年净值增长率（ $M_A$ ）的大小来决定的。

条件	管理费率 (m)
$M_A \leq 4\%$	0.2%
$4\% < M_A \leq 6\%$	$\text{Min}[0.3\%, 0.2\% + (M_A - 4\%)]$
$6\% < M_A \leq 8\%$	$\text{Min}[0.4\%, 0.3\% + (M_A - 6\%)]$
$M_A > 8\%$	$\text{Min}[0.65\%, 0.4\% + (M_A - 8\%)]$

$M_A$ 的计算方法如下:

$$M_A = \frac{NAV_1 - NAV_0 + D}{NAV_0} \times \frac{365}{T}, \text{ 其中:}$$

$NAV_1$ 为第 N 个开放期第一日的未扣除管理费的 A 类基金份额净值;

$NAV_0$ 为第 N-1 个开放期最后一日的 A 类基金份额净值 (若 N=1, 则  $NAV_0=1.000$ );

D 为第 N 个业绩考核周期内 A 类基金份额累计已分配收益的总和;

T 为第 N 个业绩考核周期的天数。

本基金在封闭期内不计提管理费, 而是在每个开放期第一日对管理费进行一次性计提。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

本基金对非业绩考核周期的存续期不收取管理费, 即在除了开放期第一日之外的每个开放期间不收取管理费。

管理费的计算方法如下:

$$H = E \times m \div 365 \times T$$

其中 H 为在第 N 个开放期第一日应计提的基金管理费

E 为第 N 个开放期第一日的基金资产净值 (未扣除管理费)

m 为第 N 个开放期第一日适用的基金管理费率

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	1, 199, 468. 00

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 2 月 17 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 6 月红定期 开放债券 A	汇添富 6 月红定期 开放债券 C	合计
	中国农业银行股份有限公司	-	838.22
汇添富基金管理股份有限公司	-	4,392.10	4,392.10
合计	-	5,230.32	5,230.32

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 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。



**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

关联方名称	本期 2016 年 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	830,689.65	105,228.13

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 2 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日报告期间获得的利息收入为人民币 20,515.87 元，2016 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 891,252.99 元。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

**6.4.11 利润分配情况**

**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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
136501	16 天风 01	2016 年 6 月 21 日	2016 年 7 月 26 日	新债未上市	100.00	99.99	200,000	19,997,045.48	19,997,045.48	-
132006	16 皖新 EB	2016 年 6 月 27 日	2015 年 7 月 29 日	新债未上市	100.00	99.99	197,970	19,794,830.47	19,794,830.47	-
127003	海印转债	2016 年 6 月 15 日	2016 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	99.99	8,860	885,922.32	885,922.32	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300334	津膜科技	2016 年 5 月 19 日	重大资产重组停牌	18.05	-	-	400,000	7,242,128.00	7,220,000.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 175,000,000.00 元，其中 25,000,000.00 元于 2016 年 7 月 6 日到期，150,000,000.00 元于 2016 年 7 月 4 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进

行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日
A-1	
A-1 以下	-
未评级	89,847,000.00
合计	89,847,000.00

注：未评级债券为超短期融资券、国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日
AAA	276,277,401.20
AAA 以下	1,222,102,546.19
未评级	137,490,940.00
合计	1,635,870,887.39

注：未评级债券为国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持有的部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于年末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性要求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、部分应收申购款及债券投资等；生息负债主要为卖出回购金融资产款。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以 内	3 个月-1 年	6 个月-1 年 以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产									
银行存款	830,689.65	-	-	-	-	-	-	-	830,689.65
结算备付金	891,252.99	-	-	-	-	-	-	-	891,252.99
存出保证金	110,820.06	-	-	-	-	-	-	-	110,820.06
交易性金融资产	-	1,959,344.70	-	296,524,843.50	-	887,703,869.89	539,529,829.30	84,271,502.45	1,809,989,389.84
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	25,006,257.50	25,006,257.50
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,832,762.70	1,959,344.70	-	296,524,843.50	-	887,703,869.89	539,529,829.30	109,277,759.95	1,836,828,410.04
负债									
卖出回购金融资产款	175,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	175,000,000.00
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	270,612.75	270,612.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	1,553.56	1,553.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	153,525.69	153,525.69
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	41,711.54	41,711.54
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	24,570.00	24,570.00
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	249,179.47	249,179.47
负债总计	175,000,000.00	-	-	-	-	-	-	741,153.01	175,741,153.01
利率敏感度缺口	-173,167,237.30	1,959,344.70	-	296,524,843.50	-	887,703,869.89	539,529,829.30	108,536,606.94	1,661,087,257.03

##### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；

	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；	
	银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；	
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券；	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） 本期末（2016年6月30日）
	基准利率增加 25 个基点	-13,886,377.12
	基准利率减少 25 个基点	14,077,068.70

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具。本基金可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	84,271,502.45	5.07
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,725,717,887.39	103.89
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,809,989,389.84	108.96

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关；	
	对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；	
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2016年6月30日）
	沪深300指数上涨5%	
	沪深300指数下跌5%	

#### 6.4.14 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(转型前)

### 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	权益投资	15,316,832.94	0.83
	其中：股票	15,316,832.94	0.83
2	固定收益投资	1,519,551,340.45	82.44
	其中：债券	1,519,551,340.45	82.44
	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	60,000,000.00	3.26
	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	182,526,324.48	9.90
7	其他资产	65,916,999.24	3.58
8	合计	1,843,311,497.11	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,316,832.94	0.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,316,832.94	0.94

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002391	长青股份	700,000	9,688,000.00	0.60
2	600219	南山铝业	894,886	5,628,832.94	0.35

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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

本基金本报告期内无累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票。

#### 7.4.2 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	600219	南山铝业	5,620,630.00	0.50
2	002391	长青股份	2,766,633.46	0.25
3	600067	冠城大通	1,893,297.65	0.17

### 7.4.3 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	-
卖出股票收入（成交）总额	15,022,214.95

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。

### 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	5,334,267.50	0.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	112,351,000.00	6.92
	其中：政策性金融债	112,351,000.00	6.92
4	企业债券	1,274,893,913.75	78.57
5	企业短期融资券	100,125,000.00	6.17
6	可转债	26,847,159.20	1.65
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,519,551,340.45	93.65

### 7.6 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	101559014	15 吴江交投 MTN001	500,000	53,895,000.00	3.32
2	011508003	15 华能集 SCP003	500,000	50,095,000.00	3.09
3	011699109	16 厦国贸 SCP001	500,000	50,030,000.00	3.08
4	101562008	15 淮安水利 MTN001	400,000	43,392,000.00	2.67



5	1580031	15 淀山湖 债	400,000	42,508,000.00	2.62
---	---------	-------------	---------	---------------	------

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 其他资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	44,010.77
2	应收证券清算款	32,269,368.65
3	应收股利	-
4	应收利息	33,530,880.54
5	应收申购款	72,739.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,916,999.24

**7.12.2 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	110031	航信转债	150,614.40	0.01
---	--------	------	------------	------

### 7.12.3 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中未存在流通受限的情况。

## § 7 投资组合报告(转型后)

### 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	84,271,502.45	4.59
	其中：股票	84,271,502.45	4.59
2	固定收益投资	1,725,717,887.39	93.95
	其中：债券	1,725,717,887.39	93.95
	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	1,721,942.64	0.09
7	其他资产	25,117,077.56	1.37
8	合计	1,836,828,410.04	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	57,634,115.41	3.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,302,731.44	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,224,655.60	0.56
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,110,000.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	84,271,502.45	5.07

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600172	黄河旋风	1,299,948	23,958,041.64	1.44
2	000593	大通燃气	899,899	11,302,731.44	0.68
3	002405	四维图新	374,986	9,224,655.60	0.56
4	600161	天坛生物	299,959	8,335,860.61	0.50
5	300334	津膜科技	400,000	7,220,000.00	0.43
6	000967	盈峰环境	302,300	6,708,037.00	0.40
7	002488	金固股份	298,200	6,268,164.00	0.38
8	000826	启迪桑德	200,000	6,110,000.00	0.37
9	000541	佛山照明	499,904	5,144,012.16	0.31

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600172	黄河旋风	21,132,173.28	1.27
2	601688	华泰证券	13,304,711.47	0.80
3	601555	东吴证券	13,082,383.55	0.79
4	000776	广发证券	11,368,731.04	0.68
5	000593	大通燃气	9,752,270.03	0.59
6	601311	骆驼股份	9,453,408.87	0.57
7	600161	天坛生物	8,316,410.44	0.50

8	002405	四维图新	8,097,169.80	0.49
9	300334	津膜科技	7,242,128.00	0.44
10	000967	盈峰环境	6,981,012.14	0.42
11	600728	佳都科技	6,640,223.47	0.40
12	002488	金固股份	6,549,533.00	0.39
13	002142	宁波银行	6,320,311.38	0.38
14	300250	初灵信息	6,260,045.00	0.38
15	002510	天汽模	6,212,044.00	0.37
16	000826	启迪桑德	5,995,490.00	0.36
17	002179	中航光电	5,930,396.50	0.36
18	000541	佛山照明	5,218,985.72	0.31
19	600177	雅戈尔	3,716,767.00	0.22
20	002169	智光电气	3,067,131.25	0.18

注：买入金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601688	华泰证券	14,754,888.06	0.89
2	601555	东吴证券	13,872,925.26	0.84
3	000776	广发证券	12,979,230.16	0.78
4	601311	骆驼股份	9,655,839.00	0.58
5	002391	长青股份	9,606,937.00	0.58
6	002510	天汽模	7,318,619.13	0.44
7	002142	宁波银行	6,622,265.40	0.40
8	600728	佳都科技	6,289,350.69	0.38
9	002179	中航光电	6,236,317.85	0.38
10	600219	南山铝业	5,640,731.80	0.34
11	300250	初灵信息	5,510,111.73	0.33
12	600177	雅戈尔	4,303,859.22	0.26
13	002169	智光电气	3,581,620.00	0.22
14	600587	新华医疗	2,630,862.68	0.16
15	002222	福晶科技	2,221,575.00	0.13
16	603077	和邦生物	2,024,203.00	0.12
17	002158	汉钟精机	1,935,023.00	0.12
18	002690	美亚光电	1,680,341.00	0.10

19	000967	盈峰环境	867,547.00	0.05
----	--------	------	------------	------

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	175,391,276.58
卖出股票收入（成交）总额	117,732,246.98

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。

### 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	26,364,940.00	1.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	200,973,000.00	12.10
	其中：政策性金融债	200,973,000.00	12.10
4	企业债券	991,559,220.60	59.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	457,489,000.00	27.54
7	可转债	49,331,726.79	2.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,725,717,887.39	103.89

### 7.6 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	160210	16 国开 10	1,000,000	99,950,000.00	6.02
2	160209	16 国开 09	900,000	89,847,000.00	5.41
3	101559014	15 吴江交投 MTN001	500,000	53,295,000.00	3.21
4	101562008	15 淮安水利 MTN001	400,000	42,940,000.00	2.59
5	1580031	15 淀山湖债	400,000	42,412,000.00	2.55

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 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。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 其他资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	110,820.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,006,257.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,117,077.56

**7.12.2 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	110031	航信转债	127,936.40	0.01

**7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300334	津膜科技	7,220,000.00	0.43	重大资产重组停牌

**§ 8 基金份额持有人信息(转型前)**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

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
信用债 A	320	5,055,987.12	1,612,972,068.38	99.69%	4,943,810.51	0.31%
信用债 C	266	17,532.15	2,337,768.05	50.13%	2,325,782.80	49.87%
合计	586	2,768,906.88	1,615,309,836.43	99.55%	7,269,593.31	0.45%

**8.2 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	信用债 A	0	0
	信用债 C	5,347.57	0.11%
	合计	5,347.57	0.00%

**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	信用债 A	0
	信用债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信用债 A	0
	信用债 C	0
	合计	0

## § 8 基金份额持有人信息(转型后)

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
6 月红 A	320	5,055,987.12	1,612,972,068.38	99.69%	4,943,810.51	0.31%
6 月红 C	266	17,532.15	2,337,768.05	50.13%	2,325,782.80	49.87%
合计	586	2,768,906.88	1,615,309,836.43	99.55%	7,269,593.31	0.45%

### 8.2 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	6 月红 A	0	0
	6 月红 C	5,347.57	0.11%
	合计	5,347.57	0.00%

### 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	6 月红 A	0
	6 月红 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	6 月红 A	0
	6 月红 C	0
	合计	0



## § 9 开放式基金份额变动

转型后:

	汇添富 6 月红定期开放债券 A	汇添富 6 月红定期开放债券 C
报告期期初基金份额总额	1,617,915,878.89	4,663,550.85
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-" 填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,617,915,878.89	4,663,550.85

转型前:

	汇添富信用债 A	汇添富信用债 C
报告期期初基金份额总额	945,429,582.31	3,266,018.79
报告期期间基金总申购份额	430,254,636.62	2,959,423.62
减:报告期期间基金总赎回份额	3,614,759.29	2,213,998.33
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-" 填列)	245,846,419.25	652,106.77
报告期期末基金份额总额	1,617,915,878.89	4,663,550.85

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

2016 年 1 月 11 日, 汇添富信用债债券型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司以现场方式召集召开了本基金的基金份额持有人大会。

出席本次大会的汇添富信用债债券型证券投资基金基金份额持有人(或其代理人)所代表份额共计 932, 929, 508. 63 份, 占权益登记日基金总份额 948, 694, 557. 68 份的 98. 34%, 达到全部有效凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%), 满足法定开会条件。会议审议了《关于汇添富信用债债券型证券投资基金转型相关事项的议案》, 本次大会决议自该日起生效。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 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，基金托管人中国农业银行股份有限公司的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

2016 年 2 月 17 日原“汇添富信用债债券型证券投资基金”转型为“汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金”。汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的投资目标、投资范围、投资策略请详见本公司刊登在 2016 年 2 月 17 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司网站的《汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (转型后)

#### 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	2	153,231,041.63	52.28%	139,639.71	51.73%	
中信建投	2	139,892,481.93	47.72%	130,282.16	48.27%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-

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	328,529,358.83	95.81%	764,000,000.00	23.37%	-	-
中信建投	14,380,772.08	4.19%	2,505,500,000.00	76.63%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

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：

此 37 个交易单元与汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金共用。本基金本报告期无新增或退租交易单元。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

### 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	2	2,766,633.46	26.91%	2,521.26	26.49%	-

中信建投	2	7,513,927.65	73.09%	6,997.79	73.51%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-

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	7,219,689.85	28.97%	1,227,000,000.00	38.06%	-	-
中信建投	17,698,213.51	71.03%	1,997,000,000.00	61.94%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

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：

此 37 个交易单元与汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金共用。本基金本报告期无新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于原汇添富信用债券型证券投资基金转型为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/2/17
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加农业银行开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/2/18
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东证期货为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/2/24
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加开源证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/2/24
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参加恒丰银行开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/2/27
6	汇添富基金管理股份有限公司关于人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/3/16
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告（四维图新、佳都科技）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/3/19
8	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告（副总经理）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/4/2
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告（启迪桑德）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/4/12
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加格上富信为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/4/27
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中正达广开展的申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/3
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加乾道金融为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/3



13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加天津银行为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/3
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与诺亚正行开展的费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/12
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加首创证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/12
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加民生银行开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/13
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/17
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大连银行为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/5/27
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加汇成基金为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/6/4
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加惠次方为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/6/13
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/6/14
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加联泰资产开展的申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/6/17
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加富滇银行为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/6/17
24	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加陆金所资管开展的申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/6/24

### 10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2015 年年度资产净值的公告	管理人网站	2016/1/4
2	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	管理人网站	2016/1/4
3	汇添富基金管理股份有限公司关于调整指数熔断机制下的基金申购与赎回开放时间的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 上交所, 深交所	2016/1/4
4	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	管理人网站	2016/1/7
5	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/1/12
6	关于汇添富信用债债券型证券投资基金实施转型的提示公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/1/13
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与渤海银行开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/1/20
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加众禄金融开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/1/20
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/1/27
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中正达广为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016/2/1

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富信用债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富信用债债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《汇添富信用债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 5、《汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富信用债债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件；
- 9、报告期内汇添富信用债债券型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### **11.2 存放地点**

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### **11.3 查阅方式**

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司  
2016 年 8 月 27 日