

汇添富互利分级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 重要提示及目录

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
^{3.1} 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末上市基金前十名持有人	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.4 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.....	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录	48
11.2 存放地点	48
11.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富互利分级债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富互利分级债券	
基金主代码	164703	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	227,617,769.13 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2014-04-30	
下属分级基金的基金简称:	汇添富互利分级债券 A	汇添富互利分级债券 B
下属分级基金的交易代码:	164704	150142
报告期末下属分级基金的份额总额	16,811,631.64 份	210,806,137.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理，力争实现资产的长期稳健增值。	
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。	
业绩比较基准	中债综合指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，混合基金，高于货币市场基金。	
	汇添富互利分级债券 A	汇添富互利分级债券 B
下属分级基金的风险收益特征	互利 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	互利 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

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
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李文	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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

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)
本期已实现收益	23,147,254.42
本期利润	9,091,173.57
加权平均基金份额本期利润	0.0394
本期加权平均净值利润率	2.74%
本期基金份额净值增长率	2.69%
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	123,067,455.30
期末可供分配基金份额利润	0.5407
期末基金资产净值	332,885,365.12
期末基金份额净值	1.462
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	47.99%

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

4、本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 11 月 6 日，至本报告期末未满三年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2016 年 06 月 30 日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

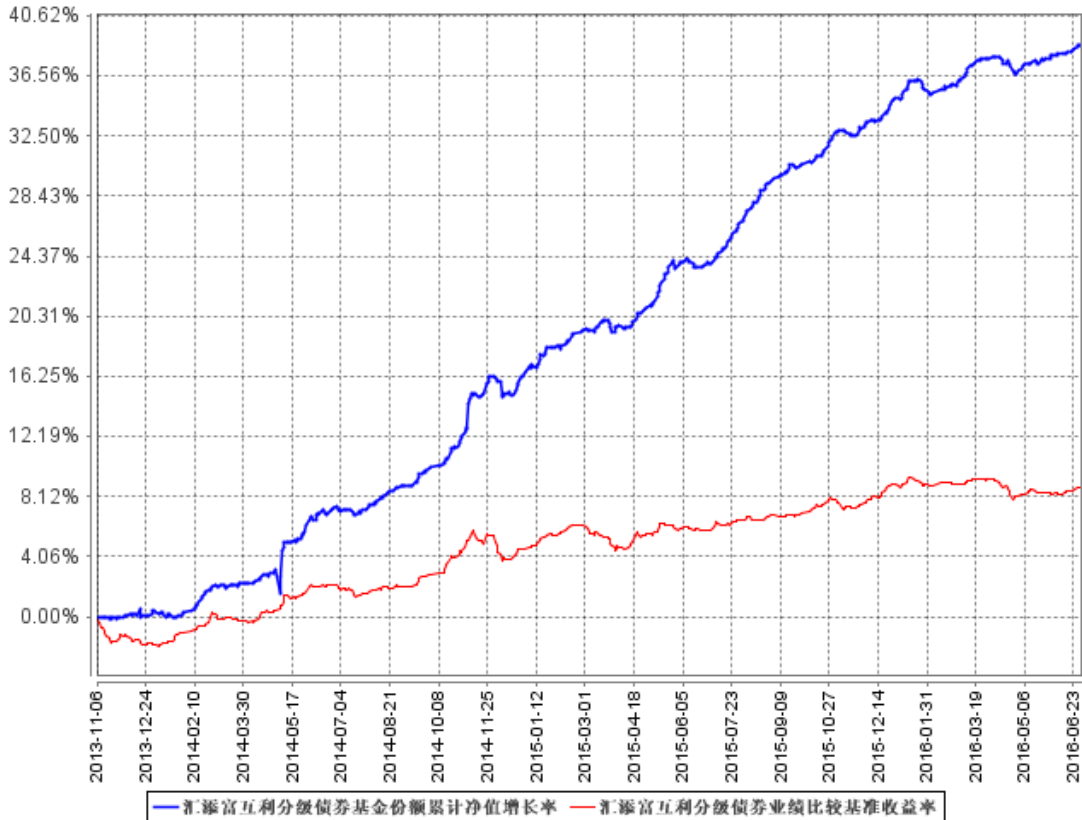
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.69%	0.05%	0.36%	0.04%	0.33%	0.01%
过去三个月	0.70%	0.08%	-0.52%	0.07%	1.22%	0.01%
过去六个月	2.69%	0.09%	-0.21%	0.07%	2.90%	0.02%
过去一年	11.85%	0.09%	2.74%	0.07%	9.11%	0.02%
自基金合同生效日起至今	38.65%	0.13%	8.72%	0.10%	29.93%	0.03%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 11 月 06 日，至本报告期末未满 3 年。

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

汇添富互利分级债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 11 月 06 日，至本报告期末未满 3 年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 06 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。

§ 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		

陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富互利分级债券基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理，固定收益投资总监。	2013 年 11 月 6 日	-	14 年	<p>国籍：中国。学历：华东师范大学金融学博士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任总经理助理、固定收益投资总监。2008 年 3 月 6 日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理，2009 年 1 月 21 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富货币基金的基金经理，2011 年 1 月 26 日至 2013 年 2 月 7 日任汇添富保本混合基金的基金经理，2012 年 7 月 26 日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富互利分级债券基金的基金经理，2013 年 12 月 13 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富全额宝货币基金的基金经理，2014 年 1 月 21 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理，2014 年 12 月 23 日至今任汇添富收益快钱货币基金的基金经理。</p>
李怀定	汇添富季季红定期开放债券基金和汇添富互利分级债券基金、汇添富达欣混合基金、汇	2015 年 11 月 18 日	-	8 年	<p>国籍：中国。学历：复旦大学经济学博士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：曾任光大证券股份有限公司研究所债券分析师，国信证券股份有限公司经济研究所固定收益高级分析师。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益高级分析师。2015 年 5 月 25 日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理助</p>

	添富盈鑫保本混合基金、汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理，汇添富增强收益债券基金的基金经理助理。			理，2015 年 11 月 18 日至今任汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富互利分级债券基金的基金经理，2015 年 12 月 2 日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理，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，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。
--	---	--	--	--

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

2016 年上半年信贷投放和基建投资发力并没有推动经济回升，各项主要经济指标持续低位运行，GDP 同比增长降至 6.7%，再创 1991 年以来最低水平，其中工业增加值、投资、进口等指标均保持弱势，显示内需增长回升依旧乏力。外部环境方面，尽管美国经济在一季度表现良好外，特别是就业数据，但二季度美国经济增长显著低于预期，特别是私人部门投资和库存数据大幅低于预期，结合美国非金融企业盈利数据，美国经济数据接下来面临的不确定性显著加大，相对而言，其他发达经济体均继续陷入持续低迷的增长格局。内需方面，2016 年上半年国内基本面总体保持低位徘徊，工业增加值、投资、进口等指标保持弱势，特别是民间投资，2016 年 6 月更是一度负增长，显示内需乏力并未因一季度天量信贷投放而有所好转。2016 年上半年通胀持续低位，尽管大宗商品价格在一季度前期迅速反弹，叠加一季度天量信贷投放、一二线城市房价暴涨，市场此前一度对年内通胀担忧有所提高，但二季度开始这种担忧明显减弱，尤其是核心 CPI 二季度持续低位徘徊甚至下行。尽管二季度前期出现短暂边际收紧迹象，但为应对经济、通胀低迷，2016 年上半年货币政策总体保持相对宽松局面，政策稳中趋松的基调依然较为明确，货币市场资金价格总体保持平稳。

2016 年上半年债券市场出现较大震荡，一季度收益率持续下行，但在二季度开始，伴随信用风险增加、金融机构“营改增”、数只平台债宣布提前还款、资金紧张和机构赎回等多重负面因素的叠加影响，债券收益率一度迅速大幅上升，但在 5 月开始，随着权威人士对经济增长的表态，叠加 6 月国内经济金融指标低于预期、美国非农低于预期以及英国“脱欧”影响，债券收益率又开始迅速下行。2016 年上半年整体看，债券收益率走势出现明显分化，高评级信用债和利率债收益率小幅上行 5-10bp，低评级信用债收益率 10-20BP。

考虑到组合将于 11 月初到期，尽管上半年债券市场出现较大震荡，但本组合配置上总体相对稳健，操作思路整体是减持低流动性债券配置比例，并适度增加高流动性债券的仓位；相对去年四季度末，本组合久期、杠杆明显缩短和降低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年本基金的收益率为 2.69%，同期业绩比较基准率为-0.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，伴随着美国私人部门投资和库存数据的疲软以及英国“脱欧”后期进展和影响的不确定性，全球波动性有望加大，全球宽松局面预计相对比较确定。从国内来看，目前民间投资下滑带来的经济下行压力仍非常大，上市公司 1 季度数据显示企业盈利能力并未因天量信贷投放而出现任何好转迹象，显示当前的需求政策很难扭转经济下行趋势；另外，考虑上半年全社会杠杆急剧上升，叠加一、二线城市房价水平飙升，政府通过居民加杠杆来转嫁政府与企业债务压力的路径难度加大，这将继续不利经济结构的调整。我们判断下半年货币政策整体还将保持中性偏宽松格局间，货币市场资金利率仍应保持低位，债券市场依然不存在明显的系统性风险，收益率整体震荡下行的可能性较大，但期间收益率估值过低存在短期回调的可能在上升，另外也需要关注信用分化带来的估值不利影响。在本基金的操作上，我们将继续坚持价值投资的理念，重视绝对收益目标，积极调整组合结构，控制组合下行风险，力争为投资者创造持续稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日（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。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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互利分级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

本报告期内汇添富互利分级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互利分级债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富互利分级债券型证券投资基金未进行利润分配。

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互利分级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：汇添富互利分级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	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	6.4.7.1	18,972,385.22	524,334.67
结算备付金		753,375.30	9,776,149.03
存出保证金		34,392.74	33,431.29
交易性金融资产	6.4.7.2	376,834,047.72	564,072,780.63
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		371,545,225.80	558,783,958.71
资产支持证券投资		5,288,821.92	5,288,821.92
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		1,495,198.91	10,000,000.00
应收利息	6.4.7.5	5,427,986.08	6,604,575.34
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		403,517,385.97	591,011,270.96
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		69,897,622.10	252,999,755.00
应付证券清算款		-	8,810,403.08
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		190,246.79	193,485.32
应付托管费		54,356.23	55,281.52
应付销售服务费		135,890.55	138,203.79
应付交易费用	6.4.7.7	4,707.00	2,722.90
应交税费		-	-
应付利息		20,456.94	64,719.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	328,741.24	400,000.00
负债合计		70,632,020.85	262,664,571.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	225,894,171.96	229,979,938.48

未分配利润	6.4.7.10	106,991,193.16	98,366,761.33
所有者权益合计		332,885,365.12	328,346,699.81
负债和所有者权益总计		403,517,385.97	591,011,270.96

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 6 月 30 日，基金份额净值 1.462 元，基金份额总额 227,617,769.13 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.005 元，份额总额 16,811,631.64 份；下属 B 类基金份额净值 1.499 元，份额总额 210,806,137.49 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富互利分级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	附注号	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		13,043,941.90	31,062,246.77
1.利息收入		9,037,188.00	16,532,810.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	90,130.53	114,863.43
债券利息收入		8,826,349.01	16,033,135.84
资产支持证券利息收入		115,046.58	384,810.97
买入返售金融资产收入		5,661.88	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,062,834.75	15,794,466.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	18,062,834.75	15,794,466.85
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,056,080.85	-1,265,030.32
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	-	-
减：二、费用		3,952,768.33	7,067,657.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,154,422.00	1,351,932.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	329,834.83	386,266.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	824,587.15	965,666.38
4. 交易费用	6.4.7.19	5,592.85	2,865.81

5. 利息支出		1,384,946.26	4,113,069.40
其中：卖出回购金融资产支出		1,384,946.26	4,113,069.40
6. 其他费用	6.4.7.20	253,385.24	247,856.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,091,173.57	23,994,588.84

报表附注为财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富互利分级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）	229,979,938.48	98,366,761.33	328,346,699.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,091,173.57	9,091,173.57
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）	-4,085,766.52	-466,741.74	-4,552,508.26
其中：1. 基金申购款	1,694,255.03	193,544.97	1,887,800.00
2. 基金赎回款	-5,780,021.55	-660,286.71	-6,440,308.26
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）	225,894,171.96	106,991,193.16	332,885,365.12
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）	346,099,522.75	65,108,311.09	411,207,833.84

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,994,588.84	23,994,588.84
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）	-114,170,023.47	-	-114,170,023.47
其中：1. 基金申购款	1,247,447.01	-	1,247,447.01
2. 基金赎回款	-115,417,470.48	-	-115,417,470.48
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）	231,929,499.28	89,102,899.93	321,032,399.21

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

汇添富互利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]641号文《关于核准汇添富互利分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2013年10月21日至2013年11月1日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第60466941_B50号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年11月6日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币684,424,432.64元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币216,533.18元，以上实收基金(本息)合计人民币684,640,965.82元，折合684,640,965.82份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为固定收益类品种，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、资产支持证

券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款），以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。在严格控制风险的基础上，本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理，力争实现资产的长期稳健增值。本基金业绩比较基准：中债综合指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本报告期所采用的其他会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

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	18,972,385.22
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	18,972,385.22

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	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	127,932,663.63	131,173,225.80	3,240,562.17

	银行间市场	239,832,070.58	240,372,000.00	539,929.42
	合计	367,764,734.21	371,545,225.80	3,780,491.59
资产支持证券		5,288,821.92	5,288,821.92	0.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	373,053,556.13	376,834,047.72	3,780,491.59

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	4,819.62
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	305.10
应收债券利息	5,272,206.31
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	150,655.05
合计	5,427,986.08

注：“其他”为结算保证金利息和应收资产支持证券利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

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	-
银行间市场应付交易费用	4,707.00
合计	4,707.00

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	-
预提审计费	39,781.56
预提信息披露费	259,124.42
预提上市费	29,835.26
合计	328,741.24

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富互利分级债券 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	21,050,116.06	19,173,800.99
本期申购	1,887,800.00	1,694,255.03
本期赎回(以“-”号填列)	-6,440,308.26	-5,780,021.55
2016年5月5日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	314,023.84	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	16,811,631.64	15,088,034.47

金额单位：人民币元

汇添富互利分级债券 B		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	210,806,137.49	210,806,137.49
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	210,806,137.49	210,806,137.49

注：（1）申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）根据《汇添富互利分级债券型证券投资基金基金合同》以及《汇添富互利分级债券型证券投资基金招募说明书》的规定，2016 年第一次基金份额折算基准日 2016 年 5 月 5 日当日 A 类基金的基金份额净值为人民币 1.01491803 元，据此计算的 A 类基金的折算比例为 1.01491803，折算后，A 类基金的基金份额净值调整为人民币 1.000 元，基金份额持有人原来持有的每 1 份 A 类基金相应增加至 1.01491803 份。折算前，A 类基金的基金份额总额为 21,050,116.06 份，折算后，A 类基金的基金份额总额为 21,364,139.90 份。因上述份额折算调整导致的实收基金账面金额增加，计人民币 314,023.84 元。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,708,991.19	16,657,770.14	98,366,761.33
本期利润	23,147,254.42	-14,056,080.85	9,091,173.57
本期基金份额交易产生的变动数	-411,862.86	-54,878.88	-466,741.74
其中：基金申购款	170,788.21	22,756.76	193,544.97
基金赎回款	-582,651.07	-77,635.64	-660,286.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	104,444,382.75	2,546,810.41	106,991,193.16

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 6 月 30 日
活期存款利息收入	31,240.32
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	58,599.21
其他	291.00
合计	90,130.53

注：表中“其他”为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

注：本基金本报告期末未投资股票。

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6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	510,067,729.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	481,022,470.79
减：应收利息总额	10,982,424.19
买卖债券差价收入	18,062,834.75

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未有股利收益。

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6月30日
1. 交易性金融资产	-14,056,080.85
——股票投资	-
——债券投资	-14,056,080.85
——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	-14,056,080.85

6.4.7.18 其他收入

注：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1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,367.85
银行间市场交易费用	4,225.00
合计	5,592.85

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6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	159,124.42
上海清算所帐户维护费	9,800.00
上市费用	29,835.26
银行间划款费用	5,844.00
帐户维护费	9,000.00
合计	253,385.24

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

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
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
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

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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 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 6 月 30 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
东方证券股份有限公司	419,205,267.86	100.00%	177,200,560.18	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 6 月 30 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	占当期回购债券 成交总额的比例	回购成交金额	占当期回购债券 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	6,204,300,000.00	100.00%	13,469,400,000.00	100.00%

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

注：本基金本报告期未有应支付关联方的佣金。

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	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管理费	1,154,422.00	1,351,932.91
其中：支付销售机构的客户维护费	30,082.63	181,616.23

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，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 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	329,834.83	386,266.56

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托

管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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		
	汇添富互利分级债券A	汇添富互利分级债券B	合计
中国工商银行股份有限公司	26,575.54	570.43	27,145.97
汇添富基金管理股份有限公司	24.54	589,592.18	589,616.72
东方证券股份有限公司	-	9.75	9.75
合计	26,600.08	590,172.36	616,772.44
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		
	汇添富互利分级债券A	汇添富互利分级债券B	合计
中国工商银行股份有限公司	140,992.53	491.37	141,483.90
汇添富基金管理股份有限公司	402.24	538,441.87	538,844.11
东方证券股份有限公司	-	458.28	458.28
合计	141,394.77	539,391.52	680,786.29

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为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前2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

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及上年度可比期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均未投资本基金。

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	18,972,385.22	31,240.32	429,040.94	17,348.68

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年上半年度获得的利息收入为人民币 58,599.21 元(2015年上半年度获得的利息收入为人民币 97,514.73 元)，2016年半年末结算备付金余额为人民币 753,375.3 元(2015年半年末：人民币 11,171,299.10 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：本基金本期末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：本基金在本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
127003	海印转债	2016年6月8日	2016年7月1日	新债未上市	100.00	99.99	1,990	198,982.55	198,982.55	-
132006	16皖	2016年7	2016年	新债未	100.00	99.99	13,500	1,349,852.05	1,349,852.05	-

	新 EB	月 27 日	7 月 29 日	上市						
--	------	--------	----------	----	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 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

6.4.12.3 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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011606002	16 电网 SCP002	2016 年 7 月 1 日	99.00	102,000	10,097,883.86
011699732	16 中电投 SCP004	2016 年 7 月 1 日	99.00	100,000	9,899,886.14
071602003	16 国泰君安 CP003	2016 年 7 月 6 日	93.00	200,000	18,599,852.10
合计				402,000	38,597,622.10

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，基金从事上海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人民币 31,300,000.00 元，均于 2016 年 7 月 1 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。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	60,120,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	130,119,000.00	-
合计	190,239,000.00	-

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 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	41,066,324.80	-
AAA 以下	110,254,901.00	-
未评级	29,985,000.00	-
合计	181,306,225.80	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

本基金所持大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 中列示的本基金于期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需求，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、部分应收申购款、买入返售金融资产及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年6 月 30 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	18,972,385.22	-	-	-	-	-	18,972,385.22
结算备付金	753,375.30	-	-	-	-	-	753,375.30
存出保证金	34,392.74	-	-	-	-	-	34,392.74
交易性金融资产	20,022,000.00	40,020,000.00	160,145,967.75	64,317,318.45	87,039,939.60	5,288,821.92	376,834,047.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,495,198.91	1,495,198.91
应收利息	-	-	-	-	-	5,427,986.08	5,427,986.08
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	39,782,153.26	40,020,000.00	160,145,967.75	64,317,318.45	87,039,939.60	12,212,006.91	403,517,385.97
负债							
卖出回购金融资产款	69,897,622.10	-	-	-	-	-	69,897,622.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	190,246.79	190,246.79
应付托管费	-	-	-	-	-	54,356.23	54,356.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	135,890.55	135,890.55
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,707.00	4,707.00
应付利息	-	-	-	-	-	20,456.94	20,456.94
其他负债	-	-	-	-	-	328,741.24	328,741.24
负债总计	69,897,622.10	-	-	-	-	734,398.75	70,632,020.85
利率敏感度缺口	-30,115,468.84	40,020,000.00	160,145,967.75	64,317,318.45	87,039,939.60	11,477,608.16	332,885,365.12
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	524,334.67	-	-	-	-	-	524,334.67

结算备付金	9,776,149.03						9,776,149.03
存出保证金	33,431.29						33,431.29
交易性金融资产	21,427,000.00		30,623,392.26	414,647,176.21	197,375,212.16		-564,072,780.63
应收证券清算款						-10,000,000.00	10,000,000.00
应收利息						-6,604,575.34	6,604,575.34
资产总计	31,760,914.99		30,623,392.26	414,647,176.21	197,375,212.16	16,604,575.34	591,011,270.96
负债							
卖出回购金融资产款	252,999,755.00						-252,999,755.00
应付证券清算款						-8,810,403.08	8,810,403.08
应付管理人报酬						193,485.32	193,485.32
应付托管费						55,281.52	55,281.52
应付销售服务费						138,203.79	138,203.79
应付交易费用						2,722.90	2,722.90
应付利息						64,719.54	64,719.54

其他 负债	-	-	-	-	-	400,000.00	400,000.00
负债 总计	252,999,755.00	-	-	-	-	9,664,816.15	262,664,571.15
利率 敏感 度缺 口	-221,238,840.01	-	30,623,392.26	414,647,176.21	97,375,212.16	6,939,759.19	328,346,699.81

注：上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、结算备付金和存出保证金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；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。		
	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6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	基准利率增加 25 个基点	-1,666,926.89	-5,085,959.55
	基准利率减少 25 个基点	1,692,914.66	5,161,690.26

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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		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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	376,834,047.72	113.20	558,783,958.71	170.18
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	376,834,047.72	113.20	558,783,958.71	170.18

注：基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，持有的现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

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，即与所投资证券的贝塔系数密切相关；		
	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）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	4,113,794.92	-
沪深 300 指数下跌 5%	-4,113,794.92	-	

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

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	376,834,047.72	93.39
	其中：债券	371,545,225.80	92.08
	资产支持证券	5,288,821.92	1.31
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	19,725,760.52	4.89
7	其他各项资产	6,957,577.73	1.72
8	合计	403,517,385.97	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,985,000.00	9.01
	其中：政策性金融债	29,985,000.00	9.01

4	企业债券	115,468,466.40	34.69
5	企业短期融资券	190,239,000.00	57.15
6	中期票据	20,148,000.00	6.05
7	可转债（可交换债）	15,704,759.40	4.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	371,545,225.80	111.61

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	300,000	29,985,000.00	9.01
2	124979	14 陕城投	200,000	21,010,000.00	6.31
3	101652021	16 中油股 MTN001	200,000	20,148,000.00	6.05
4	041556044	15 中燃投资 CP001	200,000	20,100,000.00	6.04
5	011699154	16 中节能 SCP001	200,000	20,052,000.00	6.02

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	119110	14 新盛 02	50,000	5,288,821.92	1.59

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：本基金本报告期末未持有股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期期末未持有股指期货投资。

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

本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

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：本基金本报告期期末无国债期货持仓。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.12.3 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	34,392.74
2	应收证券清算款	1,495,198.91
3	应收股利	-
4	应收利息	5,427,986.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,957,577.73

7.12.4 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	5,514,500.00	1.66

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§ 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
汇添富互利分级债券 A	349	48,170.86	-	0.00%	16,811,631.64	100.00%
汇添富互利分级债券 B	264	798,508.10	199,393,609.00	94.59%	11,412,528.49	5.41%
合计	613	371,317.73	199,393,609.00	87.60%	28,224,160.13	12.40%

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富互利分级债券 B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国船舶工业集团公司企业年金计划-中信银行股份有限公司	9,165,977.00	18.25%
2	中国商用飞机有限责任公司企业年金计划-中信银行股份有限公司	4,882,700.00	9.72%
3	成都农村商业银行股份有限公司企业年金计划-中国民生银行股份有限公司	3,397,592.00	6.76%
4	四川成渝高速公路股份有限公司企业年金计划-招商银行	3,301,030.00	6.57%
5	中国国际贸易中心有限	2,992,670.00	5.96%

	公司企业年金计划-中国建设银行		
6	哈尔滨铁路局企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	2,380,800.00	4.74%
7	海南核电有限公司企业年金计划-中国银行股份有限公司	2,226,681.00	4.43%
8	山西潞安矿业(集团)有限责任公司企业年金计划-中国工商银行	2,210,400.00	4.40%
9	钱兰英	2,200,000.00	4.38%
10	湖南中烟工业有限责任公司企业年金计划-中信银行股份有限公司	1,522,200.00	3.03%

8.3 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。

8.4 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	汇添富互利分级债券 A	0
	汇添富互利分级债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富互利分级债券 A	0
	汇添富互利分级债券 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富互利分级债券 A	汇添富互利分级债券 B
基金合同生效日（2013 年 11 月 6 日）	473,834,828.33	210,806,137.49

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	21,050,116.06	210,806,137.49
本报告期基金总申购份额	1,887,800.00	-
减:本报告期基金总赎回份额	6,440,308.26	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	314,023.84	-
本报告期末基金份额总额	16,811,631.64	210,806,137.49

注:本基金基金合同生效之日起3年内,互利A将自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,互利B封闭运作并上市交易。互利A的每次开放日,基金管理人将对互利A进行基金份额折算,互利A的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的互利A份额数按折算比例相应增减。

§ 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	419,205,267.86	100.00%	6,204,300,000.00	100.00%	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易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 3 个交易单元与汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富添富通货币市场基金、添富增强收益债券型证券投资基金、添富收益快线货币市场基金共用。本报告期内未新增 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 其他重大事件

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 年 1 月 4 日
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 年 1 月 4 日
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 年 1 月 4 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于指数熔断期间旗下场内基金申购赎回业务安排的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016 年 1 月 6 日
5	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 年 1 月 7 日
6	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 年 1 月 20 日
7	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 年 1 月 27 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 2 月 20 日

	分基金增加新兰德为销售机构的公告		
9	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 年 2 月 24 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宜信普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 年 2 月 27 日
11	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 年 3 月 16 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 3 月 23 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行个人电子银行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 年 3 月 28 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加好买基金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 年 3 月 31 日
15	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 年 4 月 2 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中信证券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 年 5 月 3 日
17	汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016 年 5 月 3 日
18	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深	2016 年 5 月 5 日

	之互利债 B 基金份额暂停交易的公告	交所	
19	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额折算和申购与赎回结果的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 5 月 9 日
20	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 年 5 月 12 日
21	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 年 5 月 12 日
22	汇添富互利分级债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要 (2016 年第 1 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 6 月 17 日

§ 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互利分级债券证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富互利分级债券证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富互利分级债券证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内汇添富互利分级债券证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
- 6、中国证监会要求的其他文件。

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 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