

汇添富添富通货币市场基金 2015 年年度 报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 3 月 29 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

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。

汇添富添富货币市场基金由汇添富新收益债券型证券投资基金转型而来。2015 年 1 月 9 日汇添富新收益债券型证券投资基金以现场方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于汇添富新收益债券型证券投资基金转型的议案》，内容包括汇添富新收益债券型证券投资基金调整基金投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、估值方法以及修订基金合同等，并同意将汇添富新收益债券型证券投资基金更名为“汇添富添富货币市场基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2015 年 1 月 16 日起，《汇添富添富货币市场基金基金合同》生效，《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中，原汇添富新收益债券型证券投资基金报告期自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日止，汇添富添富货币市场基金报告期自 2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型前：	
基金简称	汇添富新收益债券
基金主代码	000366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月10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	15,081,956.52份
基金合同存续期	不定期

注：上表中“报告期末”指2015年1月15日（基金合同失效前日）。

转型后：			
基金简称	汇添富添富货币		
基金主代码	000366		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年1月16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	5,736,224,277.45份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富添富货币 A	汇添富添富货币 B	汇添富添富货币 E
下属分级基金的场内简称	-	-	现金添富
下属分级基金的交易代码	000366	000980	511980
报告期末下属分级基金的份额总额	378,071,242.70份	5,239,385,349.14份	118,767,685.61份

注：1、上表中“报告期末”指2015年12月31日；

2、汇添富添富货币市场基金E类合同生效日为2015年10月16日；

3、汇添富添富货币市场基金E类份额上市交易；

4、本基金A类、B类份额面值为人民币1元，E类份额面值为人民币100元。

2.2 基金产品说明

转型前：	
投资目标	本基金主要投资于债券资产，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上适度参与权益类品种投资，力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；股票资产的投资比例合计不超过基金资产的20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过

	基金资产净值的 3%，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%。本基金通过参与一级市场新股申购、股票增发，以及因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票，不超过基金资产的 20%；本基金通过二级市场直接买入股票或权证，所占比例不超过基金资产的 5%。
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，属于证券投资基金中较低预期风险，较低预期收益品种，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。

转型后：	
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	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	洪渊
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

§3 主要财务指标、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（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 1 月 15 日)	2014 年
本期已实现收益	32,218.34	6,854,113.05
本期利润	2,428.34	6,908,768.32
加权平均基金份额本期利润	0.0001	0.0678
本期基金份额净值增长率	0.02%	8.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 1 月 15 日)	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0882	0.0880
期末基金资产净值	16,411,447.28	24,115,157.24
期末基金份额净值	1.088	1.088

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

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

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

4、汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富通货币市场基金。

3.2 基金净值表现（转型前）

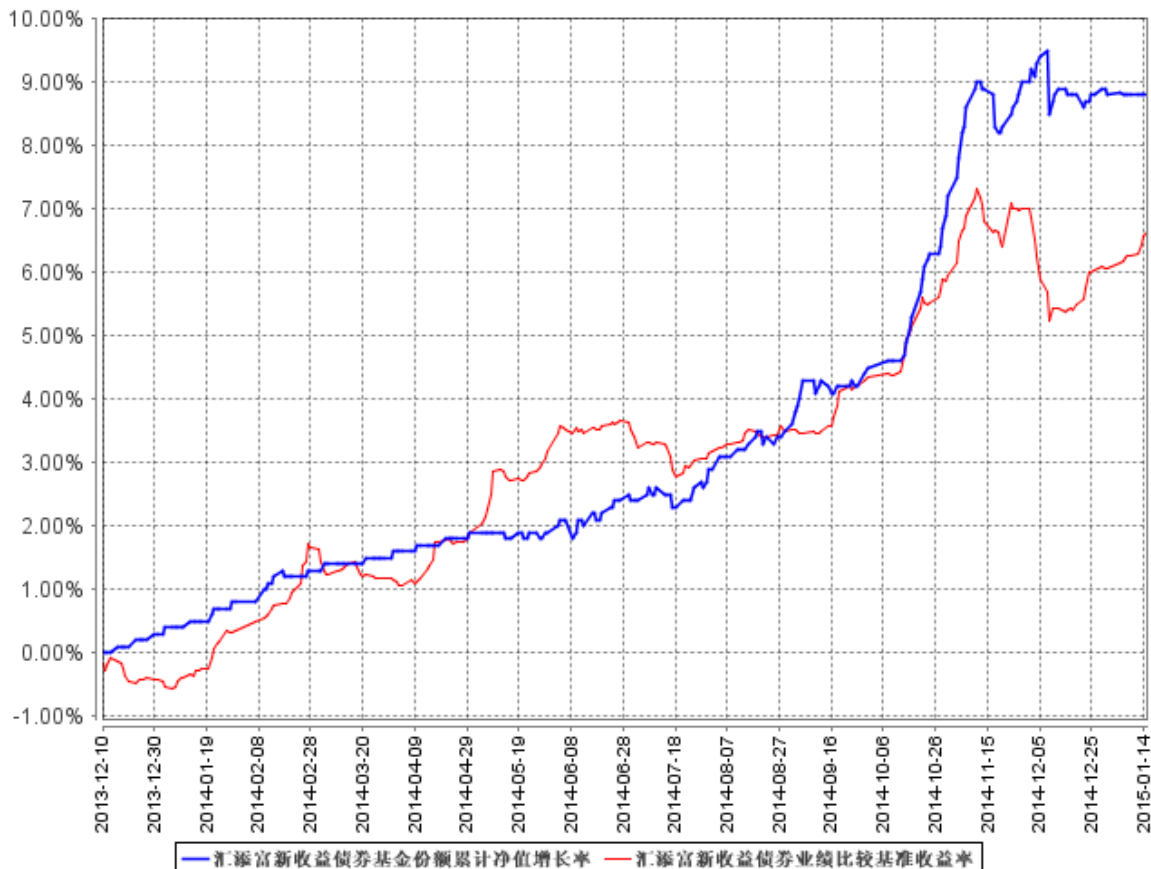
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 2015-01-01 至 2015-01-15	0.02%	0.02%	0.53%	0.05%	-0.51%	-0.03%
2014	8.47%	0.12%	6.54%	0.11%	1.93%	0.01%
自基金合同生效日起至今	8.82%	0.11%	6.64%	0.11%	2.18%	0.00%

注：汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富通货币市场基金，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

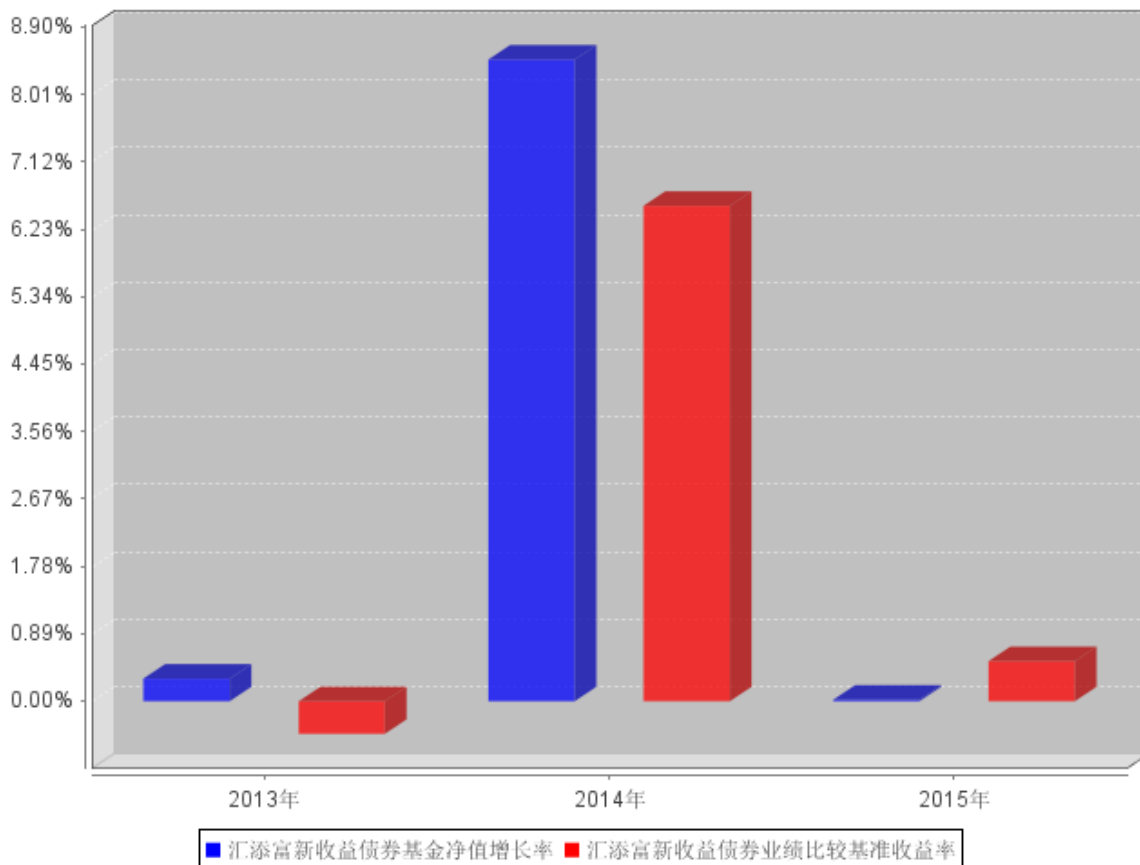
汇添富新收益债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年12月10日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定；本基金从2015年1月16日起正式转型为汇添富添富通货币市场基金。

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

汇添富新收益债券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对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年12月10日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定；本基金从2015年1月16日起正式转型为汇添富添富货币市场基金。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

注：本基金成立于2013年12月10日，截至2015年1月15日本基金未进行利润分配。

3.4 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

基金级别	汇添富添富货币 A	汇添富添富货币 B	汇添富添富货币 E
3.4.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 16 日- 2015 年 12 月 31 日)	报告期(2015 年 1 月 16 日 - 2015 年 12 月 31 日)	报告期(2015 年 10 月 16 日 - 2015 年 12 月 31 日)
本期已实现收益	7,202,501.51	30,302,324.31	46,146,991.03
本期利润	7,202,501.51	30,302,324.31	46,146,991.03
本期净值收益率	2.7535%	2.9624%	0.4999%
3.4.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 12 月 31 日)		
期末基金资产净值	378,071,242.70	5,239,385,349.14	11,876,768,560.58
期末基金份额净值	1.00	1.00	100.00

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3、汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富货币市场基金。

4、自 2015 年 10 月 16 日起，汇添富添富货币市场基金增设 E 类份额类别，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.5 基金净值表现（转型后）

3.5.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富添富货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6671%	0.0013%	0.0882%	0.0000%	0.5789%	0.0013%
过去六个月	1.2080%	0.0013%	0.1764%	0.0000%	1.0316%	0.0013%
自基金合同生效日起至今	2.7535%	0.0022%	0.3356%	0.0000%	2.4179%	0.0022%

汇添富添富货币 B

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

过去三个月	0.7281%	0.0013%	0.0882%	0.0000%	0.6399%	0.0013%
过去六个月	1.3307%	0.0013%	0.1764%	0.0000%	1.1543%	0.0013%
自基金合同 生效日起至 今	2.9624%	0.0024%	0.3356%	0.0000%	2.6268%	0.0024%

汇添富添富货币 E

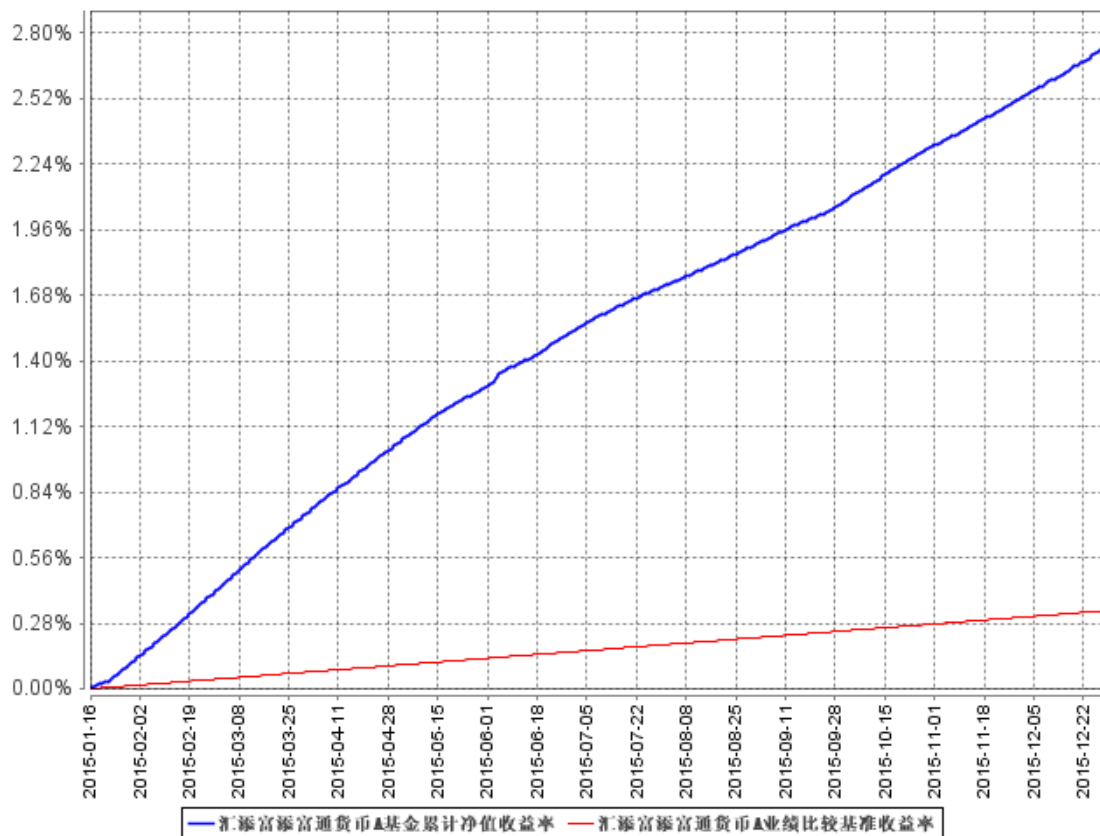
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自基金合同 生效日起至 今	0.4999%	0.0013%	0.0681%	0.0000%	0.4318%	0.0013%

注：1、汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富货币市场基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

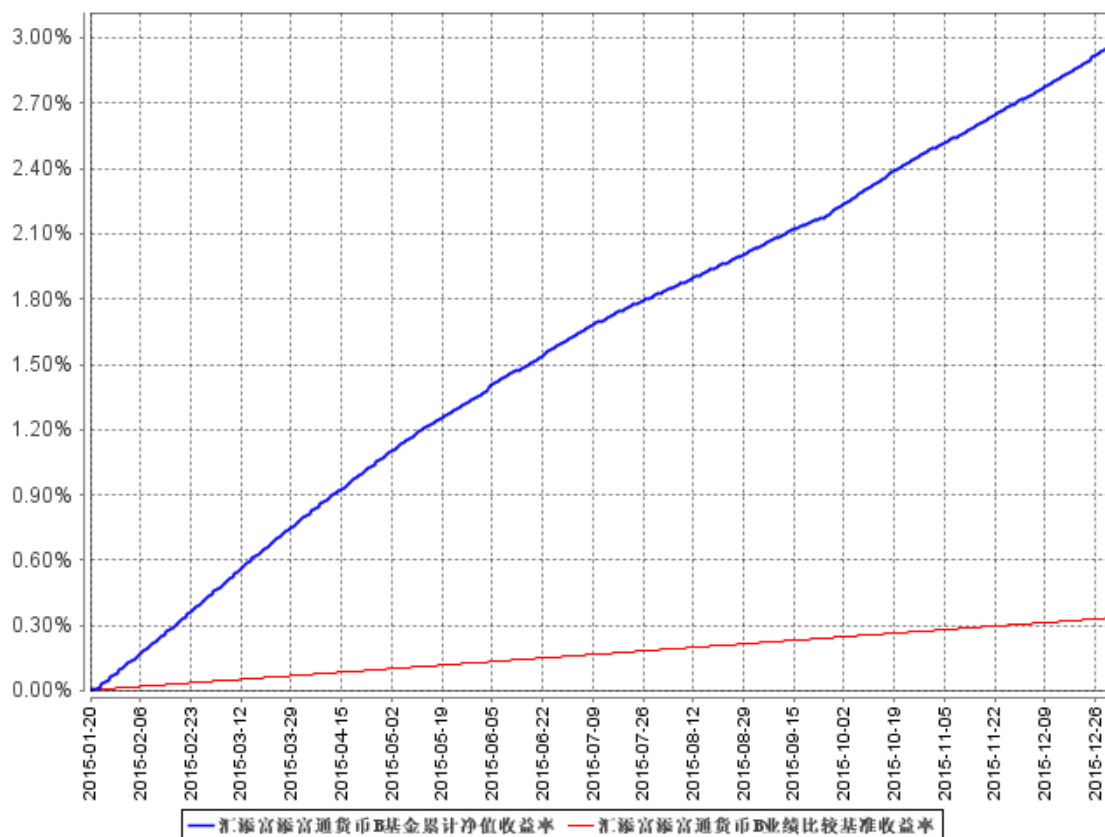
2、汇添富添富货币市场基金 E 类合同生效日为 2015 年 10 月 16 日。

3.5.2 自基金转型以来基金份额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

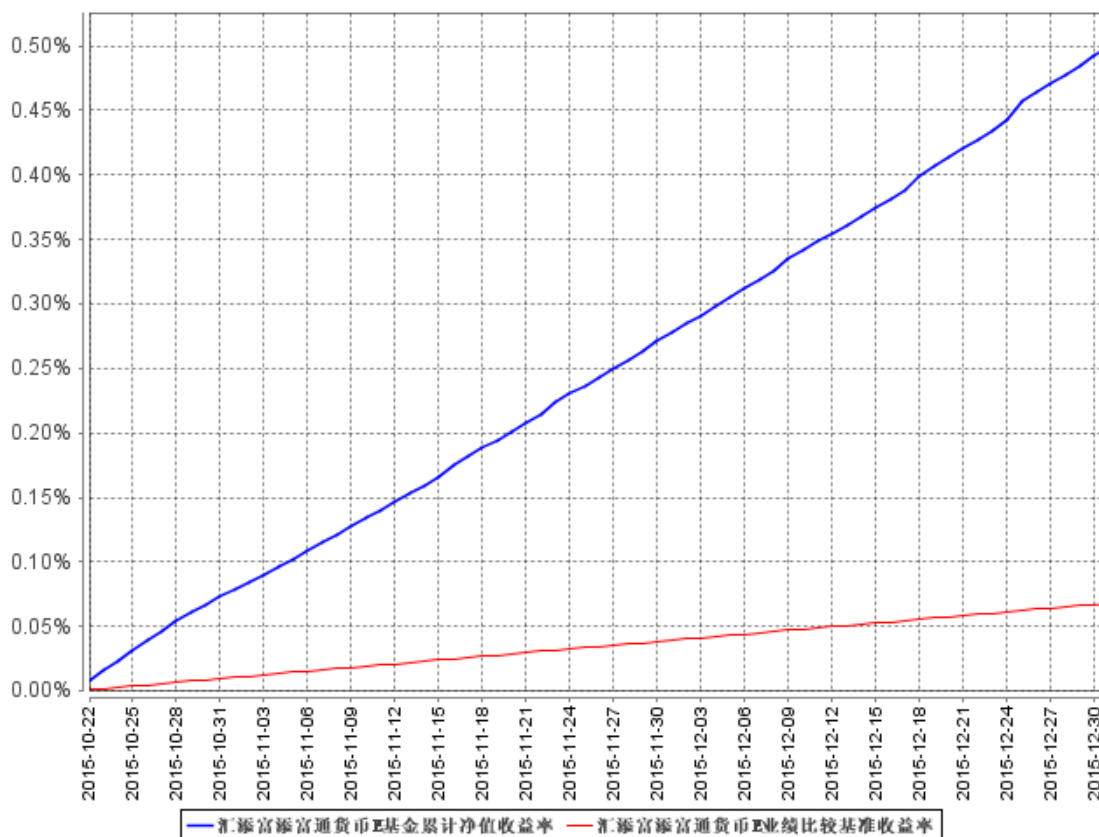
汇添富添富货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富添富通货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富添富货币E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

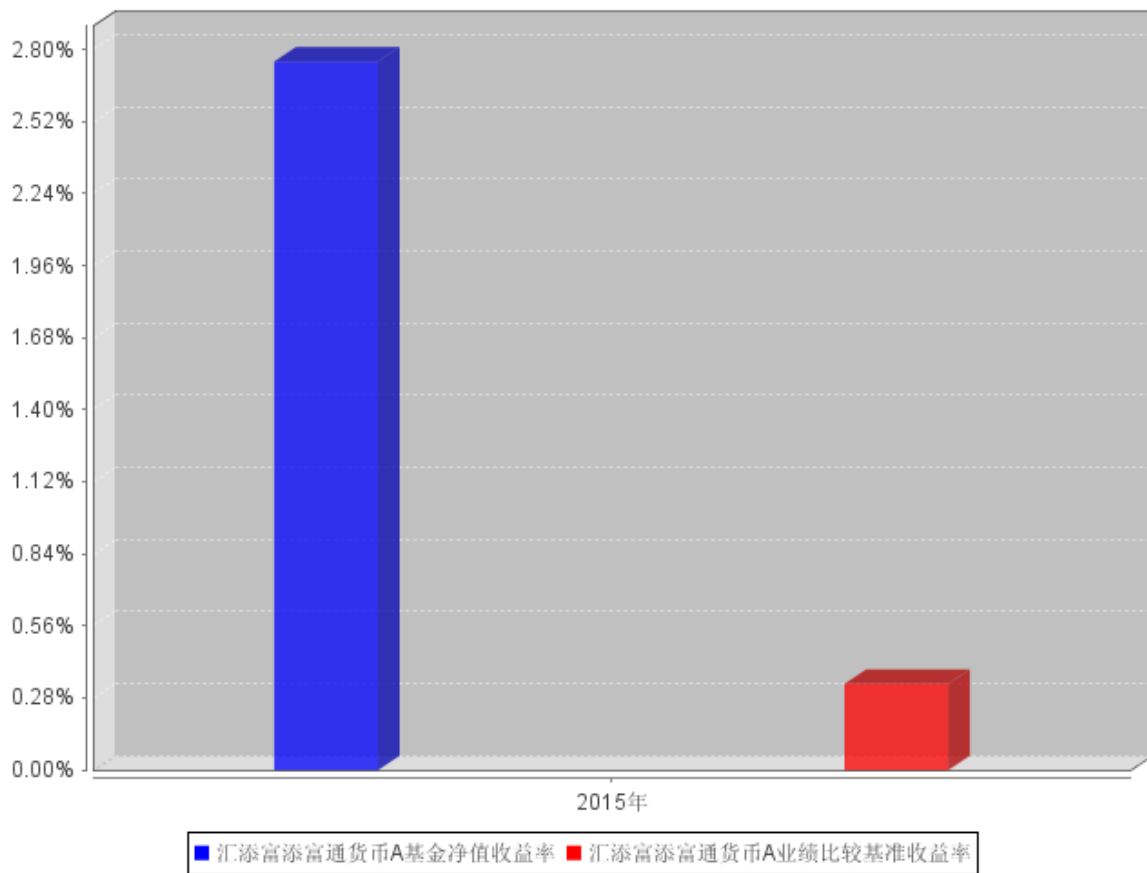


注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015年1月16日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定，至本报告期末未满一年；

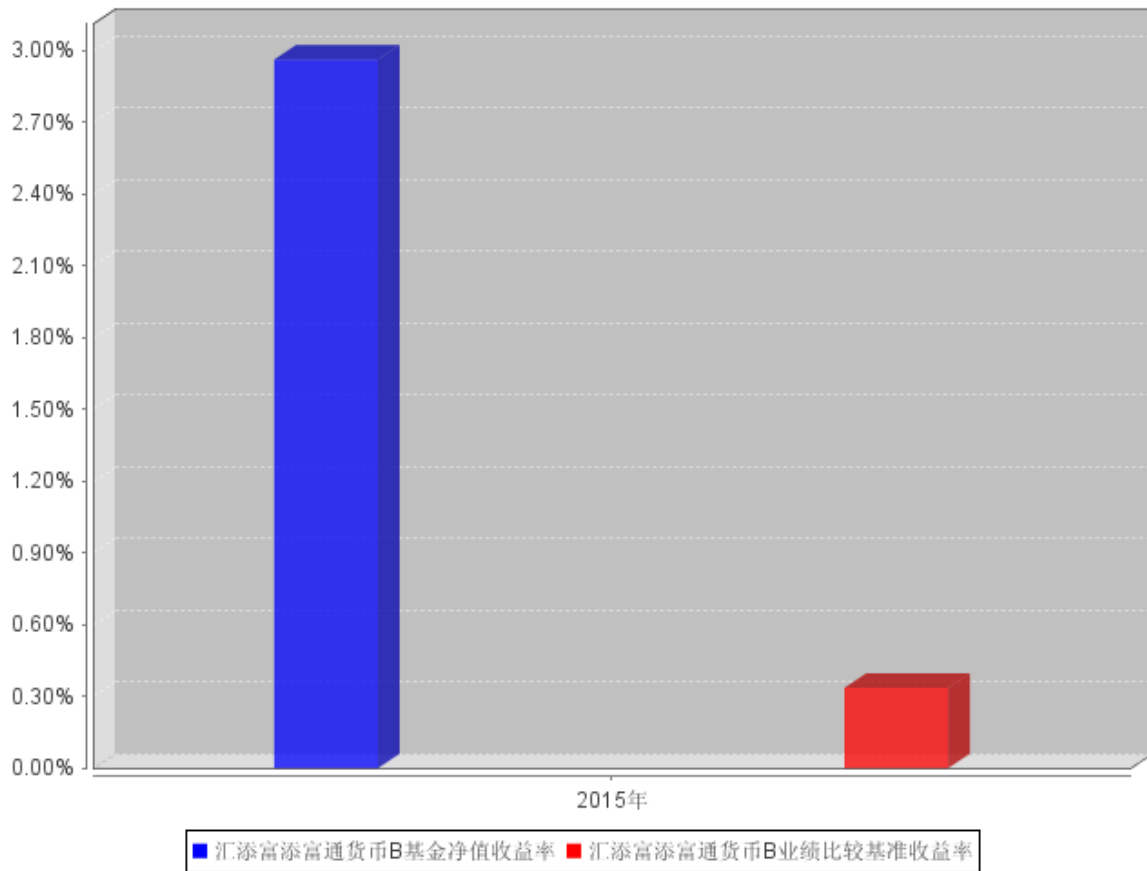
2、自2015年10月16日起，本基金增设E类份额类别，份额申购首次确认日为2015年10月22日。

3.5.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

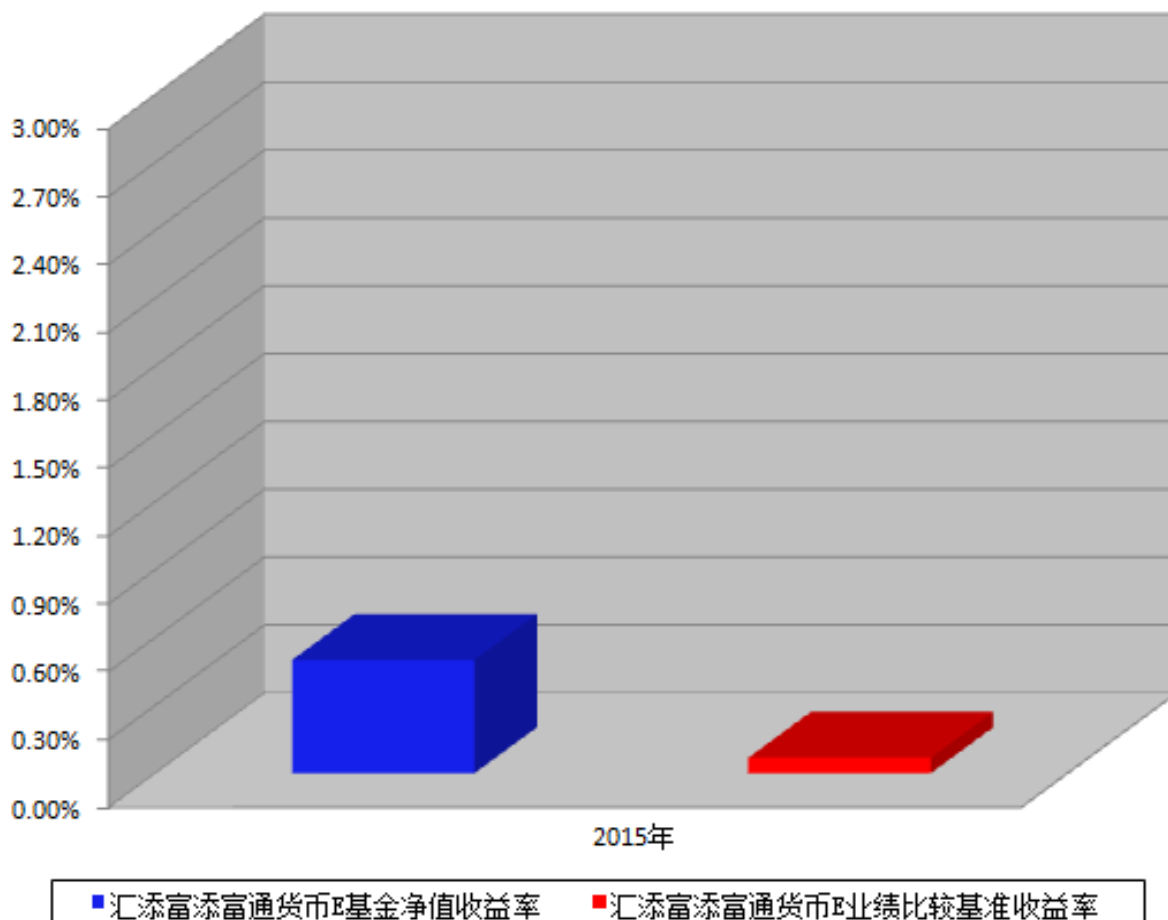
汇添富添富货币A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



汇添富添富货币B自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



汇添富添富货币E自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015年1月16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，至本报告期末未满一年；

2、自2015年10月16日起，本基金增设E类份额类别，份额申购首次确认日为2015年10月22日。

3.6 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

汇添富添富货币 A

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
2015	7,202,501.51	-	-	7,202,501.51
合计	7,202,501.51	-	-	7,202,501.51

汇添富添富通货币 B

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
2015	30,302,324.31	-	-	30,302,324.31
合计	30,302,324.31	-	-	30,302,324.31

汇添富添富通货币 E

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
2015	46,146,991.03	-	-	46,146,991.03
合计	46,146,991.03	-	-	46,146,991.03

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII 业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人。截至目前，汇添富已经构建起公募、专户、养老金、国际业务、融资业务及互联网金融六大业务板块协同发展的统一的资产管理服务平台。

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地贯彻和执行。2015 年，汇添富保持了优秀的投资业绩：2015 年，公司旗下偏股型基金全年平均涨幅达到 71.97%，在大型基金公司当中稳居第一（数据来源：银河基金研究中心）。民营活力、蓝筹稳健和优势精选在同类基金中收益排名前十（数据来源：WIND）。公司中长期投资业绩同样表现十分优秀，旗下权益类基金 3 年期、5 年期整体业绩位居前十五大基金公司之首（数据来源：银河基金研究中心）。

2015 年，汇添富基金新发 8 只基金，包括 3 只股票型基金，2 只指数基金，以及 3 只混合型基金。其中，添富快钱和现金添富基金分别在深交所和上交所上市，进一步完善了公司场内货基产品线。全年，公司公募基金产品达到 58 只，涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品，为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2015 年，汇添富基金坚持自有平台与对外合作双面协同发展，互联网金融取得长足进步。截止年底，公司电商平台已与三十余家大型互联网企业开展战略合作，成为迄今为止在电子商务领域对外合作最多的基金公司；公司互联网金融保有量突破 1000 亿元，客户数量超过 1800 万人，2015 年全年电商平台成交量超过 12000 亿元，保持行业领先水平。

2015 年，汇添富基金机构业务稳步推进。截至年底，公司服务机构客户数量超过 200 家，资产管理规模同比增长超过 150%；公司受托管理 19 家保险机构的资产委托账户，并于 2015 年 6 月，成为社保基金境外配售组合的投资管理人，成为基金行业仅有的两家获得此项资格的机构之一。

2015 年，公司积极开展渠道销售和培训工作。优秀的投资业绩、专业的投顾服务以及良好的渠道口碑带来了汇添富品牌影响力的巨大提升。全年，渠道新发基金首募规模在同期发行基金中保持行业领先地位。全年渠道公募保有量同比增长超过 100%。

2015 年，汇添富基金持续提升客户服务能力，通过持续完善客户平台建设，持续优化电话、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提高客服体验。

2015 年，香港子公司国际业务取得重大突破。香港子公司与台湾最大券商签订沪港通投顾合约，与韩国两家排名前十的大型基金管理公司开展投顾合作。此外，公司两地基金互认业务也走在行业前列，截至年底已有 3 只南下基金获香港证监会销售批准。

2015 年，公司持续加强公益事业建设，践行企业社会责任。8 月，“生命之光”汇添富乡村医生助飞项目启动，公司邀请多位优秀专家深入宁夏泾源县和青海互助县，为当地一线医务工作者提供专业培训指导，并面向农村百姓开展义诊活动。11 月，公司赞助的第 20 届上海国际马拉松赛首度引入公益元素，与“河流·孩子”项目合作，推出“全马完赛公益捐赠”活动，将筹得善款用于改善“河流·孩子”项目学校学生的生活条件。

2015 年，汇添富荣获了包括明星基金奖、金牛基金奖、上海金融创新二等奖、最佳债券公司奖、最佳电子交易平台等多个重要奖项。

2016 年是“十三五”的开局之年，资本市场改革进一步深化，财富管理行业在混业竞争和互联网金融的双重推动下将面临更大的挑战与机遇。汇添富基金将始终坚信长期的力量，开拓进取、

奋勇前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
梁珂	汇添富可转换债券基金、汇添富新收益债券基金的基金经理。	2013 年 12 月 11 日	2015 年 1 月 15 日	7 年	国籍：中国。学历：北京大学概率论及数理统计学学士、硕士，经济学双学位。相关业务资格：基金从业资格，特许金融分析师（CFA）。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。2012 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司从事固定收益研究。2013 年 3 月 28 日至 2015 年 7 月 22 日任汇添富可转换债券基金的

					基金经理，2013 年 12 月 10 日至 2015 年 1 月 15 日任汇添富新收益债券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
汤丛珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财 30 天债券基金、汇添富理财 60 天债券基金、汇添富和聚宝货币基金、汇添富添富通货币基金的基金经理。	2015 年 1 月 16 日	-	7 年	国籍：中国，学历：上海财经大学管理学硕士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：2008 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013 年 7 月 31 日

					<p>至今任汇添富货币基金的基金经理，2013 年 12 月 13 日至今任汇添富全额宝货币基金基金经理。</p> <p>2014 年 1 月 21 日至今任汇添富理财 30 天债券、理财 60 天债券基金的基金经理。</p> <p>2014 年 5 月 28 日至 2015 年 7 月 30 日任汇添富和聚宝货币基金基金经理。</p> <p>2015 年 1 月 16 日至今任汇添富添富货币基金（原汇添富新收益债券基金）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业

务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部、集中交易室、投资研究部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的监控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3日、5日）同向交易的样本，利用统计分析的方法和工具，根据对样本个数、差价率是否为0的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等原因进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为5次，其中一次是由于流动性原因，一次是由于合规控制调整原因，三次是因为投资策略原因。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年经济下行的压力持续较大,央行采取较为宽松的货币政策为经济护航,但一季度货币市场实际利率并未如预期引导下行,且受到股票IPO和股市上涨的挤压效应影响,银行间流动性较紧,协议存款利率持续较高,短融收益率逐步上行,信用利差扩大。至2015年二季度,资金面迅速放松,尤其短期回购利率出现了大幅的下行,同时带动存款利率和短融利率下行,资金面有加速宽松的趋势,信用利差逐步压缩。尽管货币市场随后出现了几次调整和不错的建仓时点,但央行货币政策的基调未改,资金面整体宽松,货币市场利率低位运行。

本基金在报告期安排了较大比例的流动性于月末、季末等可能发生流动性紧张的时点滚动操作,在短融收益率高企的时点战略性建仓,并持续改善组合持仓中短融的流动性。通过短融的波段性操作和合理错配存款到期日,在保证组合整体流动性的前提下,抓住资金利率高企的时间窗口锁定高息存款和优质短融提高组合收益率。通过这些前瞻性的操作,本基金有效应对了组合的规模变化,确保了组合的流动性和和合法合规运作,并抓住关键时点锁定了一部分较高收益的同业存款和短期债券获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前,汇添富新收益债券型证券投资基金的净值收益率为0.02%;转型后,汇添富添富通货币市场基金A级净值收益率为2.7535%,B级净值收益率为2.9624%,E级净值收益率为0.4999%。

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，国内经济下行的压力使得货币政策继续宽松护航，通胀维持低位，对收益率曲线下行有利的因素仍然存在，但在绝对收益率降至较低水平的情况下，波动风险和相应的波段机会需要关注。目前人民币汇率贬值压力仍然较大，制约货币政策的实施空间，同时，由于货币市场可能面临风险资产配置意愿增强、汇率贬值资金外流等事件的冲击，如果市场情绪过于乐观，需要防范资金的超预期收紧带来的收益率波动。近期山水等信用事件频发，刚兑打破的历史趋势未变且有加速之势，利于无风险利率的进一步下行，而当前信用利差保护不足，信用债投资需仔细排雷，配置以中高等级为主，严防信用风险。

有鉴于此，本基金将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下，综合分析本基金的份额变动，提前做好债券与存款之间的配置计划，保持组合的较高流动性和安全性，严防信用风险，积极把握市场结构性机会，通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位博取资本利得收入为投资者创造更多额外收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系

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

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

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

（三）强化培训教育，提高全员合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

转型前，汇添富新收益债券型证券投资基金的《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 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。

转型后，汇添富添富货币市场基金的《基金合同》约定：场外基金份额的收益分配原则为“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分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中进行支付，收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。”场内基金份额的收益分配原则为“本基金根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户。收益分配方式为红利再投资，计入投资人收益账户，免收再投资的费用。投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配，并享有同等收益分配。” 本基金 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日期间累计分配收益 83,651,816.85 元，均以红利再投资方式结转入实收基金。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富添富货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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，汇添富添富货币市场基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富添富货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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添富货币市场基金 2015 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

转型前：本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师陈露、蔺育化于 2016 年 3 月 25 日签字出具了安永华明（2016）审字第 60466941_B45 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

转型后：本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师陈露、蔺育化于 2016 年 3 月 25 日签字出具了安永华明（2016）审字第 60466941_B46 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务会计报告

7.1 转型前

7.1.1 资产负债表

会计主体：汇添富新收益债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 1 月 15 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	16,355,986.07	1,357,942.88
结算备付金	369,736.67	210,008.87
存出保证金	8,252.65	8,920.25
交易性金融资产	-	20,028,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	-	20,028,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	2,645,725.57
应收利息	6,514.11	643,210.01
应收股利	-	-
应收申购款	-	52,476.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	16,740,489.50	24,946,283.82
负债和所有者权益	本期末 2015 年 1 月 15 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	500,679.41
应付管理人报酬	9,391.19	22,726.80
应付托管费	2,683.19	6,493.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,351.49	1,001.49
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	315,616.35	300,225.51
负债合计	329,042.22	831,126.58
所有者权益:		
实收基金	15,081,956.52	22,164,804.22
未分配利润	1,329,490.76	1,950,353.02
所有者权益合计	16,411,447.28	24,115,157.24
负债和所有者权益总计	16,740,489.50	24,946,283.82

注：1、报告截止日 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日），基金份额净值 1.088 元，基金份额总额 15,081,956.52 份。

2、自 2015 年 1 月 16 日起，原《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》失效，《汇添富添富通货币市场基金基金合同》生效。

7.1.2 利润表

会计主体：汇添富新收益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	30,474.07	8,577,589.31
1.利息收入	32,904.10	4,343,823.01
其中：存款利息收入	4,997.25	1,659,986.04
债券利息收入	27,906.85	1,789,711.17
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	894,125.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	18,270.00	4,068,233.91
其中：股票投资收益	-	-1,026.95
基金投资收益	-	-

债券投资收益	18,270.00	4,069,260.86
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-29,790.00	54,655.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	9,089.97	110,877.12
减：二、费用	28,045.73	1,668,820.99
1. 管理人报酬	9,391.19	744,055.00
2. 托管费	2,683.19	212,587.12
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	350.00	2,362.74
5. 利息支出	-	295,057.55
其中：卖出回购金融资产支出	-	295,057.55
6. 其他费用	15,621.35	414,758.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,428.34	6,908,768.32

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富新收益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 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）	22,164,804.22	1,950,353.02	24,115,157.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,428.34	2,428.34
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）	-7,082,847.70	-623,290.60	-7,706,138.30
其中：1.基金申购款	28,617,982.60	2,518,382.47	31,136,365.07
2.基金赎回款	-35,700,830.30	-3,141,673.07	-38,842,503.37
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）	-	-	-

货币市场基金基金合同》生效，《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》同时失效，汇添富新收益债券型证券投资基金正式变更为汇添富添富通货币市场基金，

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券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。本基金主要投资于债券资产，同时密切关注一级市场新股发行及二级股票市场的运行状况与风险收益特征，把握相对确定性的投资机会，从而在严格控制基金资产运作风险的基础上，力争实现组合的稳健增值。本基金业绩比较基准：中债综合指数。

7.1.4.2 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。

根据汇添富新收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议，本基金于 2015 年 1 月 16 日转型为汇添富添富通货币市场基金继续运作，故本财务报表仍以持续经营假设为基础编制。

7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

7.1.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.1.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.1.4.6 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。

7.1.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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
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

7.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.8.1.1 股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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
东方证券股份有限公司	-	-	89,668.95	100.00%

7.1.4.8.1.2 债券交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	-	-	397,476,553.19	100.00%

7.1.4.8.1.3 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	-	-	6,786,000,000.00	100.00%

7.1.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.1.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年1月15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	-	-	81.64	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	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	81.64	100.00%	81.64	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.1.4.8.2 关联方报酬

7.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 1月15日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	9,391.19
其中：支付销售机构的客户维护费	1,746.34	240,157.70

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.1.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年1月15日		2014年1月1日至2014年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	2,683.19		212,587.12	

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： $H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.1.4.8.3 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。

7.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.1.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.1.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年1月15日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	16,355,986.07	4,785.06	1,357,942.88	190,423.60

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）度获得的利息收入为人民币 206.46 元（2014 年度：人民币 46,154.41 元），2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）结算备付金余额为人民币 369,736.67 元（2014 年末：人民币 210,008.87 元）。

7.1.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.1.4.9 期末（2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日））本基金持有的流通受限证券**7.1.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.1.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.1.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

注：截至本报告期末 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）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。

7.1.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）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。

7.1.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**7.1.4.10.1 公允价值****7.1.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具**

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

7.1.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具**7.1.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值**

于 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日），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无属于第一层次、第二层次和第三层次的余额（于 2014 年 12 月 31 日，第二层次的余额为人民币 20,028,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

7.1.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 1 月 15 日（基金合同失效前日）止期间，对于以公允价值计量的金融工具，无由第一层次转入第二层次以及第二层次转入第一层次的投资。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

7.1.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

生变动。

7.1.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.1.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.1.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

7.2 转型后

7.2.1 资产负债表

会计主体：汇添富添富通货币市场基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日
资 产：	
银行存款	10,483,032,183.14
结算备付金	38,547,619.05
存出保证金	-
交易性金融资产	5,998,537,898.71
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	5,998,537,898.71
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	900,102,496.60
应收证券清算款	-
应收利息	77,878,563.17
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	17,498,098,760.67
	本期末 2015 年 12 月 31 日
负 债 和 所 有 者 权 益	
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-

衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	1,068,103.76
应付销售服务费	2,358,541.66
应付交易费用	57,662.83
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	389,300.00
负债合计	3,873,608.25
所有者权益：	
实收基金	17,494,225,152.42
未分配利润	-
所有者权益合计	17,494,225,152.42
负债和所有者权益总计	17,498,098,760.67

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，A 类基金份额和 B 类基金份额的基金份额净值为 1.00 元，E 类基金份额的基金份额净值为 100.00 元，A 类基金份额总额 378,071,242.70 份，B 类基金份额总额 5,239,385,349.14 份，E 类基金份额总额 118,767,685.61 份。

2、本基金合同于 2015 年 1 月 16 日生效。

7.2.2 利润表

会计主体：汇添富添富通货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	95,034,577.32
1.利息收入	91,997,631.31
其中：存款利息收入	70,657,465.27
债券利息收入	19,022,968.92
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,317,197.12
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,036,946.01
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	3,036,946.01
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-

股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、费用	11,382,760.47
1. 管理人报酬	819,141.61
2. 托管费	3,059,069.55
3. 销售服务费	5,231,455.20
4. 交易费用	-
5. 利息支出	1,724,697.67
其中：卖出回购金融资产支出	1,724,697.67
6. 其他费用	548,396.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	83,651,816.85

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富添富通货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 16 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）	16,411,447.28	-	16,411,447.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	83,651,816.85	83,651,816.85
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）	17,477,813,705.14	-	17,477,813,705.14
其中：1.基金申购款	38,289,264,873.16	-	38,289,264,873.16
2.基金赎回款	-20,811,451,168.02	-	-20,811,451,168.02
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）	-	-83,651,816.85	-83,651,816.85
五、期末所有者权益（基金净值）	17,494,225,152.42	-	17,494,225,152.42

注：后附会计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	_____ 陈灿辉	_____ 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

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

汇添富添富通货币市场基金(以下简称“本基金”)是由汇添富新收益债券型证券投资基金转型而来。原汇添富新收益债券型证券投资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]1197号文《关于核准汇添富新收益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向社会公开发行募集,基金合同于2013年12月10日正式生效,首次设立募集规模为398,350,312.89基金份额。2015年1月9日,汇添富新收益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新收益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。2015年1月15日,基金管理人对汇添富新收益债券型证券投资基金进行份额折算。自汇添富新收益债券型证券投资基金基金份额折算日次日(即2015年1月16日)起,《汇添富添富通货币市场基金基金合同》生效,《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》同时失效,汇添富新收益债券型证券投资基金正式变更为汇添富添富通货币市场基金。自2015年1月16日起,《汇添富添富通货币市场基金基金合同》正式生效,由汇添富新收益债券型证券投资基金基金净资产折算为汇添富添富通货币市场基金A类16,411,447.28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为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司与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。

经中国证监会2015年9月25日《关于准予汇添富添富通货币市场基金变更注册批复》,汇添富添富通货币市场基金进行变更注册,增设E类基金份额。增设基金份额后,本基金将分设A类基金份额、B类基金份额和E类基金份额。其中A类、B类基金份额为场外基金份额,注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司。A类、B类基金份额的基金账户最低余额为分别为0.01份和5,000,000.00份。若A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过5,000,000.00份时,本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额;若B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于5,000,000.00份时,本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的B类基金份额降级为A类基金份额。E类基金份额为场内份额,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,不进行基金份额升降级。本基金

A 类份额和 B 类份额基金收益为“每日分配，按月支付”，E 类份额基金收益为“每日分配、利随本清”。各级基金份额单独设置基金代码，并单独公布各级基金每万份基金净收益/每百份基金已实现收益和七日年化收益率。

本基金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、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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。本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

7.2.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 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。

7.2.4.4.2 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。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

7.2.4.4.3 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。

7.2.4.4.4 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。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债。

7.2.4.4.5 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。

7.2.4.4.6 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“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.50% 的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.2.4.4.7 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。

7.2.4.4.8 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。本基金每份 A 类基金份额和每份 B 类

基金份额的面值为 1.00 元，每份 E 类基金份额的面值为 100.00 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。

7.2.4.4.9 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，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(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。

7.2.4.4.10 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 0.30%年费率计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提；

(3)A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级的确认日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级的确认日起享受 B 类基金份额的费率。E 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%；

(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。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金场外基金份额的收益分配原则：

(1) 同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 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、按月支付”。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分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中进行支付。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。因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额；其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其赎回基金份额对应的累计收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

(6) 基金管理人有权在基金注册登记机构条件允许、并与基金托管人协商一致的情形下，将全部或部分基金份额的收益分配由“每日分配，按月支付”提升为“每日分配，按日支付”并予以公告；

(7) 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；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2、本基金场内基金份额的收益分配原则：

(1) 每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配方式为红利再投资，计入投资人收益账户，免收再投资的费用。投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配，并享有同等收益分配权；

(3) “每日分配、利随本清”。本基金根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户。投资人赎回基金份额时，其对

应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人；若累计收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。投资人卖出部分基金份额时，不支付对应的收益；但投资人份额全部卖出时，以现金方式将全部累计收益与投资人结清。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；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；基金管理人有权在基金注册登记机构条件允许、并与基金托管人协商一致的情形下，将全部或部分基金份额的收益分配由“每日分配，按月支付”提升为“每日分配，按日支付”并予以公告；

(5) 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；

(6) 当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.2.4.5.3 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。

7.2.4.6 税项

1、营业税、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

2、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定：自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.2.5 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、基金注册登记机构、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
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

7.2.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.6.1.1 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.2.6.1.1.2 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	8,095,000,000.00	100.00%

7.2.6.1.1.3 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。

7.2.6.1.1.4 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.2.6.1.2 关联方报酬

7.2.6.1.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的管理费	819,141.61	
其中：支付销售机构的客户维护费	317,492.61	

注：（1）自 2015 年 9 月 25 日起至 2016 年 3 月 31 日止，本基金管理人决定不收取本基金的管理费。

（2）基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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。

7.2.6.1.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的托管费	3,059,069.55	

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.2.6.1.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	添富通货币 A	添富通货币 B	添富通货币 E	合计
汇添富基金管理股份有限公司	72,816.64	84,294.77	1,272,232.10	1,429,343.51

中国工商银行股份有限公司	363,742.00	825.97	-	364,567.97
东方证券股份有限公司	106.44	-	301,299.00	301,405.44
合计	436,665.08	85,120.74	1,573,531.10	2,095,316.92

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。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级的确认日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级的确认日起享受 B 类基金份额的费率。E 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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 2 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。

7.2.6.1.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	2,774,990,500.00	223,444.91

7.2.6.1.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.6.1.4.1 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。

7.2.6.1.4.2 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

汇添富添富通货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占总份额的比例
东方证券股份有限公司	7,512,994.00	6.33%	-	-

注：1、本基金关联方东方证券股份有限公司本报告期累计运用 4,880,000,100.00 元，申购本基金 E 类份额 48,800,001.00 份，申购费为 0；累计赎回 4,199,086.00 份，赎回费为 0。均符合招募说明书的规定。期间累计获得分红转投份额 11,878.00 份，从二级市场累计买入 262,239,377.00 份，

卖出 299,339,176.00 份。

2、本基金 E 类基金份额面值为人民币 100 元。

7.2.6.1.5 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	
	2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,032,183.14	1,198,756.37

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间度获得的利息收入为人民币 1,538,782.80 元，2015 年末结算备付金余额为人民币 38,547,619.05 元。

7.2.6.1.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

7.2.6.2.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.2.6.2.2 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。

7.2.6.2.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.6.2.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

7.2.6.2.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.2.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.2.7.1 公允价值

7.2.7.1.1 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。

7.2.7.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.2.7.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 5,998,537,898.71 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

7.2.7.1.2.2 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。

7.2.7.1.2.3 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。

7.2.7.2 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。

7.2.7.3 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。

7.2.7.4 财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月25日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 转型前

8.1.1 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	-	-
	其中：债券	-	-
	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	16,725,722.74	99.91
7	其他各项资产	14,766.76	0.09
8	合计	16,740,489.50	100.00

8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 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

注：本基金本报告期未投资股票。

8.1.4.2 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

注：本基金本报告期未投资股票。

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期未投资股票。

8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.1.8 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。

8.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.1.10.3 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。

8.1.11 投资组合报告附注

8.1.11.1

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。

8.1.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.1.11.3 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	8,252.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,514.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,766.76

8.1.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.2 转型后

8.2.1 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	5,998,537,898.71	34.28
	其中：债券	5,998,537,898.71	34.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	900,102,496.60	5.14
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	99,999,896.45	0.57
3	银行存款和结算备付金合计	10,521,579,802.19	60.13

4	其他各项资产	77,878,563.17	0.45
5	合计	17,498,098,760.67	100.00

8.2.2 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	2.16	
	其中:买断式回购融资	0.00	
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	0.00	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: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%。

8.2.3 基金投资组合平均剩余期限

8.2.3.1 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	95
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注:本基金合同规定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.2.3.2 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	22.41	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.68	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

3	60天(含)—90天	26.73	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	22.01	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	15.75	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.58	-

8.2.4 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	630,832,370.57	3.61
	其中：政策性金融债	630,832,370.57	3.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,384,476,093.48	19.35
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,983,229,434.66	11.34
8	其他	-	-
9	合计	5,998,537,898.71	34.29
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.2.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	111519107	15 恒丰银行 CD107	3,000,000	297,959,405.78	1.70
2	111508212	15 中信 CD212	3,000,000	295,423,874.39	1.69
3	150419	15 农发 19	2,000,000	200,338,677.95	1.15
4	111509270	15 浦发 CD270	2,000,000	199,472,854.95	1.14
5	111508170	15 中信 CD170	2,000,000	199,456,404.07	1.14
6	111592734	15 成都银行 CD041	2,000,000	198,956,839.29	1.14

7	111593318	15 盛京银行 CD100	2,000,000	198,532,599.08	1.13
8	111593371	15 徽商银行 CD138	2,000,000	196,909,139.34	1.13
9	041558092	15 远东租赁 CP001	1,500,000	150,029,181.27	0.86
10	041554007	15 洋河 CP001	1,300,000	130,583,180.88	0.75

8.2.6 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1900%
报告期内偏离度的最低值	-0.0200%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0600%

8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.2.8 投资组合报告附注

8.2.8.1

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

8.2.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

8.2.8.3

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

8.2.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	77,878,563.17
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	77,878,563.17

§9 基金份额持有人信息

9.1 转型前

9.1.1 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
787	19,163.86	0.00	0.00%	15,081,956.52	100.00%

9.1.2 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	24,521.58	0.16%

9.1.3 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

9.2 转型后

9.2.1 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
添富通	10,478.00	36,082.39	3,722,348.40	0.98%	374,348,894.30	99.02%

货币 A						
添富通货币 B	29.00	180,668,460.32	5,215,213,010.02	99.54%	24,172,339.12	0.46%
添富通货币 E	1,370.00	86,691.74	114,163,863.95	96.12%	4,603,821.66	3.88%
合计	11,877.00	482,969.12	5,333,099,222.37	92.97%	403,125,055.08	7.03%

注：本基金 E 类基金份额面值为人民币 100 元。

9.2.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	东方证券股份有限公司	7,435,684.00	6.26%
2	全国社保基金五零四组合	5,103,315.00	4.30%
3	招商证券股份有限公司	5,004,600.00	4.21%
4	汇添富基金—招商银行—华润信托—华润信托·鑫睿 3 号单一资金信托	5,002,065.00	4.21%
5	歌斐诺宝（上海）资产管理有限公司—歌斐诺宝永迅一号基金	4,193,553.00	3.53%
6	中国对外经济贸易信托有限公司—申毅量化套利集合资金信托计划	4,049,192.00	3.41%
7	光大证券股份有限公司	4,001,562.00	3.37%
8	太平洋证券股份有限公司	3,999,732.00	3.37%
9	YALE UNIVERSITY	3,012,932.00	2.54%
10	汇添富基金—光大银行—添富—毓盛—定增双喜盛世添富牛 28 号资产管理计划	2,689,849.00	2.26%

9.2.3 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	添富通货币 A	500.05	0.0001%
	添富通货币 B	-	-
	添富通货币 E	-	-

	合计	500.05	0.0000%
--	----	--------	---------

9.2.4 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	添富货币 A	0
	添富货币 B	0
	添富货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	添富货币 A	0
	添富货币 B	0
	添富货币 E	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

10.1 转型前

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 10 日）基金份额总额	398,350,312.89
本报告期期初基金份额总额	22,164,804.22
本报告期基金总申购份额	28,617,982.60
减:本报告期基金总赎回份额	35,700,830.30
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	15,081,956.52

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

10.2 转型后

单位：份

	添富货币 A	添富货币 B	添富货币 E
基金合同生效日（2015 年 1 月 16 日）基金份额总额	16,411,447.28	-	-
本报告期期初基金份额总额	16,411,447.28	-	-
本报告期基金总申购份额	3,460,443,647.18	11,878,197,034.95	229,506,241.91
减:本报告期基金总赎回份额	3,098,783,851.76	6,638,811,685.81	110,738,556.30

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	378,071,242.70	5,239,385,349.14	118,767,685.6 1

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。本基金 E 类合同生效日为 2015 年 10 月 16 日，基金份额面值为人民币 100 元。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2015 年 1 月 9 日，汇添富新收益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新收益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 27,572,610.29 份，占权益登记日基金总份额 48,331,171.83 份的 57.05%，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。会议审议通过了《关于汇添富新收益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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，汪洋先生不再担任汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF 基金的基金经理，由吴振翔先生单独管理上述基金。

2、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富深证 300ETF、汇添富深证 300ETF 联接基金的基金经理。同时，汪洋先生不再担任上述基金的基金经理。

3、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，与叶从飞先生共同管理该基金。

4、基金管理人 2015 年 1 月 31 日公告，增聘李威先生担任汇添富外延增长股票基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。

5、基金管理人 2015 年 2 月 5 日公告，增聘刘闯先生担任汇添富医药保健混合基金的基金经理，与周睿先生共同管理该基金。

6、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 16 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

7、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 21 天债券基金的基金经理，与曾刚先生共同管理上述基金。

8、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，与王栩先生共同管理该基金。

9、《汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2015 年 3 月 24 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富收益快线货币基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

- 11、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富全额宝货币基金的基金经理，由汤从珊女士单独管理该基金。
- 12、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 21 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理上述基金。
- 13、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，王栩先生不再担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。
- 14、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富理财 7 天债券基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
- 15、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，新任李文先生为董事长，潘鑫军先生不再担任董事长。
- 16、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，林利军先生不再担任法定代表人和总经理，由李文先生代为履行法定代表人职责，由张晖先生代为履行总经理职责。
- 17、基金管理人 2015 年 5 月 27 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富香港优势混合基金的基金经理，与王致人先生共同管理该基金。
- 18、基金管理人 2015 年 6 月 16 日公告，王致人先生不再担任汇添富香港优势混合基金的基金经理，由赖中立先生单独管理该基金。
- 19、《汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 18 日正式生效，刘江先生任该基金的基金经理。
- 20、基金管理人 2015 年 6 月 27 日公告，新任李文先生为法定代表人，新任张晖先生为总经理。新任李鹏先生为督察长，李文先生不再担任督察长，张晖先生不再担任副总经理。
- 21、基金管理人 2015 年 7 月 18 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富可转债债券基金的基金经理，与曾刚、梁珂先生共同管理该基金。
- 22、《汇添富国企创新股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 10 日正式生效，李威先生、劳杰男先生任该基金的基金经理。
- 23、基金管理人 2015 年 7 月 24 日公告，梁珂先生不再担任汇添富可转债债券基金的基金经理，由曾刚先生、吴江宏先生管理该基金。
- 24、基金管理人 2015 年 7 月 31 日公告，叶从飞先生不再担任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，由雷鸣先生单独管理该基金；汤从珊女士不再担任汇添富和聚宝货币基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
- 25、基金管理人 2015 年 8 月 5 日公告，朱晓亮先生不再担任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，由韩贤旺先生、叶从飞先生、顾耀强先生管理该基金。
- 26、基金管理人 2015 年 8 月 5 日公告，增聘过蓓蓓女士担任汇添富消费 ETF、金融 ETF、能源 ETF、医药 ETF、消费 ETF 联接基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。
- 27、基金管理人 2015 年 8 月 6 日公告，经汇添富基金管理股份有限公司第二届董事会第三次会议决议，公司聘任袁建军先生为公司副总经理。
- 28、《汇添富民营新动力股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 7 日正式生效，谭志强先生任该基金的基金经理。
- 29、基金管理人 2015 年 8 月 19 日公告，增聘过蓓蓓女士担任汇添富深 300ETF、深 300ETF 联接基金的基金经理，与赖中立先生共同管理该基金。
- 30、基金管理人 2015 年 8 月 29 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富信用债债券基金的基金经理，由何旻先生单独管理该基金。
- 31、基金管理人 2015 年 10 月 29 日公告，增聘倪健先生担任汇添富香港优势混合基金的基金经理，与赖中立先生共同管理该基金。
- 32、基金管理人 2015 年 11 月 3 日公告，吴振翔先生不再担任汇添富消费 ETF、金融 ETF、能源 ETF、医药 ETF 基金的基金经理，由过蓓蓓女士单独管理该基金。

33、基金管理人 2015 年 11 月 19 日公告，增聘劳杰男先生担任汇添富价值精选混合基金的基金经理，与陈晓翔先生共同管理该基金。

34、基金管理人 2015 年 11 月 19 日公告，增聘李怀定先生担任汇添富季季红定期开放债券基金、互利分级债券基金的基金经理，与陆文磊先生共同管理上述基金。

35、《汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 26 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

36、基金管理人 2015 年 11 月 26 日公告，增聘许一尊先生担任汇添富成长多因子量化策略股票基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

37、《汇添富新兴消费型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 2 日正式生效，雷鸣先生、刘伟林先生任该基金的基金经理。

38、《汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 2 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

39、本报告期，基金托管人中国工商银行股份有限公司的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

2015 年 1 月 16 日原“汇添富新收益债券型证券投资基金”转型为“汇添富添富货币市场基金”。汇添富添富货币市场基金的投资目标、投资范围、投资策略请详见本公司刊登在 2015 年 1 月 16 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司网站的《汇添富添富货币市场基金基金合同》。

11.5 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）。本报告期内应付未付当期审计费用为人民币陆万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 1 月，针对上海证监局出具的整改措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。

2015 年 4 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 转型前：

11.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

注：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。

11.7.1.2 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、以上 2 个交易单元与汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富收益快线货币市场基、金汇添富理财 30 天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、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金共用。报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：本基金本报告期末新增或退租交易单元。

11.7.2 转型后：

11.7.2.1 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	

			例			
东方证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.7.2.2 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	-	-	8,095,000,000.00	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、以上 2 个交易单元与汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富收益快线货币市场基、金汇添富理财 30 天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、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金共用。报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：本基金本报告期末新增或退租交易单元。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

汇添富基金管理股份有限公司
2016 年 3 月 29 日