

汇添富全额宝货币市场基金 2016 年半年度 报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	31
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	32
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	33
§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	34
§9 开放式基金份额变动.....	35
§10 重大事件揭示.....	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	36
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	38
10.9 其他重大事件	38
§11 备查文件目录.....	38
11.1 备查文件目录	38
11.2 存放地点	39
11.3 查阅方式.....	39

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富全额宝货币市场基金
基金简称	汇添富全额宝货币
基金主代码	000397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 13 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,998,146,005.44 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	本基金为货币市场证券投资基金,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、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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	罗菲菲
	联系电话	021-28932888	010-58560666
	电子邮箱	service@99fund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95568
传真		021-28932998	010-58560798
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		李文	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	176,030,288.96
本期利润	176,030,288.96
本期净值收益率	1.4228%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	10,998,146,005.44
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	11.2343%

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

3、本基金收益分配为按日结转份额。

3.2 基金净值表现

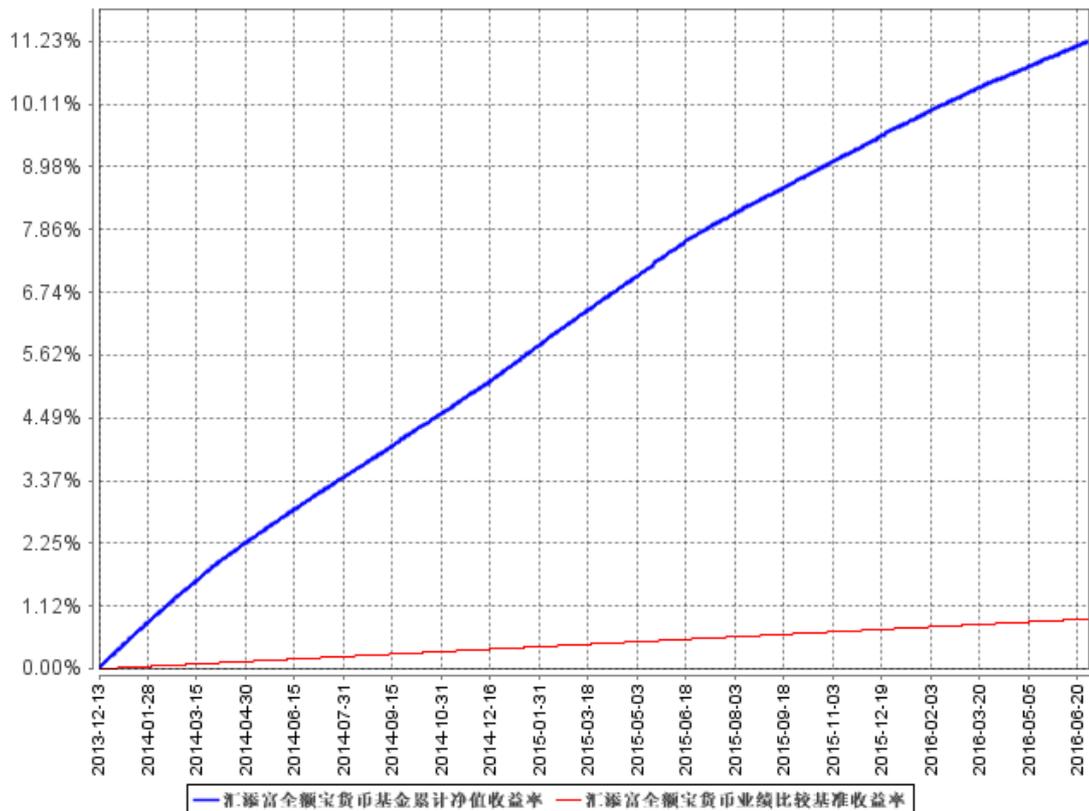
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.2213%	0.0010%	0.0287%	0.0000%	0.1926%	0.0010%
过去三个月	0.6618%	0.0013%	0.0870%	0.0000%	0.5748%	0.0013%
过去六个月	1.4228%	0.0016%	0.1740%	0.0000%	1.2488%	0.0016%
过去一年	3.1894%	0.0022%	0.3508%	0.0000%	2.8386%	0.0022%
自基金合同生效日起至 今	11.2343%	0.0034%	0.8949%	0.0000%	10.3394%	0.0034%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 12 月 13 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

汇添富全额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：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 12 月 13 日，截至本报告期末，基金成立未满三年；本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2013 年 12 月 13 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 11762.2978 万元人民币。截止到 2016 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2857 亿元，有效客户数约 1200 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 63 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富成长多因

子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富收益快线货币基金、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。	2016年6月7日	-	8年	国籍：中国。学历：复旦大学文学学士。六年证券从业经验。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。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线货币基金基金经理；2016年6月7日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。
汤丛珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理	2013年12月13日	2016年6月7日	8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日至今任汇添富货币基金的基金经理，2013年12月

	财 30 天债券 基金、 汇添富 理财 60 天 债券基 金、汇 添富添 富通货 币基金 的基金 经理。			13 日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。2014 年 1 月 21 日至今任汇添富理财 30 天债券、理财 60 天债券基金的基金经理。2014 年 5 月 28 日至 2015 年 7 月 30 日任汇添富和聚宝货币基金基金经理。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。
--	--	--	--	---

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 1 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，全球金融市场持续动荡，全球经济复苏前景仍不明朗。国内市场方面，经济运行相对平稳，包括 CPI、PPI、固定资产投资和信贷数据在内各类经济指标有所回暖，实体经济短期筑底反弹。包括新开工旺季、房地产投资回升、信贷走高及大宗反弹等，带动了国内经济小周期企稳。货币政策方面，虽受到银行考核、季末时点因素等短暂冲击，整体上宽松格局不改，央行 MLF 和 PSL 各种操作工具常态化，及时补充流动性市场流动性相对充沛。

操作上，本基金采取相对灵活的投资策略，持续增加债券以及同业存单的配置，并在二季度末大幅增加金融债配置，根据资金面配置短期到期的流动性资产以提供大量流动性应对月末影响，并通过积极的杠杆操作提高收益，在控制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

2016 年上半年本基金的收益率为 1.4228%，同期业绩比较基准率为 0.1740%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，供给侧改革和去产能背景下，我们判断经济基本面继续维持弱势，天气、大宗商品上涨等因素使 CPI 有上行压力。短期来看，货币政策会受到来自物价、一线城市房地产价格、金融市场杠杆率水平等因素的制约，难以出现大幅放松，货币政策方面，预计央行将维持现有的常态化操作思路，继续完善利率走廊管理，充分运用 MLF、PSL 等公开市场操作工具对冲短期流动性趋紧。

我们将在严格防范信用风险的前提下，密切跟踪基本面、政策面和资金面，综合分析本基金的份额变动，做好债券与存款之间的配置，保持组合的较高流动性和安全性，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择机把握中高等级短融及存单的波段机会，适度提高组合的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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。

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间累计分配收益 176,030,288.96 元，其中人民币以红利再投资方式结转入实收基金。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富全额宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理

人—汇添富基金管理股份有限公司在汇添富全额宝货币市场基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富全额宝货币市场基金实施利润分配的金额为 176,030,288.96 元

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

由汇添富全额宝货币市场基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富全额宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,534,904,242.64	9,234,252,539.83
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,247,160,984.86	5,306,984,967.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,247,160,984.86	5,306,984,967.21
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	99,999,896.45
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	81,781,118.18	111,549,609.43
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,863,846,345.68	14,752,787,012.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		859,983,850.01	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,540,160.33	2,450,888.79
应付托管费		470,400.06	453,868.29
应付销售服务费		2,352,000.33	2,269,341.43
应付交易费用	6.4.7.7	49,873.79	76,466.35
应交税费		-	-
应付利息		55,631.30	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	248,424.42	329,300.00
负债合计		865,700,340.24	5,579,864.86
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	10,998,146,005.44	14,747,207,148.06
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		10,998,146,005.44	14,747,207,148.06
负债和所有者权益总计		11,863,846,345.68	14,752,787,012.92

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 10,998,146,005.44 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富全额宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		215,944,805.27	272,744,291.92
1.利息收入		208,473,646.96	255,166,495.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	134,631,486.91	179,883,915.32
债券利息收入		73,664,626.11	71,387,296.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		177,533.94	3,895,282.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,471,158.31	17,577,721.85
其中：股票投资收益		-	-

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	7,471,158.31	17,577,721.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
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）	6.4.7.15	-	74.99
减：二、费用		39,914,516.31	33,292,829.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,744,084.65	14,092,455.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,100,756.39	2,609,713.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	15,503,782.11	13,048,569.58
4. 交易费用		-	74.99
5. 利息支出		4,314,076.46	3,303,168.70
其中：卖出回购金融资产支出		4,314,076.46	3,303,168.70
6. 其他费用	6.4.7.16	251,816.70	238,847.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		176,030,288.96	239,451,462.25

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全额宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,747,207,148.06	-	14,747,207,148.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	176,030,288.96	176,030,288.96
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）	-3,749,061,142.62	-	-3,749,061,142.62
其中：1.基金申购款	27,496,283,060.25	-	27,496,283,060.25
2. 基金赎回款	-31,245,344,202.87	-	-31,245,344,202.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-176,030,288.96	-176,030,288.96

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	10,998,146,005.44	-	10,998,146,005.44
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,517,417,515.64	-	6,517,417,515.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	239,451,462.25	239,451,462.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,133,775,929.57	-	4,133,775,929.57
其中：1.基金申购款	32,704,843,938.44	-	32,704,843,938.44
2.基金赎回款	-28,571,068,008.87	-	-28,571,068,008.87
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）	-	-239,451,462.25	-239,451,462.25
五、期末所有者权益（基金净值）	10,651,193,445.21	0.00	10,651,193,445.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富全额宝货币市场基金(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[2013]1243号文《关于核准汇添富全额宝货币市场基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2013年12月10日至2013年12月11日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第60466941_B61号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年12月13日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的

实收基金（本金）为人民币 584,963,382.92 元，折合 584,963,382.92 份基金份额，募集资金在募集期间未产生利息。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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。；如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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改的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、营业税、增值税

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

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

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

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

2、企业所得税

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

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

3、个人所得税

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	9,904,242.64
定期存款	8,525,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	4,341,000,000.00
存款期限小于 1 个月	2,240,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	1,944,000,000.00
其他存款	-
合计：	8,534,904,242.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 6 月 30 日			
		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	3,247,160,984.86	3,254,047,000.00	6,886,015.14	0.0626%
	合计	3,247,160,984.86	3,254,047,000.00	6,886,015.14	0.0626%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	618.54
应收定期存款利息	50,175,931.29
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	31,469,801.68
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	134,766.67
合计	81,781,118.18

注：表中“其他”是应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	49,873.79
合计	49,873.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付审计费	29,835.26
应付信息披露费	209,289.16
应付上清所账户维护费	4,800.00
应付账户维护费	4,500.00
合计	248,424.42

6.4.7.9 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,747,207,148.06	14,747,207,148.06
本期申购	27,496,283,060.25	27,496,283,060.25
本期赎回(以“-”号填列)	-31,245,344,202.87	-31,245,344,202.87
本期末	10,998,146,005.44	10,998,146,005.44

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	176,030,288.96	-	176,030,288.96
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	-176,030,288.96	-	-176,030,288.96
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	134,569,001.94
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	134,631,486.91

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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6月30日
	卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,134,847,556.45
减：应收利息总额	87,643,071.10
买卖债券差价收入	7,471,158.31

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.15 其他收入

注：本基金本报告期末有其他收入。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	129,289.16
上海清算所帐户维护费	200.00
银行间划款费用	73,892.28
帐户维护费	18,600.00
合计	251,816.70

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

注：1、经本公司 2016 年第二次股东大会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准，本公司的股东文汇新民联合报业集团已变更为上海上报资产管理有限公司。本公司已于 2016 年 8 月 13 日就上述股东变更事项进行公告。

2、以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	16,744,084.65	14,092,455.19
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：在保本周期内，基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,100,756.39	2,609,713.95

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从

基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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 6 月 30 日
汇添富基金管理股份有限公司	15,503,782.11
合计	15,503,782.11

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 6 月 30 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	13,048,569.58	
合计	13,048,569.58	

注：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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金与关联方本期和上年度可比期间未通过银行间同业市场进行债券（回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	9,904,242.64	62,484.97	582,803.67	9,991.47

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2016 年 1 月 1 日至 2016 年 06 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 0 元，2016 年 06 月 30 日无结算备付金余额。2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 697.52 元，2015 年 6 月 30 日无结算备付金余额。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

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
176,030,288.96	-	-	176,030,288.96	-

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160209	16 国开 09	2016 年 7 月 1 日	99.82	2,500,000	249,553,566.75
120233	12 国开 33	2016 年 7 月 1 日	100.17	1,300,000	130,227,270.55
150416	15 农发 16	2016 年 7 月 1 日	100.01	150,000	15,001,442.25
160211	16 国开 11	2016 年 7 月 1 日	99.97	395,000	39,487,219.51
120227	12 国开 27	2016 年 7 月 1 日	99.29	300,000	29,788,147.37
111691519	16 广州农村商业银行 CD017	2016 年 7 月 1 日	99.40	1,000,000	99,400,118.42
041656013	16 青国投 CP002	2016 年 7 月 1 日	99.94	40,000	3,997,487.74
111692033	16 华融湘江银行 CD021	2016 年 7 月 1 日	99.16	1,000,000	99,155,616.66

041656013	16 青国投 CP002	2016 年 7 月 1 日	99.94	606,000	60,561,939.31
041663004	16 首 钢 CP002	2016 年 7 月 1 日	99.25	1,300,000	129,029,252.45
041656013	16 青国投 CP002	2016 年 7 月 1 日	99.94	114,000	11,392,840.07
合计				8,705,000	867,594,901.08

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；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：
 - A. 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；
 - B. 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)。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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	1,004,240,000.00	2,513,059,028.20
A-1 以下	-	-
未评级	2,089,478,000.00	2,764,399,382.81
合计	3,093,718,000.00	5,277,458,411.01

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	160,329,000.00	29,526,556.20
合计	160,329,000.00	29,526,556.20

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,249,904,242.64	4,341,000,000.00	1,944,000,000.00	-	-	-	8,534,904,242.64
交易性金融资产	400,215,021.42	1,106,608,447.49	1,740,337,515.95	-	-	-	3,247,160,984.86
应收利息	-	-	-	-	-	81,781,118.18	81,781,118.18
资产总计	2,650,119,264.06	5,447,608,447.49	3,684,337,515.95	-	-	81,781,118.18	11,863,846,345.68
负债							
卖出回购金融资产款	859,983,850.01	-	-	-	-	-	859,983,850.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,540,160.33	2,540,160.33
应付托管费	-	-	-	-	-	470,400.06	470,400.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,352,000.33	2,352,000.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	49,873.79	49,873.79
应付利息	-	-	-	-	-	55,631.30	55,631.30
其他负债	-	-	-	-	-	248,424.42	248,424.42
负债总计	859,983,850.01	-	-	-	-	5,716,490.23	865,700,340.24
利率敏感度缺口	1,790,135,414.05	5,447,608,447.49	3,684,337,515.95	-	-	76,064,627.95	10,998,146,005.44
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	3,112,252,539.83	3,291,000,000.00	2,831,000,000.00	-	-	-	9,234,252,539.83
交易性金融资产	360,048,984.76	1,395,206,184.57	3,551,729,797.88	-	-	-	5,306,984,967.21
买入返售金融资产	99,999,896.45	-	-	-	-	-	99,999,896.45
应收利息	-	-	-	-	-	111,549,609.43	111,549,609.43
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	3,572,301,421.04	4,686,206,184.57	6,382,729,797.88	-	-	111,549,609.43	14,752,787,012.92
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,450,888.79	2,450,888.79
应付托管费	-	-	-	-	-	453,868.29	453,868.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,269,341.43	2,269,341.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	76,466.35	76,466.35
其他负债	-	-	-	-	-	329,300.00	329,300.00

负债总计	-	-	-	-	-	5,579,864.86	5,579,864.86
利率敏感度缺口	3,572,301,421.04	4,686,206,184.57	6,382,729,797.88	-	-	-105,969,744.57	14,747,207,148.06

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款和结算备付金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，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 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	0.25%	-3,508,048.36	-2,888,033.59
	-0.25%	3,515,988.19	2,900,152.76

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	3,247,160,984.86	27.37
	其中：债券	3,247,160,984.86	27.37
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	8,534,904,242.64	71.94
4	其他各项资产	81,781,118.18	0.69
5	合计	11,863,846,345.68	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.28	
	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	859,983,850.01	7.82
	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	81

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	13.91	7.82

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)□ 60 天	14.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)□ 90 天	22.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)□ 120 天	18.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.27	-
5	120 天(含)□ 397 天(含)	35.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		107.13	7.82

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	749,546,508.61	6.82
	其中：政策性金融债	749,546,508.61	6.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,518,472,112.92	13.81
6	中期票据	-	-
7	同业存单	979,142,363.33	8.90
8	其他	-	-
9	合计	3,247,160,984.86	29.52
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	29,788,147.37	0.27

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	160209	16 国开 09	2,500,000	249,553,566.75	2.27

2	150416	15 农发 16	2,000,000	200,019,229.95	1.82
3	120233	12 国开 33	1,300,000	130,227,270.55	1.18
4	041663004	16 首钢 CP002	1,300,000	129,029,252.45	1.17
5	041557003	15 华邦颖泰 CP001	1,000,000	99,992,665.09	0.91
6	041578002	15 宿迁经开 CP001	1,000,000	99,983,164.01	0.91
7	111691475	16 青岛农商行 CD014	1,000,000	99,415,080.98	0.90
8	111691519	16 广州农村商业银行 CD017	1,000,000	99,400,118.42	0.90
9	111691983	16 九江银行 CD019	1,000,000	99,264,702.98	0.90
10	111694845	16 营口银行 CD001	1,000,000	99,249,272.84	0.90

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1615%
报告期内偏离度的最低值	0.0563%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0923%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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

7.9.2

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

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	81,781,118.18
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	81,781,118.18

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
5,240,601	2,098.64	60,177,968.77	0.55%	10,937,968,036.67	99.45%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	605,650.25	0.0055%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 13 日）基金份额总额	584,963,382.92
本报告期期初基金份额总额	14,747,207,148.06
本报告期基金总申购份额	27,496,283,060.25
减：本报告期基金总赎回份额	31,245,344,202.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	10,998,146,005.44

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

3、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 11 日正式生效，何旻先生和李怀定先生任该基金的基金经理。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

16、本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

以上 2 个交易单元与汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金联接基金共用。本基金本报告期末新增或退租交易单元。

10.8 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。

10.9 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	管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于调整指数熔断机制下的基金申购与赎回开放时间的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 上交所, 深交所	2016 年 1 月 4 日
4	汇添富全额宝货币市场基金更新招募说明书及摘要 (2015 年第 2 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 1 月 16 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 3 月 16 日
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)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 4 月 2 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富全额宝货币市场基金募集的文件；
- 2、《汇添富全额宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《汇添富全额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、报告期内汇添富全额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。

11.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼汇添富基金管理股份有限公司

11.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司
2016 年 8 月 27 日