

# 汇添富理财 60 天债券型证券投资基金 2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 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 2012 年 6 月 12 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
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.....	43
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
8.5 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.....	44
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	45
8.7 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.....	45
8.8 投资组合报告附注.....	45
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>45</b>
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 .....	46
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
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 .....	48
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	49
11.9 其他重大事件 .....	49
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
13.1 备查文件目录 .....	53
13.2 存放地点 .....	53
13.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富理财 60 天债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富理财 60 天债券	
基金主代码	470060	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 6 月 12 日	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,076,461,281.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富理财 60 天债券 A	汇添富理财 60 天债券 B
下属分级基金的交易代码:	470060	471060
报告期末下属分级基金的份额总额	1,070,863,023.04 份	5,598,258.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在 180 天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。

### 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	汇添富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	010-67595096
传真	021-28932998	010-66275853
注册地址	上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码	200120	100033

法定代表人	潘鑫军	王洪章
-------	-----	-----

## 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	2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日	
	汇添富理财 60 天债券 A	汇添富理财 60 天债券 B
本期已实现收益	109,776,335.12	5,455,019.97
本期利润	109,776,335.12	5,455,019.97
本期净值收益率	1.77%	1.94%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	
期末基金资产净值	1,070,863,023.04	5,598,258.68
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	
累计净值收益率	1.77%	1.94%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 6 月 12 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 2012 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 3.2 基金表现

#### 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

汇添富理财 60 天债券 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	0.8854%	0.0030%	0.3393%	0.0000%	0.5461%	0.0030%
过去六个月	1.6238%	0.0024%	0.6792%	0.0000%	0.9446%	0.0024%
自基金合同 生效日起至 今	1.7722%	0.0023%	0.7514%	0.0000%	1.0208%	0.0023%

注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。

2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

3、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 6 月 12 日，至本报告期末未满一年。

汇添富理财 60 天债券 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	0.9596%	0.0030%	0.3393%	0.0000%	0.6203%	0.0030%
过去六个月	1.7746%	0.0024%	0.6792%	0.0000%	1.0954%	0.0024%
自基金合同 生效日起至 今	1.9376%	0.0023%	0.7514%	0.0000%	1.1862%	0.0023%

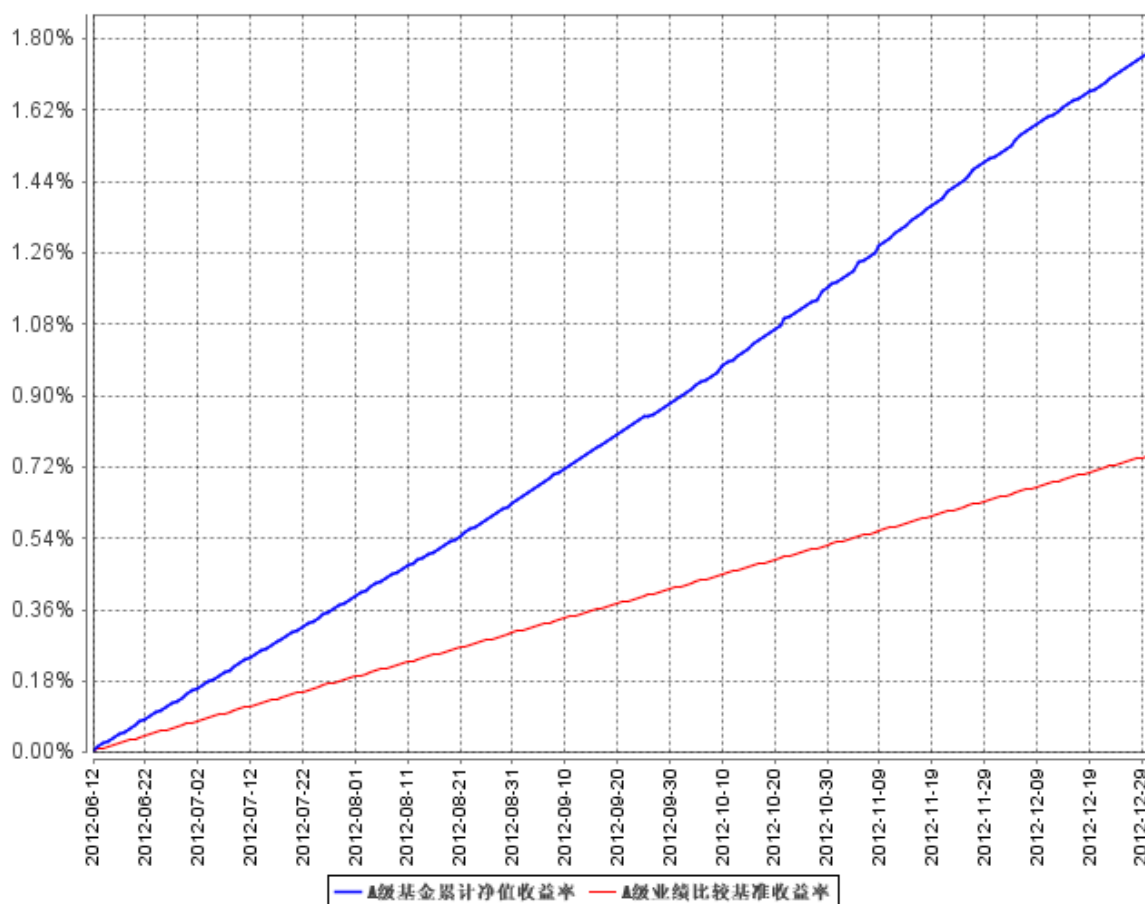
注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。

2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

3、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 6 月 12 日，至本报告期末未满一年。

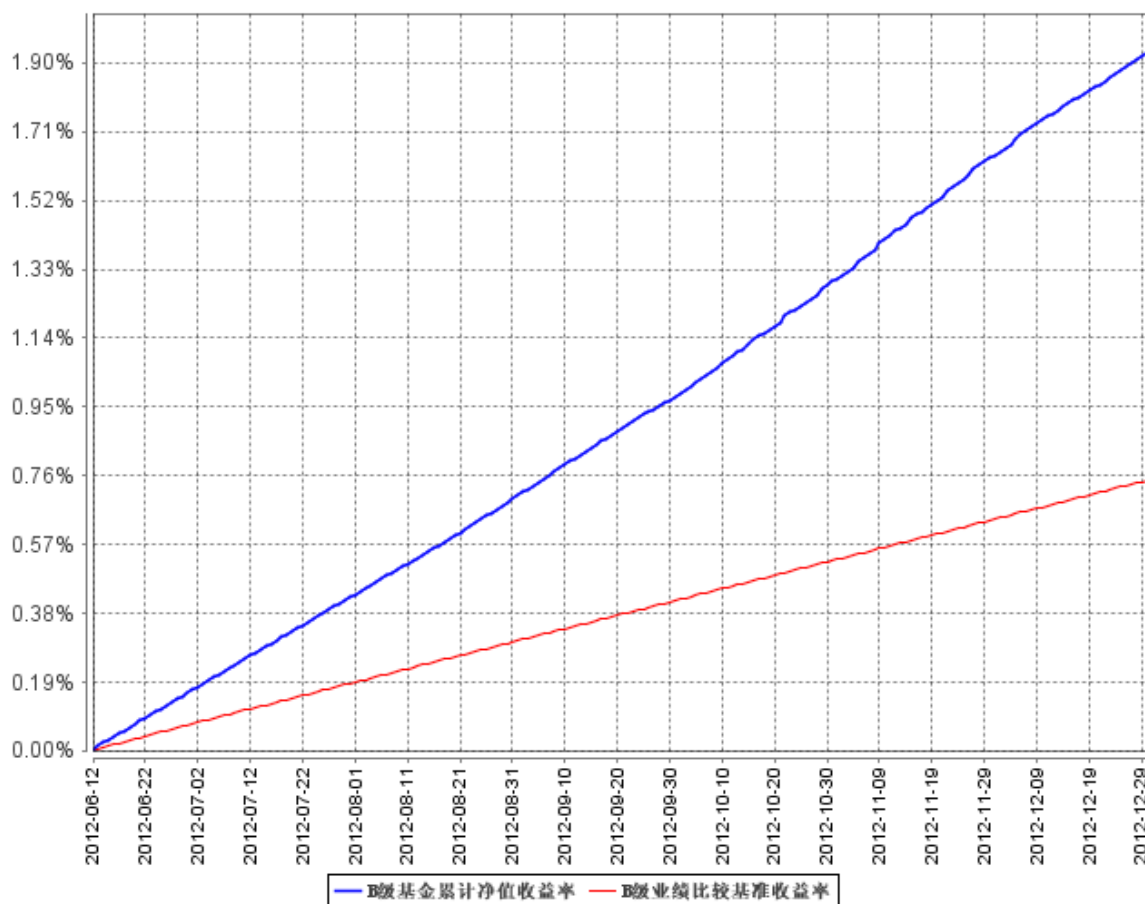
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级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**





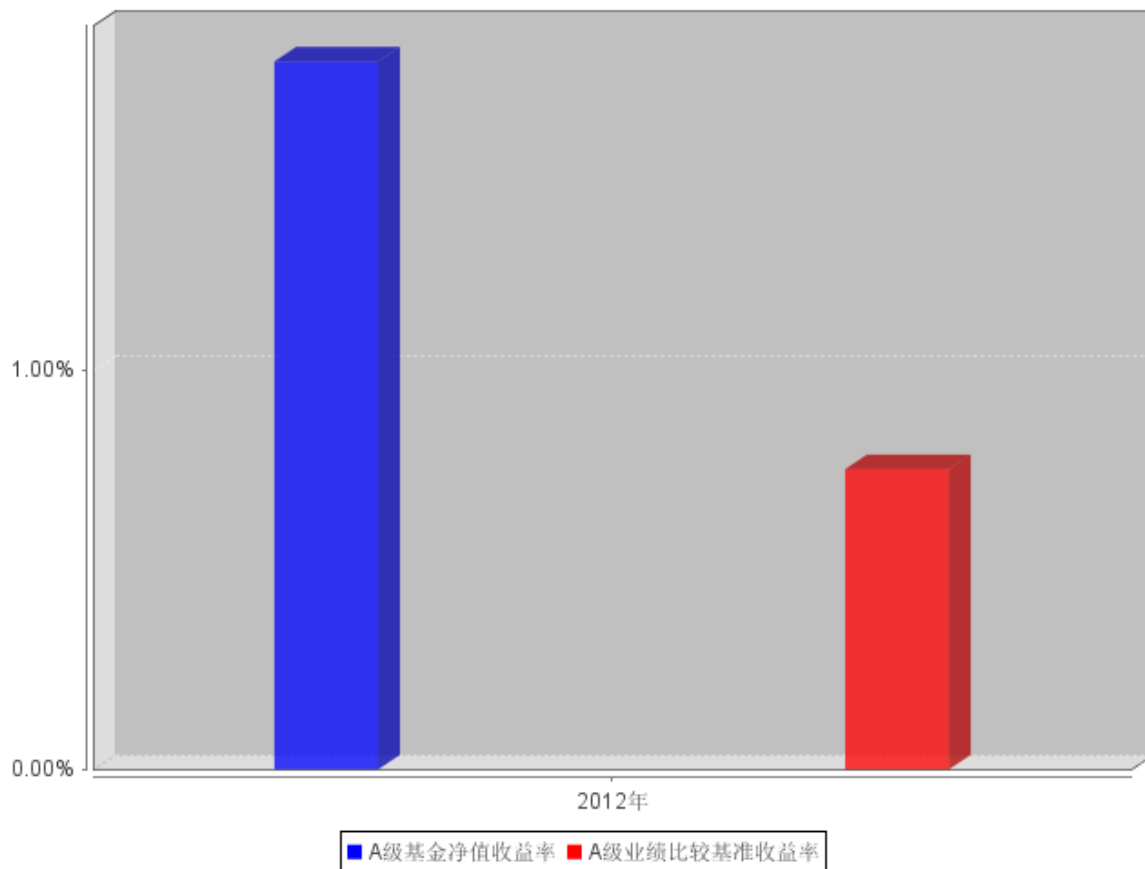
**B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



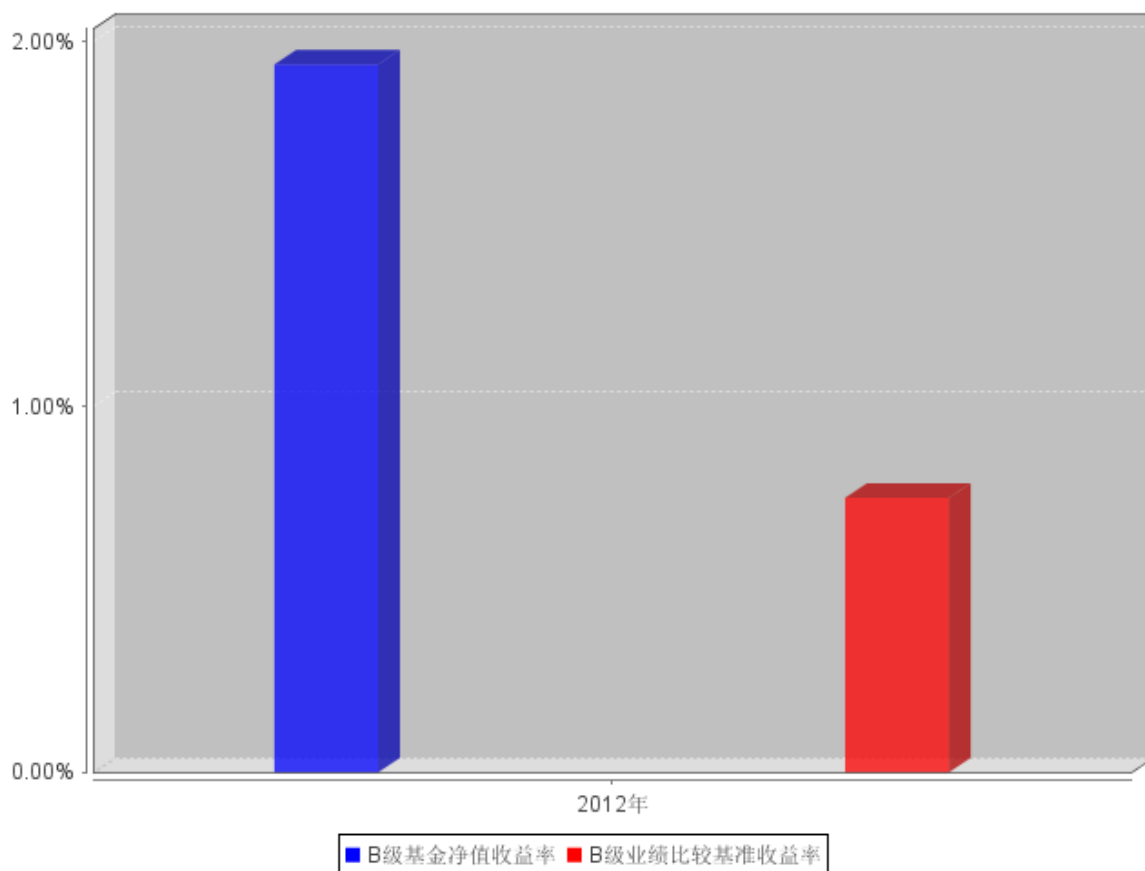
注：本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 6 月 12 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2012 年 6 月 12 日）起五日，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

**A级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**



**B级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、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 6 月 12 日，至本报告期末未满五年。  
 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

汇添富理财 60 天债券 A					
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
2012	34,166,517.33	73,546,412.44	2,063,405.35	109,776,335.12	
合计	34,166,517.33	73,546,412.44	2,063,405.35	109,776,335.12	
汇添富理财 60 天债券 B					
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
2012	732,798.67	4,712,394.71	9,826.59	5,455,019.97	
合计	732,798.67	4,712,394.71	9,826.59	5,455,019.97	

## § 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、南方两个分公司，以及全资子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)。

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。在投资管理领域，汇添富已形成公募、专户、国际、养老金四大块业务以及股票、固定收益、被动投资、海外投资、另类投资五大块投资领域协同发展的格局。

截止 2012 年末，汇添富共管理 27 只证券投资基金，涵盖股票、指数、QDII、债券、货币市场基金等不同风险收益特征的产品。报告期内，汇添富共发行八只基金产品，包括国内首创的系列短期理财基金——汇添富理财 30 天、60 天、14 天、28 天债券基金，国内首只实施场内实时申赎的货币基金——汇添富收益快线货币基金，以及汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富多元收益债券基金、汇添富逆向投资股票基金。

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。2012 年, 汇添富取得优秀的投资业绩, 在市场震荡起伏的背景下, 公司旗下基金均获得正收益, 切实为投资者赢得财富增长。

2012 年, 汇添富专户业务快速发展, 不仅开发出债券分级、大宗交易、期货对冲等专户产品, 并且投资业绩持续表现优秀。公司获得《每日经济新闻》针对非公募及创新业务评选的“最佳口碑基金公司”、“最佳口碑产品”、“最佳创新产品”三项大奖。

2012 年, 汇添富国际业务取得突破进展, 不仅成功发行 RQFII 产品——汇添富人民币债券基金, 并且与巴西证券交易所就指数等方面的业务合作签订了《合作备忘录》, 成为国内首家与巴西证券交易所开展全面合作的资产管理公司。

2012 年, 汇添富电子商务业务实现跨越式发展。公司推出的“添富信用卡”在行业内率先实现货币基金的支付功能, 获得 2011 年度上海金融创新成果一等奖; 10 月, 公司在行业首家推出网上直销货币基金 T+0 赎回业务, 极大地提升货币基金的理财便捷性。

2012 年, 汇添富持续开展贴心的投资者服务与教育工作。公司围绕向“现代财富管理机构”

转型的思路，从不同类型客户的切身需求出发，大力建设投顾式客户服务体系；同时，公司进一步着力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2012 年，汇添富社会责任事业进一步深入开展。“河流·孩子”助学计划启动第五季活动，公司公益基金会捐资在贵州建设“古邦添富小学”；邀请客户、员工及员工家属参加“红色希望之旅”活动，先后走进甘肃大夏河、四川美姑、云南怒江的“添富小学”，开办“梦想课堂”，捐赠图书和设备；为优秀乡村教师提供国内外知名教育机构的师资培训。同时，汇添富还着力开展医疗救助、结对帮扶、国防拥军等社会公益活动。凭借慈善公益事业上的长期坚持和突出贡献，2012 年 4 月，汇添富基金荣获第二届上海慈善表彰大会颁发的“上海慈善奖爱心捐赠企业”奖，成为唯一一家获奖的基金管理公司。

展望 2013 年，新的《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规的颁布实施，将对中国基金业产生深远的影响，行业转型发展的大变革将进一步深化，整个财富管理行业进入大混业竞争时代。汇添富基金将始终保持积极的心态，大力创新、锐意进取，积极把握机会，切实以“客户至上，做好优质服务”为己任，推动各项业务战略布局有效落实，为中国基金业的繁荣发展做出积极贡献。

#### 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		
曾刚	本基金的基金经理，汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理，汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，汇添富理财 28 天债券型	2012 年 6 月 12 日	-	11 年	国籍：中国，1971 年出生，中国科技大学学士，清华大学 MBA。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在红塔证券自营业务总部、

	<p>证券投资 基金。</p>			<p>汉唐证券 债券业务 总部、华 宝兴业基 基金管理有 限公司研 究部负责 宏观经济 和债券的 研究、上 海电气集 团财务有 限责任公 司资产管 理部任经 理助理， 2008 年 5 月 15 日至 2010 年 2 月 5 日任 华富基金 管理有限 公司华富 货币基金 的基金经 理、2008 年 5 月 28 日至 2011 年 11 月 1 日任华富 收益增强 债券基金 的基金经 理、2010 年 9 月 8 日至 2011 年 11 月 1 日任华富 强化回报 债券基金 的基金经 理。2011 年 11 月加 入汇添富 基金管理</p>
--	---------------------	--	--	---

					有 限 公 司，任金融工程部高级经理。2012 年 5 月 9 日至今任汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理，2012 年 6 月 12 日至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，2012 年 9 月 18 日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，2012 年 10 月 18 日至今任汇添富理财 28 天债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、投资交易监控周报、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。当发生风格相似或同一投资经理管理的投资组合之间业绩表现差异超过 5%等情形时，将进行专项分析。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集中交易室、投资研究部、稽核监察部和金融工程部组成，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，对其进行了 95% 的置信区间，假设差价为 0 的分布检验以及差价率均值的分析。分析结果表明，不同时间窗口下，公司各组合间买卖价差不显著，差价率均值小于 1%。

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 2 次，分别是由于指数基金根据标的指数成份股调整而被动调仓、专户组合到期清算卖出证券所致。

## 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

2012 年是纷乱的一年，欧债危机的影响逐渐减弱、美国财政悬崖得到化解，量化宽松再次推进，全球经济逐步走出谷底。对于中国而言，外需疲软、出口不畅，楼市高烧，继续严控，上一轮刺激带来的低效基建与产能再过剩，都逼迫我们要转型升级，中央也表态能接受较低的 GDP，转而提高增长的质量。从数据来看，GDP 增速下滑至 3 季度的 7.7 之后企稳，CPI 从 1 月的跌至 10 月的 1.7，微观调研表明部分实体企业面临的困境甚至超过 08-09 年，对经济的担忧一直延续到 3 季度后期。十八大之后，对经济的预期逐步回升，出口、PMI、融资等数据也给以正面的支持。

2012 年利率债和高等级信用债的波幅不大，但中低评级信用债走势强劲，呈现上半年慢牛，三季度小幅调整但四季度重现转暖势头的整体节奏。上半年资金面中性，关键节点仍有压力，下半年资金面有改善；2012 年央行分别降准降息 2 次，但更核心的是启动了利率市场化的进程，扩大了基准的上下浮动区间，随后以持续逆回购为主，意在推出市场化的基准；银行理财产品等机

构新增债券需求对于四季度债市走暖提供了支持。

本基金成立于 6 月 12 日，主要投资于协议存款和短融，初始建仓期恰逢 3 季度债市的调整，同时协议存款利率相对于上半年也大幅回落，规模变动进一步带来投资上的困难，本基金前期业绩不理想，4 季度后，借助市场的回暖和特定时点上存款利率的走高，本基金的收益有所提升。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 级本期净值收益率为 1.7722%，B 级本期净值收益率为 1.9376%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年预计全球经济进一步复苏，货币政策保持宽松；而对于国内，新型城镇化需要多方面的政策放松来落实，户籍、教育、就业等多方面都是需要魄力去突破的难点，此外资金不足也会限制经济回升的进度，整体上我们认为中国经济确已见底企稳，但潜在增长率已经下台阶，GDP 增速保持在 8% 附近就是成绩，我们对 CPI 的预期偏中性，全年的运行区间大体在 2.5-3.6%，高点在 3 季度；对经济的有限乐观判断下，债市的整体风险不大，但货币政策可能只有 2-3 次降准的预期，目前的债市已处于中性区间，机会同样有限。2013 年即将还本的信用债及信托总量都达到新的高点，信用风险事件可能接近暴露的边缘，信用利差扩大的趋势明确，有必要重视并早作安排。

我们将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。本基金的组合流动性管理特征不同于普通货币基金，在总结前期经验教训的基础上，我们将更加明确地注重流动性，做好份额变动的分析和预测，合理搭配协存、短融、浮息债等品种，力争提高组合收益。

#### 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

本基金《基金合同》约定：本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

本基金 2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日期间累计分配收益 115,231,355.09 元，其中人民币 34,899,316.00 元以红利再投资方式结转入实收基金，人民币 78,258,807.15 元因基金赎回而支付给投资者，其余人民币 2,073,231.94 元为期末应付收益。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，汇添富理财 60 天债券 A 级实施利润分配的金额为 109,776,335.12 元；汇添富理财 60 天债券 B 级实施利润分配的金额为 5,455,019.97 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富理财 60 天债券型证券投资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理财 60 天债券型证券投资基金的

	财务报表, 包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年 6 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日止期间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汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理有限公司的责任。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, 公允反映了汇添富理财 60 天债券型证券投资基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	徐艳 方侃
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	2013 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 汇添富理财 60 天债券型证券投资基金

报告截止日: 2012 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	491,096,625.31
结算备付金		399,210.26
存出保证金		250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	673,314,885.60
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		659,314,885.60
资产支持证券投资		14,000,000.00
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	14,619,472.12
应收股利		-
应收申购款		218,011.05
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,179,898,204.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		99,989,650.01
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		353,256.02
应付托管费		104,668.47
应付销售服务费		379,926.05
应付交易费用	7.4.7.7	16,178.29
应交税费		-
应付利息		101,011.84
应付利润		2,073,231.94
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	419,000.00
负债合计		103,436,922.62
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,076,461,281.72
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		1,076,461,281.72
负债和所有者权益总计		1,179,898,204.34

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 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,076,461,281.72 份，其中，A 级份额 1,070,863,023.04 份，B 级份额 5,598,258.68 份。

3、本基金合同于 2012 年 6 月 12 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2012 年 12 月 31 日数据，特此说明。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富理财 60 天债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		142,338,382.43
1.利息收入		140,921,461.45
其中：存款利息收入	7.4.7.11	123,403,396.30
债券利息收入		16,049,536.67
资产支持证券利息收入		47,254.80
买入返售金融资产收入		1,421,273.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,416,920.98
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.12	1,416,920.98
资产支持证券投资收益		-
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）	7.4.7.13	-
<b>减：二、费用</b>		27,107,027.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,526,977.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,119,104.40
3. 销售服务费		11,199,736.01
4. 交易费用		-
5. 利息支出		1,886,322.98
其中：卖出回购金融资产支出		1,886,322.98
6. 其他费用	7.4.7.14	374,886.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		<b>115,231,355.09</b>

号填列)		
------	--	--

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、本基金合同于 2012 年 6 月 12 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示从基金合同生效日至 2012 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富理财 60 天债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 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）	16,058,360,378.00	-	16,058,360,378.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	115,231,355.09	115,231,355.09
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）	-14,981,899,096.28	-	-14,981,899,096.28
其中：1. 基金申购款	1,141,440,663.22	-	1,141,440,663.22
2. 基金赎回款	-16,123,339,759.50	-	-16,123,339,759.50
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）	-	-115,231,355.09	-115,231,355.09
五、期末所有者权益（基金净值）	1,076,461,281.72	-	1,076,461,281.72

注：本基金于 2012 年 6 月 12 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示从基金合同生效日至 2012 年 12 月 31 日数据，特此说明。

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：

林利军  
基金管理人负责人

陈灿辉  
主管会计工作负责人

王小练  
会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富理财 60 天债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]557 号文《关于核准汇添富理财 60 天债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理有限公司作为发起人于 2012 年 5 月 28 日至 2012 年 6 月 8 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 60466941\_B03 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 2012 年 6 月 12 日生效。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 16,052,788,278.16 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 5,572,099.84 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 16,058,360,378.00 元，折合 16,058,360,378.00 份基金份额。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有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据、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、短期融资券及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。本基金采用积极管理型的投资策略，原则上将投资组合的平均剩余期限控制在 180 天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

### 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 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，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制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间系 2012 年 6 月 12 日（基金合同生效日）起至 2012 年 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。

### (3) 资产支持证券投资

买入资产支持证券于成交日确认为资产支持证券投资；

卖出资产支持证券于成交日确认资产支持证券投资收益，卖出资产支持证券的成本按移动加权平均法结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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) 资产支持证券投资

(1) 在交易所交易的资产支持证券，以成本列示，按票面利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 在全国银行间债券市场交易的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

##### 5) 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。

#### 7.4.4.6 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。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账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，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) 资产支持证券投资收益于卖出资产支持证券成交日确认，并按卖出资产支持证券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(6) 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%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率逐日计提；

(3) 对于A类基金份额基金销售服务费，按前一日基金资产净值的0.30%的年费率逐日计提，对于B类基金份额基金销售服务费，按前一日基金资产净值的0.01%的年费率逐日计提；

(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) 基金收益分配采用红利再投资方式；

(2) 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(3) 本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后2位；

(4) 本基金根据每日收益情况，按当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配，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。若投资者在运作期期末累计收益支付时，累计收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。投资者可通过在基金份额运作期到期日赎回基金份额可获得自申购确认日（认购份额自本基金合同生效日）起至上一运作期期末的基金收益、加上当期运作期的基金未支付收益；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 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、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。

### 7.4.6.2 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。

## 7.4.7 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 2012年12月31日
活期存款	1,096,625.31
定期存款	490,000,000.00

其中：存款期限 1-3 个月	290,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	200,000,000.00
其他存款	-
合计：	491,096,625.31

### 7.4.7.2 交易性金融资产

金额单位：人民币元

项目		本期末 2012 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	30,288,950.42	30,138,000.00	-150,950.42	-0.01%
	银行间市场	629,025,935.18	628,270,000.00	-755,935.18	-0.07%
资产支持证券		14,000,000.00	14,000,000.00	0.00	0.00%
合计		673,314,885.60	672,408,000.00	-906,885.60	-0.08%

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。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,382.66
应收定期存款利息	5,636,501.96
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	197.56
应收债券利息	8,933,130.89

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.25
其他	47,254.80
合计	14,619,472.12

注：表中“其他”为应收资产支持证券利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012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	16,178.29
合计	16,178.29

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	-
预提审计费	80,000.00
预提信息披露费	80,000.00
预提中债登账户维护费	4,500.00
预提上清所账户维护费	4,500.00
合计	419,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富理财 60 天债券 A		
项目	本期 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	15,633,627,117.41	15,633,627,117.41
本期申购	698,311,615.86	698,311,615.86
本期赎回(以“-”号填列)	-15,261,075,710.23	-15,261,075,710.23
本期末	1,070,863,023.04	1,070,863,023.04



汇添富理财 60 天债券 B		
项目	本期 2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	424,733,260.59	424,733,260.59
本期申购	443,129,047.36	443,129,047.36
本期赎回(以“-”号填列)	-862,264,049.27	-862,264,049.27
本期末	5,598,258.68	5,598,258.68

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2012 年 6 月 12 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)人民币 16,052,788,278.16 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 5,572,099.84 元，以上实收基金(本息)合计人民币 16,058,360,378.00 元，折合 16,058,360,378.00 份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富理财 60 天债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	109,776,335.12	-	109,776,335.12
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	-109,776,335.12	-	-109,776,335.12
本期末	-	-	-

汇添富理财 60 天债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,455,019.97	-	5,455,019.97
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	-5,455,019.97	-	-5,455,019.97
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日
活期存款利息收入	647,966.97
定期存款利息收入	122,713,540.61
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	41,548.67
其他	340.05
合计	123,403,396.30

注：“其他”为直销申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,075,817,130.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,051,818,130.00
减：应收利息总额	22,582,079.85
债券投资收益	1,416,920.98

#### 7.4.7.13 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 7.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	240,000.00
其他费用	900.00
银行间划款费用	35,986.31
帐户维护费	18,000.00
合计	374,886.31

注：表中“其他费用”为开户费。

### 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，本基金无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
中国建设银行股份有限公司	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
东航金控控股有限责任公司	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

### 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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	30,420,205.11	100.00%

##### 7.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	6,253,800,000.00	100.00%

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期未有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
	2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,526,977.64
其中：支付销售机构的客户维护费	3,687,510.58

注：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：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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、休息日等，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
	2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,119,104.40

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富理财 60 天债券 A	汇添富理财 60 天债券 B	合计
汇添富基金管理有限公司	15,458.46	1,033.20	16,491.66

中国建设银行股份有限公司	10,908,500.64	15,926.82	10,924,427.46
东方证券股份有限公司	3,675.99	-	3,675.99
合计	10,927,635.09	16,960.02	10,944,595.11

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。

本基金各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，A 类基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率计提；B 类基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

R 为该类基金份额的销售服务费率

各类基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户。由注册登记机构分别支付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 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

单位：人民币元

本期 2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 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
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-	183,800,000.00	12,429.41

#### 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

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

##### 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 2012 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,096,625.31	647,966.97

#### 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：本基金本报告期末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

##### 7.4.11.1 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 汇添富理财60天债券A

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
34,166,517.33	73,546,412.44	2,063,405.35	109,776,335.12	-

##### 汇添富理财60天债券B

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
732,798.67	4,712,394.71	9,826.59	5,455,019.97	-

#### 7.4.12 期末（2012 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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证券款余额 99,989,650.01 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
041260036	12 陕煤化 CP001	2013 年 1 月 7 日	99.99	400,000	39,994,743.14
041253037	12 联通 CP001	2013 年 1 月 7 日	100.03	110,000	11,002,884.32
041258040	12 中交建 CP002	2013 年 1 月 7 日	100.00	500,000	49,999,758.05
合计				1,010,000	100,997,385.51

#### 7.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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金融资产款余额。

#### 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:
  - 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。

##### 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 2012 年 12 月 31 日
A-1	430,109,596.87
A-1 以下	
未评级	29,660,446.12
合计	459,770,042.99

#### 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 2012 年 12 月 31 日
AAA	30,288,950.42
AAA 以下	
未评级	169,255,892.19
合计	199,544,842.61

#### 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、企业债及短期融资券等，均在证券交易所上市或可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，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 2012 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	41,096,625.31	250,000,000.00	200,000,000.00	-	-	-	491,096,625.31
结算备付金	399,210.26	-	-	-	-	-	399,210.26
存出保证金	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	39,478,728.14	99,530,401.00	504,645,310.34	-	-	-29,660,446.12	673,314,885.60
应收利息	-	-	-	-	-	-14,619,472.12	14,619,472.12
应收申购款	22,511.05	-	-	-	-	195,500.00	218,011.05
资产总计	80,997,074.76	349,530,401.00	704,645,310.34	-	-	-44,725,418.24	1,179,898,204.34
负债							
卖出回购金融资产款	99,989,650.01	-	-	-	-	-	99,989,650.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	353,256.02	353,256.02
应付托管费	-	-	-	-	-	104,668.47	104,668.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	379,926.05	379,926.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,178.29	16,178.29
应付利息	-	-	-	-	-	101,011.84	101,011.84
应付利润	-	-	-	-	-	-2,073,231.94	2,073,231.94
其他负债	-	-	-	-	-	419,000.00	419,000.00
负债总计	99,989,650.01	-	-	-	-	-3,447,272.61	103,436,922.62
利率敏感度缺口	-18,992,575.25	349,530,401.00	704,645,310.34	-	-	-41,278,145.63	1,076,461,281.72

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。

### 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、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变

	动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；	
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（2012年12月31日）
	0.25%	-694,604.87
	-0.25%	696,337.87

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	673,314,885.60	57.07
	其中：债券	659,314,885.60	55.88
	资产支持证券	14,000,000.00	1.19
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	491,495,835.57	41.66
4	其他各项资产	15,087,483.17	1.28
5	合计	1,179,898,204.34	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	3.38	
	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	99,989,650.01	9.29
	其中：买断式回购融资	-	-

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个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：本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

## 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	137
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	161
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

### 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	7.55	9.29
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.67	-
2	30 天(含)—60 天	23.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	9.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.25	-
4	90 天(含)—180 天	35.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	32.94	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.23	9.29

### 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	198,916,338.31	18.48
	其中：政策性金融债	198,916,338.31	18.48
4	企业债券	30,288,950.42	2.81
5	企业短期融资券	430,109,596.87	39.96
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	659,314,885.60	61.25
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	139,009,129.14	12.91

### 8.5 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	120227	12 国开 27	1,000,000	99,530,401.00	9.25
2	041253037	12 联通 CP001	700,000	70,018,354.74	6.50
3	041258040	12 中交建 CP002	500,000	49,999,758.05	4.64
4	041260036	12 陕煤化 CP001	500,000	49,993,428.93	4.64
5	041272002	12 富邦 CP001	400,000	39,976,267.67	3.71
6	120233	12 国开 33	400,000	39,478,728.14	3.67
7	122092	11 大秦 01	300,000	30,288,950.42	2.81
8	080210	08 国开 10	300,000	30,246,763.05	2.81
9	120320	12 进出 20	300,000	29,660,446.12	2.76
10	041262021	12 伟星 CP001	200,000	20,044,174.01	1.86

### 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.00%
报告期内偏离度的最低值	-0.13%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.05%

### 8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	119023	侨城 01	140,000.00	14,000,000.00	1.30

### 8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 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。

8.8.3 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、处罚的情形。

#### 8.8.4 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	14,619,472.12
4	应收申购款	218,011.05
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,087,483.17

## § 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富理财 60 天债券 A	11,658	91,856.50	1,327,861.37	0.12%	1,069,535,161.67	99.88%
汇添富理财 60 天债券 B	1	5,598,258.68	-	-	5,598,258.68	100.00%
合计	11,659	92,328.78	1,327,861.37	0.12%	1,075,133,420.35	99.88%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	汇添富理财 60 天债券 A	2,033.01	0.0002%
	汇添富理财 60 天债券 B	-	-
	合计	2,033.01	0.0002%

注：1) 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2) 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	汇添富理财 60 天债券 A	汇添富理财 60 天债券 B
基金合同生效日(2012 年 6 月 12 日)基金份额总额	15,633,627,117.41	424,733,260.59
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	698,311,615.86	443,129,047.36
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	15,261,075,710.23	862,264,049.27
本报告期期末基金份额总额	1,070,863,023.04	5,598,258.68

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

### 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 2012 年 3 月 3 日公告，增聘周睿先生担任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理。

2、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘韩贤旺先生、叶从飞先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，陈晓翔先生、欧阳沁春先生不再担任该基金的基金经理。

3、《汇添富逆向投资股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 9 日正式生效，顾耀强先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2012 年 3 月 14 日公告，经汇添富基金管理有限公司第三届董事会第一次会议决议，并经中国证监会审核批准（证监许可【2012】297 号），公司聘任雷继明先生为公司副总经理。

5、《汇添富理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 9 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2012 年 6 月 7 日公告，经汇添富基金管理有限公司 2012 年第一次临时股东会决议，并经中国证监会审核批准（证监许可【2012】757 号），公司董事会选举潘鑫军先生为公司董事长，桂水发先生不再担任本公司的董事长。

7、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 12 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

8、《汇添富理财 14 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 10 日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 26 日正式生效，陆文磊先生任该基金的基金经理。

10、《汇添富多元收益债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 18 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

11、《汇添富理财 28 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 10 月 18 日正式生效，曾

刚先生任该基金的基金经理。

12、基金管理人 2012 年 11 月 2 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理，刘子龙先生不再担任该基金的基金经理；同时，刘子龙先生也不再担任汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的基金经理，王致人先生继续担任该基金的基金经理。

13、《汇添富收益快线货币市场基金基金合同》于 2012 年 12 月 21 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

14、2012 年 11 月 15 日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2012）961 号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2012）1036 号）。

### 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

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（2012 年 6 月 12 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币捌万元整。

### 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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 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	30,420,205.11	100%	6,253,800,000.00	100%	-	-

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 个交易单元均为本基金本报告期内新增交易单元：东方证券（上交所交易单元、深交所交易单元）。

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本期未发生偏离度绝对值超过 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	汇添富理财 60 天债券型证券投资	中国证券报、上海证券报、证券	2012 年 5 月 25 日

	资基金基金份额发售公告	时报、管理人网站	
2	汇添富理财 60 天债券型证券投资 基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 5 月 25 日
3	汇添富理财 60 天债券型证券投资 基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 5 月 25 日
4	汇添富理财 60 天债券型证券投资 基金基金合同	管理人网站	2012 年 5 月 25 日
5	汇添富理财 60 天债券型证券投资 基金托管协议	管理人网站	2012 年 5 月 25 日
6	关于汇添富理财 60 天债券型证 券投资基金增加上海银行为代 销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 5 月 28 日
7	关于汇添富理财 60 天债券型证 券投资基金增加兴业银行为代 销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 5 月 29 日
8	汇添富基金管理有限公司关于 旗下部分基金增加众禄基金为 代销机构并参与基金费率优惠 活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 6 月 6 日
9	汇添富基金管理有限公司关于 高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 6 月 7 日
10	汇添富理财 60 天债券型证券投资 基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 6 月 13 日
11	关于汇添富理财 60 天债券型证 券投资基金开放日常申购赎回 业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 6 月 13 日
12	关于汇添富理财 60 天债券型证 券投资基金增加浦发银行为代 销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券 时报、管理人网站	2012 年 7 月 2 日

13	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2012 年半年度资产净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 7 月 2 日
14	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 7 月 12 日
15	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加数米基金为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 7 月 13 日
16	汇添富基金管理有限公司关于开通广发银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 7 月 25 日
17	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华夏银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 8 月 6 日
18	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天津银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 8 月 6 日
19	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为代销机构的公告_	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 8 月 17 日
20	汇添富基金管理有限公司关于网上直销系统使用中国农业银行借记卡申购基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 9 月 19 日
21	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行为	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 9 月 21 日

	代销机构的公告		
22	关于汇添富理财 60 天债券型证券投资基金增加南京银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 9 月 24 日
23	关于汇添富理财 60 天债券型证券投资基金 2012 年国庆节假期前暂停申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 9 月 25 日
24	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京展恒为代销机构并参与基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 10 月 18 日
25	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券为代销机构并参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 10 月 24 日
26	汇添富理财 60 天债券型证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 10 月 26 日
27	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加温州银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 10 月 29 日
28	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构并参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 11 月 5 日
29	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加同花顺基金为代销机构并参与申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 11 月 5 日
30	汇添富基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券报、证券	2012 年 11 月 16 日

	现金宝快速取现服务升级的公告	时报、管理人网站	日
31	汇添富基金管理有限公司关于开通中国银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 11 月 29 日
32	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 12 月 12 日
33	汇添富基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 12 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2012 年 11 月 15 日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。
- 2、2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富理财 60 天债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富理财 60 天债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理有限公司

### 13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理有限公司  
2013 年 3 月 28 日