汇添富和聚宝货币市场基金2016年年度报告

2016年12月31日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2017年3月29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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
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 16
§6 审计报告 16
§7 年度财务报表 17
7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
7.4 报表附注 21
§8 投资组合报告 42
8.1 期末基金资产组合情况 42
8.2 债券回购融资情况 42
8.3 基金投资组合平均剩余期限 42
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 43
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 44
8.7 投资组合报告附注 44
§9 基金份额持有人信息 45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 45
§10 开放式基金份额变动 45
§11 重大事件揭示 46
11.1 基金份额持有人大会决议 46
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 46
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
11.4 基金投资策略的改变 48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 49
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 50
11.9 其他重大事件 50
§12 备查文件目录 50
12.1 备查文件目录 50
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富和聚宝货币市场基金
基金简称	汇添富和聚宝货币
基金主代码	000600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 28 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,266,152,958.28 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	朱萍
	联系电话	021-28932888	021-61618888
	电子邮箱	service@99fund.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95528
传真		021-28932998	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		李文	吉晓辉

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
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
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

§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	2016 年	2015 年	2014 年 5 月 28 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	59,447,282.38	81,327,984.61	21,569,429.70
本期利润	59,447,282.38	81,327,984.61	21,569,429.70
本期净值收益率	3.0934%	4.3367%	2.7524%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	2,266,152,958.28	1,873,247,297.07	1,515,987,779.80
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
累计净值收益率	10.5249%	7.2085%	2.7524%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金收益分配为按日结转份额。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 5 月 28 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 12 月 31 日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

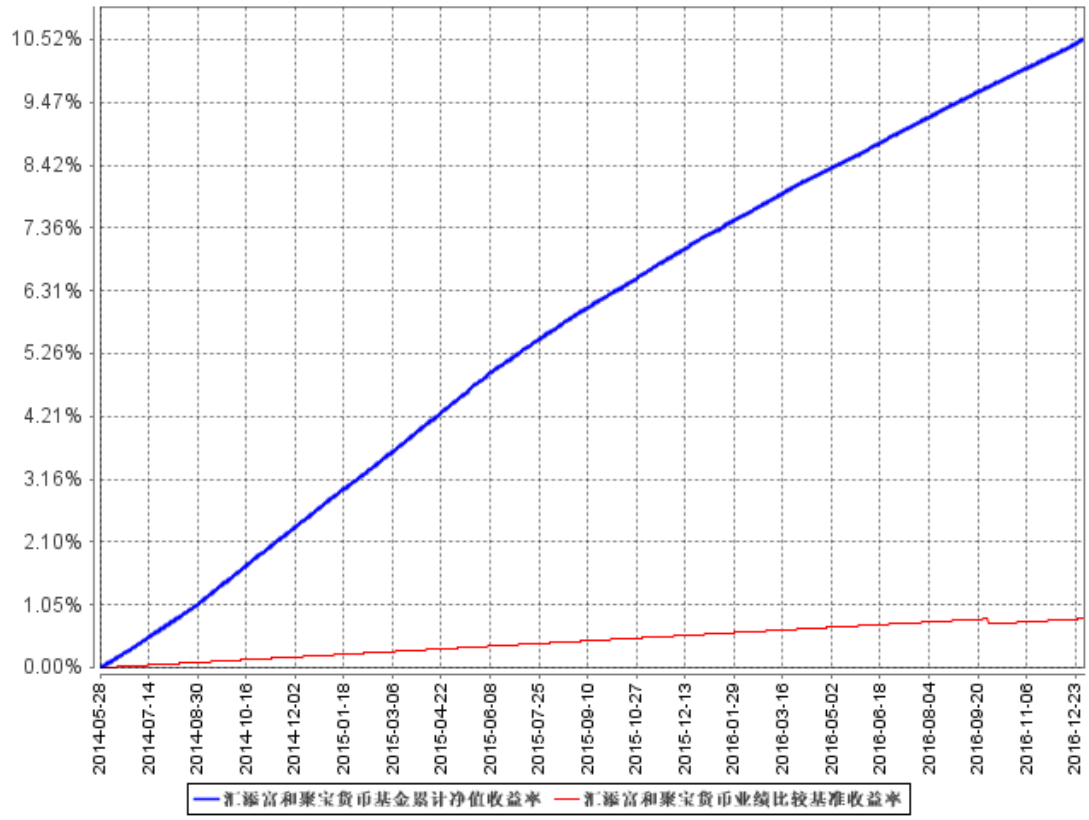
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.7315%	0.0007%	0.0880%	0.0000%	0.6435%	0.0007%
过去六个月	1.4883%	0.0012%	0.1760%	0.0000%	1.3123%	0.0012%
过去一年	3.0934%	0.0017%	0.3500%	0.0000%	2.7434%	0.0017%
自基金合同生效日起至今	10.5249%	0.0029%	0.9102%	0.0000%	9.6147%	0.0029%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 5 月 28 日，至本报告期末未满三年。

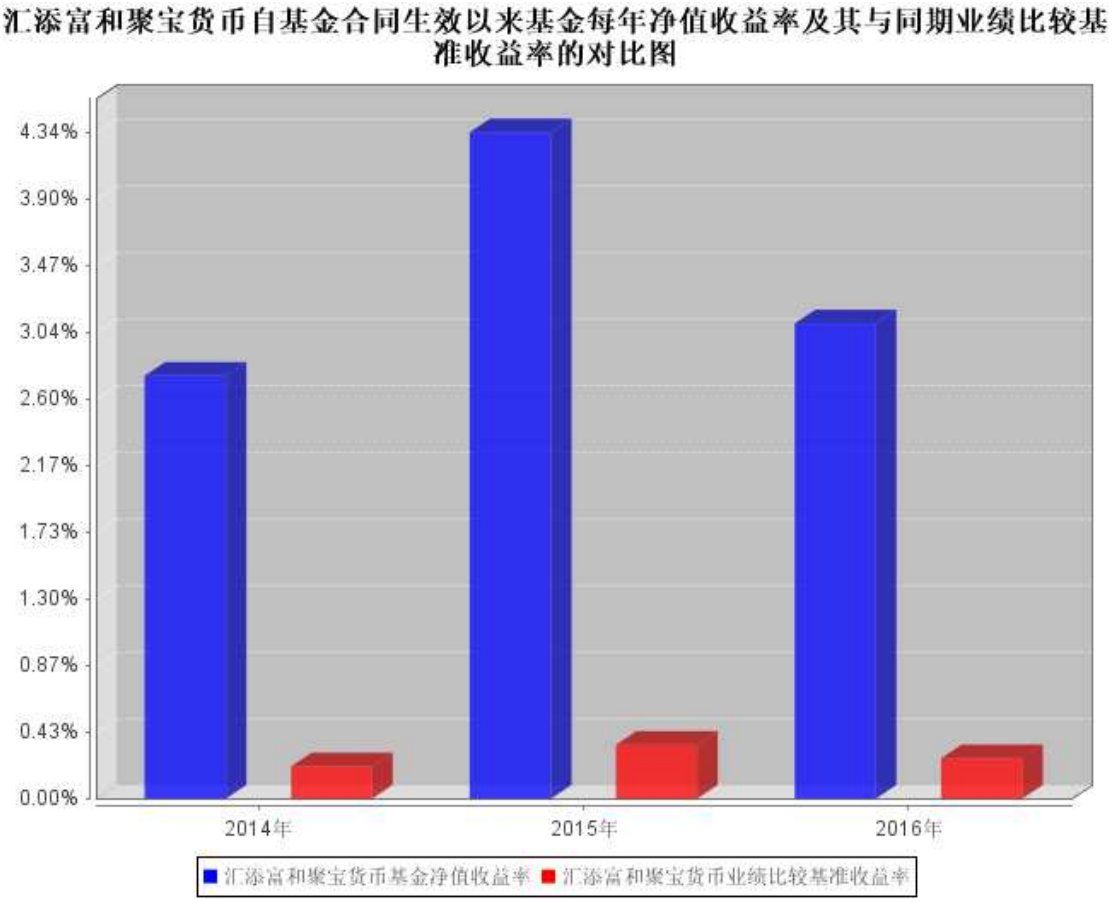
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富和聚宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014 年 5 月 28 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 5 月 28 日，至本报告期末未满三年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	59,447,282.38	-	-	59,447,282.38	
2015	81,327,984.61	-	-	81,327,984.61	
2014	21,569,429.70	-	-	21,569,429.70	
合计	162,344,696.69	-	-	162,344,696.69	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII 业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人，基本养老保险基金委托投资管理人。截至目前，汇添富已经构建起公募、专户、社保基金、养老金、国际业务等投融资业务以及互联网金融业务协同发展的统一的资产管理服务平台。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券，把握市场脉络，做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念，并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2016 年，汇添富保持了优秀的的投资业绩：截至 2016 年年底，汇添富基金旗下权益主动管理型基金过去 5 年平均收益率 139%，在大型基金公司中持续排名第一（数据来源：银河证券基金研究中心）。优秀的投资业绩获得了行业高度认可。2016 年，公司先后获得“年度十大明星基金公司”、“五年持续回报明星基金公司”、“金基金•TOP 公司”等多项荣誉；汇添富民营活力、汇添富价值精选、汇添富全额宝获得“金牛基金”大奖。

2016 年，汇添富基金新发 16 只基金，包括 2 只股票型基金，5 只指数基金，3 只债券型基金，4 只保本基金，以及 2 只混合型基金。其中，上海国企 ETF 首募规模达 152 亿元，位居今年所有权益类产品发行规模首位。全年，公司公募基金产品达到 75 只，涵盖权益、固定收益、混合、灵活配置、指数、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品，为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2016 年，汇添富基金在规范电子商务运作的基础上，陆续完成安全中心体系、快捷支付渠道及新版手机 APP 建设，加强优化客户体验，提升客户服务能力。公司电子商务平台保有规模排名行业前列。

2016 年，汇添富基金稳步推行大机构战略，截至年底，公司机构理财总部保有规模达 2250 亿元。12 月，公司成功竞获基本养老保险基金管理人资格，未来将为做好做大养老金投资业务而努力。

2016 年，公司积极开展渠道销售和培训工作。优秀的投资业绩、专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑带来了汇添富品牌在渠道影响力的显著提升。在传统大中型银行和券商渠道的基础上，公司进一步拓展了中小型银行及券商渠道，助力新基金发行。2016 年，公司所有新发基金规模在同期同类新基金中排名均位居前列。公司大力开展“汇定投•汇添富”系列定投推广活动，营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部，全力打造汇添富定投品牌。

2016 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建了囊括投顾式服务、理财基金、高端客户、现金宝的全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。

2016 年，香港子公司的国际业务取得较大进展。香港子公司顺利成为韩国退休教师基金 KTCU 选聘的 A 股投资管理人，并获得台湾第一金证券投资信托股份有限公司委任，成为其两只公募基金的投资顾问。

2016 年，公司持续加强公益事业建设，践行企业社会责任，公益活动影响力得到进一步提升。1 月，公司开展第二期“添富之爱”员工与贫困地区学生一对一结对帮扶认领活动，160 名乡村学子与汇添富员工完成结对。3 月，南京山地马拉松通过报名筹款为“河流•孩子”项目筹得善款近 7 万元。5 月，公司员工参加“一个鸡蛋的暴走”筹得善款 12 万元。6 月，公司首次开展海外学子支教活动，组织优秀中国留学生赴宁夏泾源县兰大庄添富小学，开展为期 1 周的公益支教活动。志愿者们充分借鉴海外教学的授课方式，帮助乡村小学生打开视野。8 月，南方多省遭遇严重洪涝灾害，公司员工自发地发起赈灾捐款，成功募集 20 余万元善款，全部用于为受灾地区学校捐赠图书、教学和生活用品。10 月，上海国际马拉松赛的“全马完赛公益捐赠活动”累计筹集 17 万善款。

2017 年是实施“十三五”规划的重要一年，资本市场改革进一步深化，财富管理行业在混业竞争、互联网金融、两地基金互认的多重推动下将面临更大的挑战与机遇。汇添富基金将始终坚信长期的力量，拥抱变革、奋勇拼搏、砥砺前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富全额	2014 年 11 月 26 日	-	8 年	国籍：中国。学历：复旦大学法学学士。曾任长江养老保险股份有限公司

	宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快线货币基金、汇添富理财 7 天债券基金的基金经理。				债券交易员。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014 年 8 月 27 日至今任汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理；2014 年 11 月 26 日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理；2014 年 12 月 23 日至今任汇添富收益快钱货币基金基金经理；2016 年 6 月 7 日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日、5 日）同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值是否小于 1%、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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 10 次，均是因为投资策略原因，并经过公司内部风控审核。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，世界经济总体增速较 2015 年有所放缓，其中发达经济体增长格局出现分化，美国经济复苏相对较快，而日本和欧洲依然疲弱。分化的经济增长走势使得全球主要央行的货币政策差距不断扩大，美联储在 12 月份完成一次加息，并发表对来年 3 次加息预期的鹰派言论，而日本和欧洲的央行延续负利率和零利率水平，差异化的各国央行政策使得跨国资本的流动频率增加。英国公投退欧以及特朗普当选美国总统等意外事件则让全球金融和汇率市场的波动不断加大。

面对国际政治和经济形势的日益多样化和复杂化，2016 年国内经济整体趋稳，稳中有进。调结构、去库存、降杠杆成为 2016 年经济工作的重点。GDP 增速虽略有下滑，但仍处于较高水平。经济发展中的积极因素增多：供给侧改革效果继续显现，工业企业去产能、去杠杆，房地产去库存均取得一定的成效。供给侧改革也推动 PPI 同比大幅回升，并带动工业企业利润指标出现局部改善，官方制造业 PMI 指数重新回到荣枯线以上并持续回暖。总体而言，目前经济 L 行走势底部缓慢企稳的势头仍在延续。

2016 年，驱动债券市场走势的因素发生转变，具体表现为央行宽松预期的转变以及经济底部企稳、通胀回升取代此前央行宽松以及经济持续探底的预期，成为主导利率走势的首要因素。上半年利空利多交织，市场在震荡中前行。3 月 MPA 考核使得资金成本大幅上涨，4 月信用事件频发，对市场信心造成强烈冲击。此后权威人士讲话提振市场，通胀数据走低，固定资产投资大幅下滑等经济基本面因素回落，叠加金融机构的资产配置压力，6 月到 10 月市场迎来一波小牛市。随后在央行“缩短放长”去杠杆，人民币贬值压力的大背景下，四季度后半段债券市场收益率走出一波大幅上行的走势，国债期货更是历史上首次出现跌停行情。货币市场的流动性始终承压，年末的一些债市负面事件也对流动性的传导造成一定程度的影响。央行的及时维稳则体现了其保持货币政策稳健中性的态度。

操作上，本基金采取相对灵活的投资策略，通过对优质短融的波段操作获取债券收益率下行带来的资本利得，在保证组合整体流动性的前提下锁定高收益存款提升组合静态收益。在面对下半年资金面脉冲式紧张的大背景下，积极降低债券和同业存单占比，同时，根据资金面变化情况配置足量的短期资产以在月末、年末等关键时点提供流动性支持。另外，组合主动把握回购利率和定期存款利率阶段性走高的机会，通过积极的杠杆操作提升收益，在严控组合风险的同时为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本期净值收益率为 3.0934%，同期业绩比较基准收益率 0.3500%。

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 2017 年，通胀、央行货币政策、金融监管态度以及全球主要经济体复苏和加息预期是制约未来债市走强的几个主要因素。2016 年 12 月中旬召开的中央经济工作会议未明确指出 GDP 增速区间，显示中央决策层更加重视改革成效而非 GDP 增速的硬性指标，更加追求经济增长的长期改善而非短期增长。中央经济工作会议中提到的抑制资产泡沫，防控金融经济风险，维稳人民币汇率等要求将贯穿在 2017 全年的财政政策与货币政策制定与落实过程中。

与其他主要经济体央行不同，中国央行的政策目标更为广泛。除促进经济增长、通胀和就业以外，还要考虑到推进利率市场化改革以及保持金融系统的总体稳定。去年以来，央行谨慎使用传统的降准降息等货币政策，转而使用公开市场操作、MLF 等手段维持市场流动性总体平稳。央行货币政策仍将在未来长时间内保持稳健中性，通过公开市场操作或新型货币市场工具来调节市场整体流动性，以实现多个调控目标之间的动态平衡。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，做好债券、同业存单与定期存款之间的大类资产配置以及比例的动态调整。同时，在经济企稳态势尚不明朗的情况下，规避高风险行业，仔细甄别个券，配置中高等级信用债，严防信用风险。组合将延续积极的投资策略，保持投资收益吸引力，为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

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

（三）强化培训教育，提高全员合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，当日所得收益结转为基金份额参与下一日收益分配。

本基金期初应付收益 0.00 元，2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日期间累计分配收益 59,447,282.38 元，其中人民币 59,447,282.38 元以红利再投资方式结转入实收基金，期末应付收益为 0。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富和聚宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富和聚宝货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富和聚宝货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的汇添富和聚宝货币市场基金财务报表，包括

	2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富和聚宝货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈露　　陈军
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国　北京
审计报告日期	2017 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富和聚宝货币市场基金

报告截止日：　2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资　产：			
银行存款	7.4.7.1	1,527,704,326.79	864,973,519.30

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	527,509,397.46	966,484,846.76
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		527,509,397.46	936,489,074.19
资产支持证券投资		-	29,995,772.57
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	300,204,130.30	162,316,354.31
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	16,091,076.15	20,654,597.47
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,371,508,930.70	2,014,429,317.84
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		103,999,644.00	139,999,610.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		497,608.20	415,856.80
应付托管费		73,719.71	61,608.42
应付销售服务费		460,748.34	385,052.59
应付交易费用	7.4.7.7	38,248.15	42,599.57
应交税费		-	-
应付利息		16,704.02	7,993.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	269,300.00	269,300.00
负债合计		105,355,972.42	141,182,020.77
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,266,152,958.28	1,873,247,297.07
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,266,152,958.28	1,873,247,297.07
负债和所有者权益总计		2,371,508,930.70	2,014,429,317.84

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 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 2,266,152,958.28 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富和聚宝货币市场基金

本报告期： 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		75,700,654.07	91,491,635.71
1.利息收入		76,360,709.48	88,630,355.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	41,950,729.22	55,031,907.05
债券利息收入		31,286,829.90	30,774,717.34
资产支持证券利息收入		66,631.20	386,696.18
买入返售金融资产收入		3,056,519.16	2,437,035.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-660,205.41	2,861,279.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-660,205.41	2,861,279.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	150.00	-
减：二、费用		16,253,371.69	10,163,651.10
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	5,267,474.44	5,192,172.12
2．托管费	7.4.10.2.2	780,366.53	769,210.71
3．销售服务费	7.4.10.2.3	4,877,291.13	1,382,513.72
4．交易费用		-	-
5．利息支出		4,929,832.30	2,443,582.29
其中：卖出回购金融资产支出		4,929,832.30	2,443,582.29
6．其他费用	7.4.7.18	398,407.29	376,172.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		59,447,282.38	81,327,984.61

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富和聚宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,873,247,297.07	-	1,873,247,297.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,447,282.38	59,447,282.38
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）	392,905,661.21	-	392,905,661.21
其中：1.基金申购款	17,785,735,652.24	-	17,785,735,652.24
2.基金赎回款	-17,392,829,991.03	-	-17,392,829,991.03
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）	-	-59,447,282.38	-59,447,282.38
五、期末所有者权益（基金净值）	2,266,152,958.28	-	2,266,152,958.28
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,515,987,779.80	-	1,515,987,779.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,327,984.61	81,327,984.61
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）	357,259,517.27	-	357,259,517.27
其中：1.基金申购款	10,063,464,869.43	-	10,063,464,869.43
2.基金赎回款	-9,706,205,352.16	-	-9,706,205,352.16
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）	-	-81,327,984.61	-81,327,984.61
五、期末所有者权益（基金净值）	1,873,247,297.07	-	1,873,247,297.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	韩从慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富和聚宝货币市场基金(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[2014]293 号文《关于核准汇添富和聚宝货币市场基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2014 年 5 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 510,539,019.63 份基金份额。本基金为契约型开放式货币市场基金，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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金主要投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会及/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金的投资目标为在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制,同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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 12 月 31 日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1)债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 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。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。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

1)银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

2)债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

3)回购协议

(1)基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2)基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

4)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值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，按最能反映公允价值的价格估值；

(2)为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。 当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

(3)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 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。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。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。

7.4.4.8 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实际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帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，自 2016 年 2 月 1 日起，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3)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；

(4)债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5)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。

7.4.4.9 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 0.27%年费率计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.04%年费率计提；

(3)基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提；

(4)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；

(5)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。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金每份基金份额享有同等分配权；

(2)本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3)“每日分配、每日支付”，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，当日所得收益结转为基金份额参与下一日收益分配；若当日已实现收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日已实现收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；若当日已实现收益小于零时，不缩减投资人基金份额，基金管理人有权通过销售机构或自行向基金份额持有人追索，基金份额持有人应予支付，待其后累计已实现收益大于零时，即增加投资人基金份额；投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4)当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(5)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	704,326.79	4,973,519.30
定期存款	1,527,000,000.00	860,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	592,000,000.00	120,000,000.00
存款期限 3 个月到 1 年	695,000,000.00	660,000,000.00
存款期限小于 1 个月	240,000,000.00	80,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	1,527,704,326.79	864,973,519.30

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	527,509,397.46	527,381,000.00	-128,397.46	-0.0057%
	合计	527,509,397.46	527,381,000.00	-128,397.46	-0.0057%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	936,489,074.19	941,014,000.00	4,524,925.81	0.2416%
	合计	936,489,074.19	941,014,000.00	4,524,925.81	0.2416%

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	300,204,130.30	-
合计	300,204,130.30	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	162,316,354.31	112,316,159.31
合计	162,316,354.31	112,316,159.31

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	372.29	3,836.94
应收定期存款利息	11,504,174.44	7,666,124.06
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	4,049,025.35	12,644,548.57
应收买入返售证券利息	537,504.07	254,710.85
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	85,377.05
合计	16,091,076.15	20,654,597.47

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	38,248.15	42,599.57
合计	38,248.15	42,599.57

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	210,000.00	210,000.00
合计	269,300.00	269,300.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,873,247,297.07	1,873,247,297.07
本期申购	17,785,735,652.24	17,785,735,652.24
本期赎回(以"-"号填列)	-17,392,829,991.03	-17,392,829,991.03
- 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	2,266,152,958.28	2,266,152,958.28

注：申购含红利再投份额。

7.4.7.10 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	-	-	-
本期利润	59,447,282.38	-	59,447,282.38

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	-59,447,282.38	-	-59,447,282.38
本期末	-	-	-

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	40,498.32	45,871.39
定期存款利息收入	41,910,230.90	54,986,035.66
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	41,950,729.22	55,031,907.05

7.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,445,400,815.73	3,024,318,823.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,428,047,551.86	2,983,154,237.89
减：应收利息总额	18,013,469.28	38,303,306.14
买卖债券差价收入	-660,205.41	2,861,279.72

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未持有资产支持证券投资。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未持有贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期及上年度可比期间均未有衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期及上年可比期间均未持有股票投资。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	150.00	-
合计	150.00	-

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	210,000.00	210,000.00
银行间划款费用	100,807.29	79,022.26
帐户维护费	37,600.00	36,750.00
其他费用	-	400.00
合计	398,407.29	376,172.26

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.1 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露

的资产负债表日后事项。

7.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司 （“浦发银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
上海上报资产管理有限公司（注）	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
东航金控有限责任公司	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：经汇添富基金管理股份有限公司 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，汇添富基金管理股份有限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。汇添富基金管理股份有限公司已于 2016 年 8 月 13 日就上述股东变更事项进行公告。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,267,474.44	5,192,172.12
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.27%÷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 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、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	780,366.53	769,210.71

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.04%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.04%÷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付指令，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、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费
汇添富基金管理股份有限公司	4,877,291.13
合计	4,877,291.13
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
汇添富基金管理股份有限公司	1,382,513.72
合计	1,382,513.72

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金的年销售服务费率为 0.25%，销售服务费的计算公式具体如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，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，支付日期顺延至

最近可支付日支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（ 2014 年 5 月 28 日 ）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	0.00	-
期间申购/买入总份额	410,662,135.27	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	-
期末持有的基金份额	410,662,135.27	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	18.12%	-

注：1.期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2.基金管理人于 2016 年度合计申购 410,000,000.00 份，申购费为 0，符合招募说明书规定的申购费率；期间管理人因红利再投获得本基金 662,135.27 份。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	704,326.79	258,998.32	4,973,519.30	2,855,115.79

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 年度无结算备付金利息收入(2015 年度：无)，2016 年末无结算备付金余额（2015 年末：无）。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
59,447,282.38	-	-	59,447,282.38	-

7.4.12 期末（ 2016 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购金融资产款余额 103,999,644.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160401	16 农发 01	2017 年 1 月 3 日	100.00	340,000	33,998,834.66
120233	12 国开 33	2017 年 1 月 3 日	100.10	500,000	50,047,671.69
110236	11 国开 36	2017 年 1 月 3 日	98.40	200,000	19,680,203.63
合计				1,040,000	103,726,709.98

–

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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；本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。

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

1)国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别。

2)根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

i)国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

ii)国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。(例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级)。

3)同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

4)本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	59,849,699.87	479,219,251.48
A-1 以下	-	-
未评级	397,931,822.27	457,269,822.71
合计	457,781,522.14	936,489,074.19

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债、超短期融资券和同业存单。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	69,727,875.32	-
合计	69,727,875.32	-

7.4.13.3 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为剩余期限较短、信誉良好的国家政策性金融债、及短期融资券等，

均在银行间同业市场交易；因此，本报告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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	240,704,326.79	592,000,000.00	695,000,000.00	-	-	-	1,527,704,326.79
交易性金融资产	69,996,414.60	139,649,685.58	298,183,093.65	19,680,203.63	-	-	527,509,397.46
买入返售金融资产	200,234,260.35	99,969,869.95	-	-	-	-	300,204,130.30
应收利息	-	-	-	-	-	16,091,076.15	16,091,076.15
其他资产	-	-	-	-	-	-	0.00
资产总计	510,935,001.74	831,619,555.53	993,183,093.65	19,680,203.63	-	16,091,076.15	2,371,508,930.70
负债							
卖出回	103,999,644.00	-	-	-	-	-	103,999,644.00

购金融资产款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	497,608.20	497,608.20
应付托管费	-	-	-	-	-	73,719.71	73,719.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	460,748.34	460,748.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,248.15	38,248.15
应付利息	-	-	-	-	-	16,704.02	16,704.02
其他负债	-	-	-	-	-	269,300.00	269,300.00
负债总计	103,999,644.00	-	-	-	-	1,356,328.42	105,355,972.42
利率敏感度缺口	406,935,357.74	831,619,555.53	993,183,093.65	19,680,203.63	-	14,734,747.73	2,266,152,958.28
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	204,973,519.30	340,000,000.00	320,000,000.00	-	-	-	864,973,519.30
交易性金融资产	60,011,699.05	319,124,161.27	587,348,986.44	-	-	-	966,484,846.76
买入返售金融资产	162,316,354.31	-	-	-	-	-	162,316,354.31
应收利息	-	-	-	-	-	20,654,597.47	20,654,597.47
其他资产	-	-	-	-	-	-	0.00
资产总计	427,301,572.66	659,124,161.27	907,348,986.44	0.00	-	20,654,597.47	2,014,429,317.84
负债							
卖出回购金融	139,999,610.00	-	-	-	-	-	139,999,610.00

资产款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	415,856.80	415,856.80
应付托管费	-	-	-	-	-	61,608.42	61,608.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	385,052.59	385,052.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	42,599.57	42,599.57
应付利息	-	-	-	-	-	7,993.39	7,993.39
其他负债	-	-	-	-	-	269,300.00	269,300.00
负债总计	139,999,610.00	-	-	-	-	1,182,410.77	141,182,020.77
利率敏感度缺口	287,301,962.66	659,124,161.27	907,348,986.44	0.00	-	19,472,186.70	1,873,247,297.07

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 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；		
	2. 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；		
	3. 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；		
	4. 银行存款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；买入返售金融资产利息收益与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。		
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 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2015 年 12 月 31 日 ）
	基准利率增加 25 个基点	-506,296.28	-917,835.42
	基准利率减少 25 个基点	507,771.32	920,224.06

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 527,509,397.46 元，无划分为第一层次及第三层次余额（于 2015 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 966,484,846.76 元，无划分为第一层次及第三层次余额）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	527,509,397.46	22.24
	其中：债券	527,509,397.46	22.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	300,204,130.30	12.66
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,527,704,326.79	64.42
4	其他各项资产	16,091,076.15	0.68
5	合计	2,371,508,930.70	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	10.88	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	103,999,644.00	4.59
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	83

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）

1	30 天以内	24.75	4.59
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	20.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.87	-
4	90 天(含)—120 天	17.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	23.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		103.94	4.59

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	139,728,239.44	6.17
	其中：政策性金融债	139,728,239.44	6.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	259,380,881.31	11.45
6	中期票据	-	-
7	同业存单	128,400,276.71	5.67
8	其他	-	-
9	合计	527,509,397.46	23.28
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	19,680,203.63	0.87

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	120233	12 国开 33	500,000	50,047,671.69	2.21
2	160401	16 农发 01	500,000	49,998,286.26	2.21
3	111699015	16 江苏紫金	400,000	39,495,810.21	1.74

		农村商业银行 CD061			
4	011699920	16 中粮 SCP005	300,000	30,021,682.70	1.32
5	011698463	16 华电江苏 SCP002	300,000	29,995,058.39	1.32
6	011698674	16 首钢 SCP004	300,000	29,951,458.95	1.32
7	041662045	16 鲁宏桥 CP003	300,000	29,945,745.94	1.32
8	041663004	16 首钢 CP002	300,000	29,903,953.93	1.32
9	111680108	16 厦门农商行 CD075	300,000	29,876,871.43	1.32
10	011698732	16 中粮 SCP008	300,000	29,864,186.91	1.32

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	37
报告期内偏离度的最高值	0.3129%
报告期内偏离度的最低值	-0.0862%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1632%

8.7 投资组合报告附注

8.7.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

8.7.2

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

8.7.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	16,091,076.15
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,091,076.15

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
151,445	14,963.54	1,005,372,479.68	44.36%	1,260,780,478.60	55.64%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,207.65	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 5 月 28 日）基金份额总额	510,539,019.63
本报告期期初基金份额总额	1,873,247,297.07
本报告期基金总申购份额	17,785,735,652.24

减:本报告期基金总赎回份额	17,392,829,991.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,266,152,958.28

注：总申购份额含红利再投份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 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、基金管理人于 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，曾刚先生和李怀定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，汤丛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，汤丛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，汤丛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，汤丛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，汤丛珊女士不再担任该基金的基金经理。

16、基金管理人 2016 年 7 月 14 日公告，赖中立不再担任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理，由倪健先生单独管理该基金。

17、《汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 27 日正式生效，顾耀强先生和赵鹏程先生任该基金的基金经理。

18、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金合同》于 2016 年 7 月 28 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

19、基金管理人于 2016 年 8 月 2 日公告，增聘佘中强先生担任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生、赵鹏程先生共同管理该基金。

20、《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 3 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

21、基金管理人于 2016 年 8 月 9 日公告，增聘楚天舒女士担任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

22、基金管理人于 2016 年 8 月 25 日公告，增聘佘中强先生担任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理，同时，韩贤旺先生、顾耀强先生和叶从飞先生不再担任该基金的基金经理。

23、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2016 年 9 月 18 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

24、《汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

25、基金管理人于 2016 年 11 月 2 日公告，刘闯先生不再担任汇添富医药保健混合型证券投资基金的基金经理，由周睿先生单独管理该基金。

26、《汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 6 日正式生效，曾刚先生和李怀定先生任该基金的基金经理。

27、《汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 21 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

28、《汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

29、《汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

30、《汇添富鑫瑞债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 26 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。

31、《汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

32、《汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

33、自 2016 年 1 月起，本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期没有涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)自本基金合同生效日（2014 年 5 月 28 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的当期审计费用为人民币伍万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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，本基金管理人高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、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。目前本基金管理人已完成相关整改工作。

本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易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、报告期内未发生租用证券公司交易单元的变更情况：此 2 个交易单元与汇添富货币市场基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金共用。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本年度未有偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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	公司网站,	2016 年 1 月 4 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于公司注册资本及股权变更的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016 年 1 月 4 日
3	汇添富旗下公募基金 2015 年第 4 季度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016 年 1 月 21 日
4	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016 年 3 月 16 日
5	汇添富旗下公募基金 2015 年年度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016 年 3 月 29 日
6	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）	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016 年 4 月 2 日
7	公募基金 2016 年第 1 季度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016 年 4 月 20 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年上半年度资产净值的公告	公司网站,	2016 年 7 月 1 日
9	汇添富旗下公募基金 2016 年半年度报告及摘要	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016 年 8 月 27 日
10	汇添富旗下公募基金 2016 年第 3 季度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016 年 10 月 25 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于公司注册资本及股权变更的公告	上证报, 中证报, 证券时报, 公司网站,	2016 年 12 月 24 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富和聚宝货币市场基金募集的文件；

2、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》;

3、《汇添富和聚宝货币市场基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富和聚宝货币市场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。

12.2 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

12.3 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
2017 年 3 月 29 日