

汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。

汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金由汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来。2015 年 11 月 23 日，汇添富理财 21 天债券型发起式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《关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型相关事项的议案》，内容包括汇添富理财 21 天债券型发起式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，并同意将汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金更名为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金，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 12 月 22 日起，《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

本报告中，原汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金报告期自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日止，汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2015 年 12 月 22 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况（转型前）.....	5
2.1 基金基本情况（转型后）.....	5
2.2 基金产品说明（转型前）.....	5
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）.....	7
3.2 基金净值表现（转型前）.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....	12
3.4 主要会计数据和财务指标（转型后）.....	13
3.5 基金净值表现（转型后）.....	13
3.6 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....	15
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	21
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
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.....	23
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
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.....	23
§6 审计报告（转型前）	23
6.1 审计报告基本信息.....	错误!未定义书签。
6.2 审计报告的基本内容.....	错误!未定义书签。
§6 审计报告（转型后）	24
6.1 审计报告基本信息.....	错误!未定义书签。
6.2 审计报告的基本内容.....	错误!未定义书签。
§7 年度财务报表(转型前)	25
7.1 资产负债表(转型前).....	25
7.2 利润表.....	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	29

§7 年度财务报表(转型后)	49
7.1 资产负债表（转型后）	49
7.2 利润表	51
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	52
7.4 报表附注	52
§8 投资组合报告(转型前)	70
8.1 期末基金资产组合情况	70
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明	71
报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明	71
§8 投资组合报告(转型后)	73
§9 基金份额持有人信息(转型前)	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	76
§9 基金份额持有人信息(转型后)	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	78
§10 开放式基金份额变动	78
10.1 开放式基金份额变动（转型后）	78
10.2 开放式基金份额变动（转型前）	78
§11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
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	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4 基金投资策略的改变	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
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	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	83
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	84
11.9 其他重大事件（转型后）	84
11.8 其他重大事件（转型前）	85
§12 备查文件目录	90
12.1 备查文件目录	90
12.2 存放地点	91
12.3 查阅方式	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富理财 21 天债券发起式	
基金主代码	470021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 1 月 24 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,301,690.08 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 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B
下属分级基金的交易代码:	470021	471021
报告期末下属分级基金的份额总额	14,986,930.18 份	36,314,759.90 份

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 21 日（基金合同失效前日）。

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	汇添富优选回报混合	
基金主代码	470021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 22 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,453,273.72 份	
基金合同存续期	不定期	

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 31 日。

2.2 基金产品说明（转型前）

转型前:	
投资目标	本基金在追求本金安全，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	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期控制在 141 天内。在控制利率风险的，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	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，预期

	风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金。
--	----------------------------------

2.2 基金产品说明（转型后）

转型后：	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过积极主动的资产配置，充分挖掘各大类资产投资机会，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	投资策略主要包括资产配置策略和股票投资策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；股票投资策略用于精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的股票，科学构建股票投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	王永民
	联系电话	021-28932888	010-66594896
	电子邮箱	service@99fund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95566
传真		021-28932998	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		李文	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 21 日		2014 年		2013 年 1 月 24 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日	
	汇添富理财 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B	汇添富理财 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B	汇添富理财 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B
本期已实现收益	941,717.52	1,374,752.99	1,755,808.18	5,331,339.05	18,278,024.82	11,283,184.33
本期利润	941,717.52	1,374,752.99	1,755,808.18	5,331,339.05	18,278,024.82	11,283,184.33
本期净值收益率	3.0370%	3.3280%	4.4961%	4.7993%	3.5824%	3.8674%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 12 月 21 日)		2014 年末		2013 年末	
期末基金资产净值	14,986,930.18	36,314,759.90	29,155,998.59	40,911,074.84	45,956,185.12	146,672,667.58
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 12 月 21 日)		2014 年末		2013 年末	
累计净值收益率	11.5204%	12.4685%	8.2395%	8.8524%	3.5824%	3.8674%

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、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及转型前最后一个交易日。

4、期末可供分配利润采用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。

5、本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 1 月 24 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 2015 年 12 月 21 日的数据，特此说明。

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

汇添富理财 21 天债券发起式 A

阶段	净值收益率①	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	0.5658%	0.0175%	0.3033%	0.0000%	0.2625%	0.0175%
过去六个月	1.1337%	0.0144%	0.6436%	0.0000%	0.4901%	0.0144%
过去一年	3.0370%	0.0140%	1.3130%	0.0000%	1.7240%	0.0140%
自基金合同生效日起至今	11.5204%	0.0105%	3.9796%	0.0000%	7.5408%	0.0105%

注：汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金从 2015 年 12 月 22 日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金，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七天通知存款税后利率。

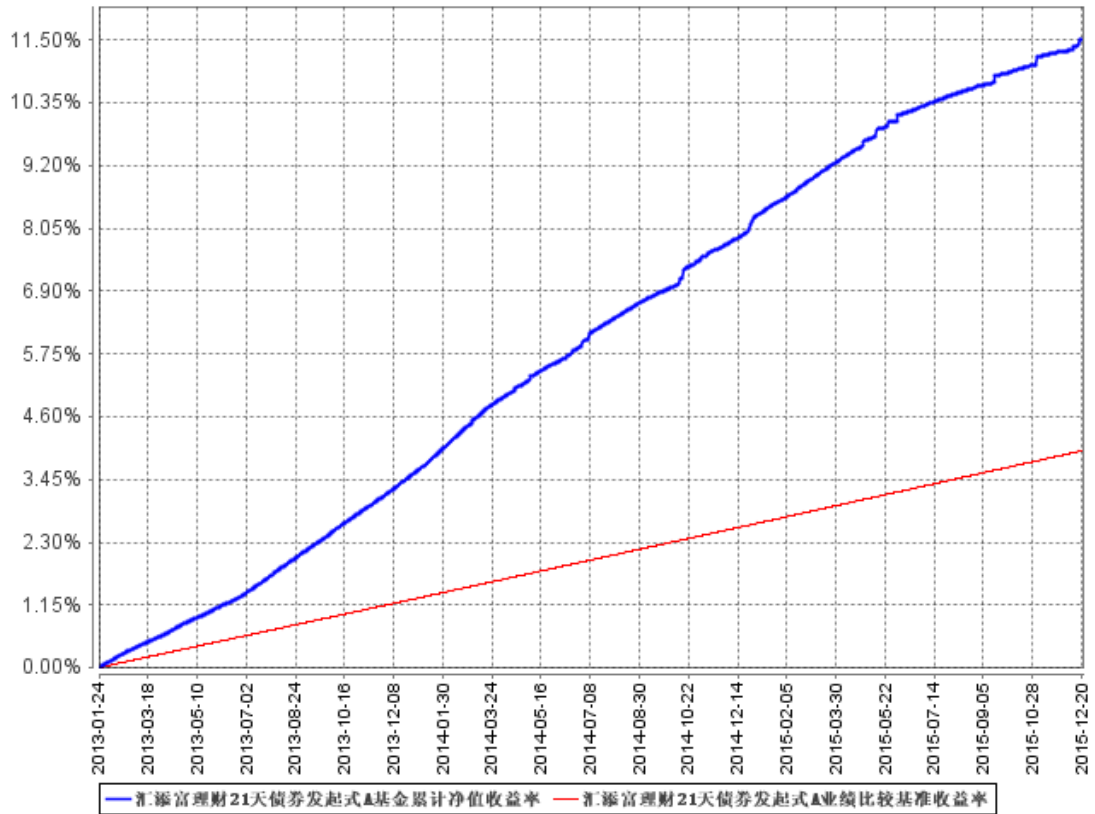
汇添富理财 21 天债券发起式 B

阶段	净值收益率①	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	0.6320%	0.0175%	0.3033%	0.0000%	0.3287%	0.0175%
过去六个月	1.2738%	0.0144%	0.6436%	0.0000%	0.6302%	0.0144%
过去一年	3.3280%	0.0140%	1.3130%	0.0000%	2.0150%	0.0140%
自基金合同生效日起至今	12.4685%	0.0105%	3.9796%	0.0000%	8.4889%	0.0105%

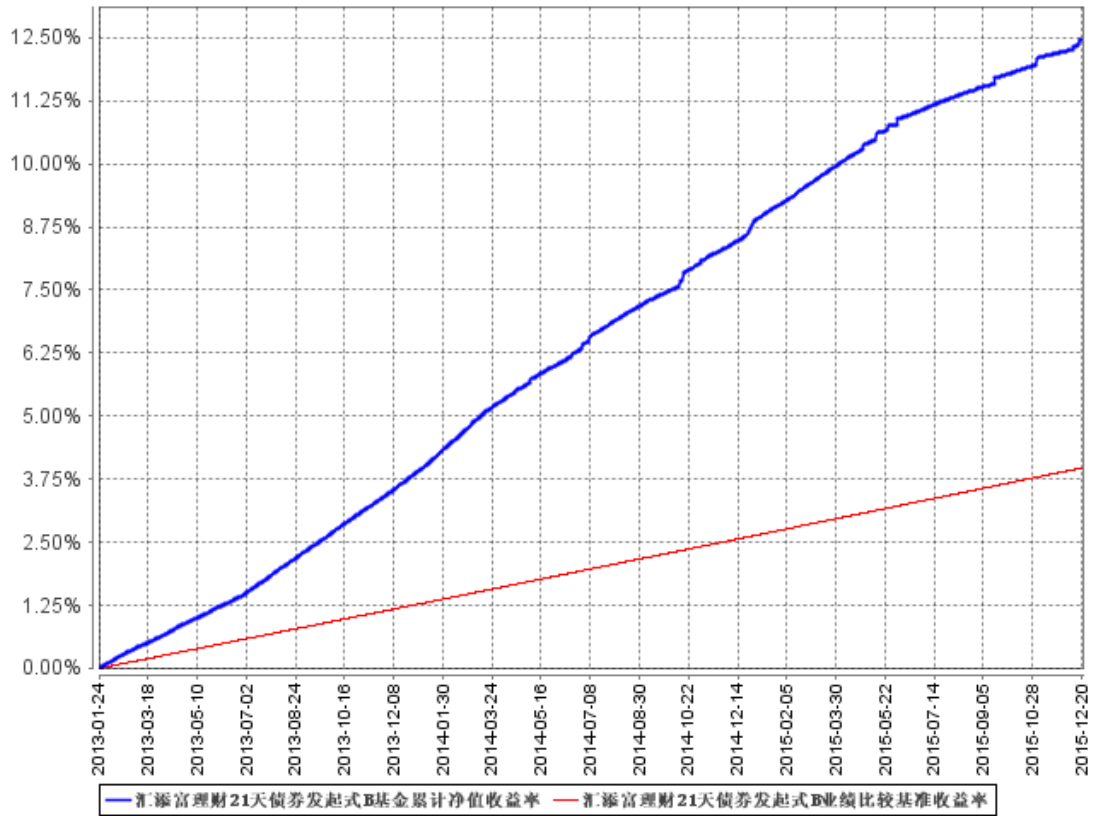
注：汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金从 2015 年 12 月 22 日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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

汇添富理财21天债券发起式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



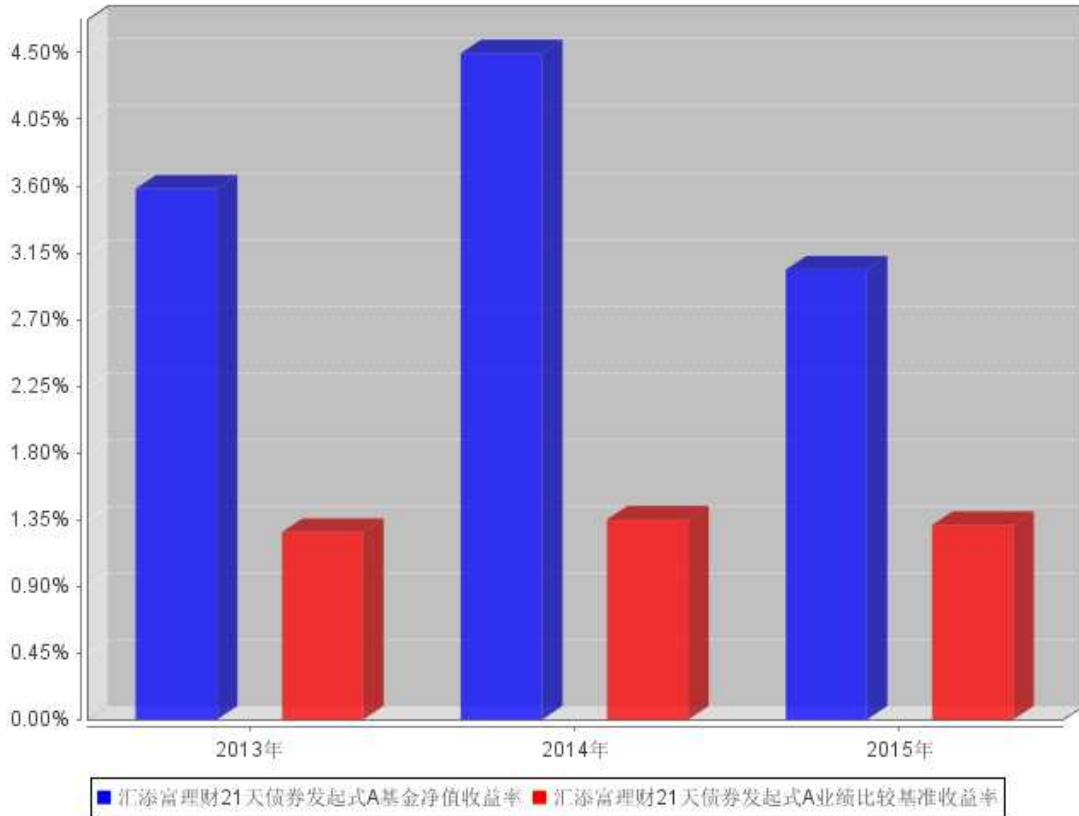
汇添富理财21天债券发起式B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



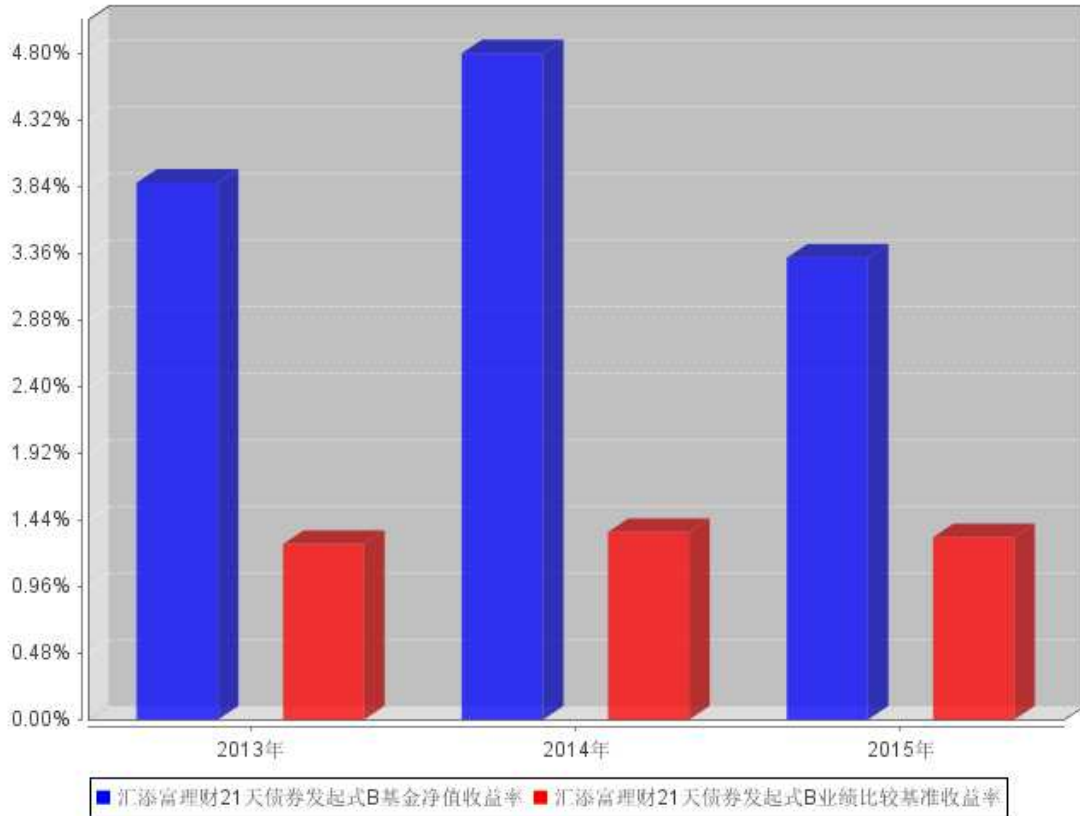
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年1月24日）起五天，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定；本基金从2015年12月22日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金。

3.2.3 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

汇添富理财21天债券发起式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



汇添富理财21天债券发起式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



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 1 月 24 日，至本报告期末未满三年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

汇添富理财 21 天债券发起式 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	794,279.67	212,974.48	-65,536.63	941,717.52
2014	1,350,098.92	386,939.96	18,769.30	1,755,808.18
2013	9,389,938.56	8,841,318.93	46,767.33	18,278,024.82
合计	11,534,317.15	9,441,233.37	0.00	20,975,550.52

汇添富理财 21 天债券发起式 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	1,500,832.85	10,533.84	-136,613.70	1,374,752.99
2014	4,210,081.84	1,127,770.78	-6,513.57	5,331,339.05
2013	6,244,965.90	4,895,091.16	143,127.27	11,283,184.33
合计	11,955,880.59	6,033,395.78	0.00	17,989,276.37

3.4 主要会计数据和财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年12月22日—2015年12月31日）
1.本期已实现收益	-6,532.17
2.本期利润	7,597.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0001
4.期末基金资产净值	51,460,871.09
5.期末基金份额净值	1.000

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.5 基金净值表现（转型后）

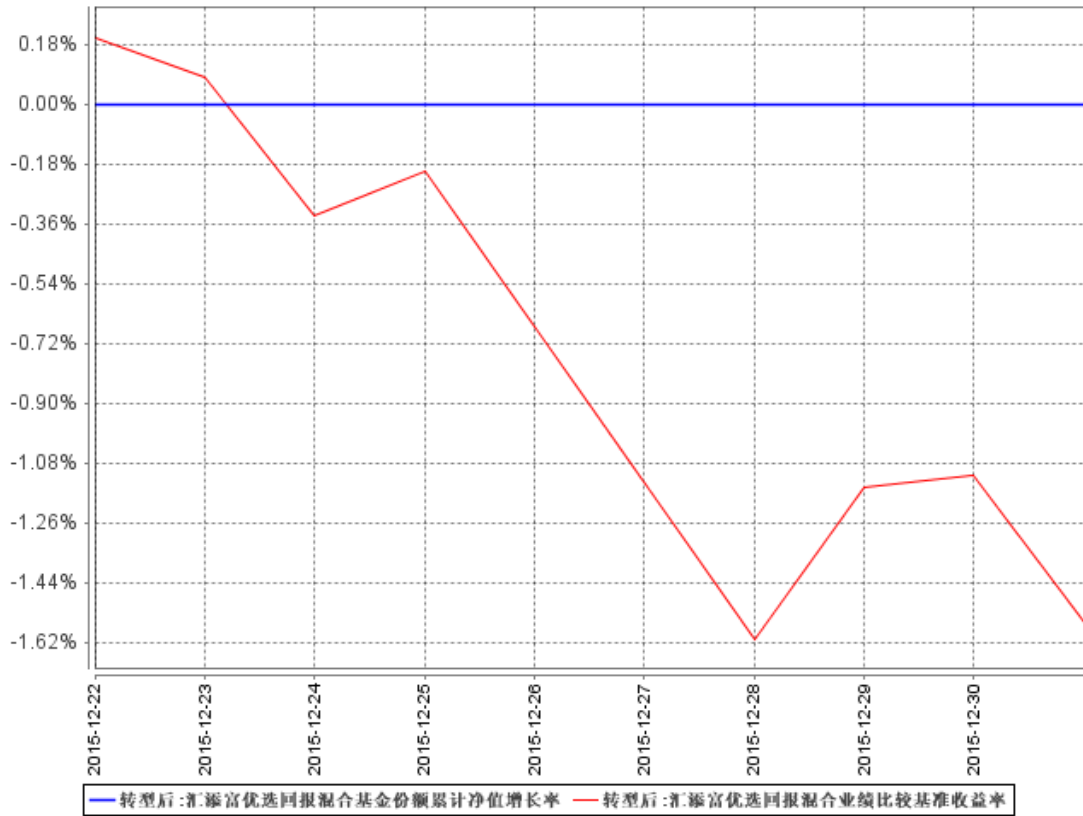
3.5.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
自基金合同 生效日至今	0.00%	0.00%	-1.56%	0.58%	1.56%	-0.58%

注：汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金从 2015 年 12 月 22 日起正式转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金，《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的生效日为 2015 年 12 月 22 日。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沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

3.5.2 自基金转型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

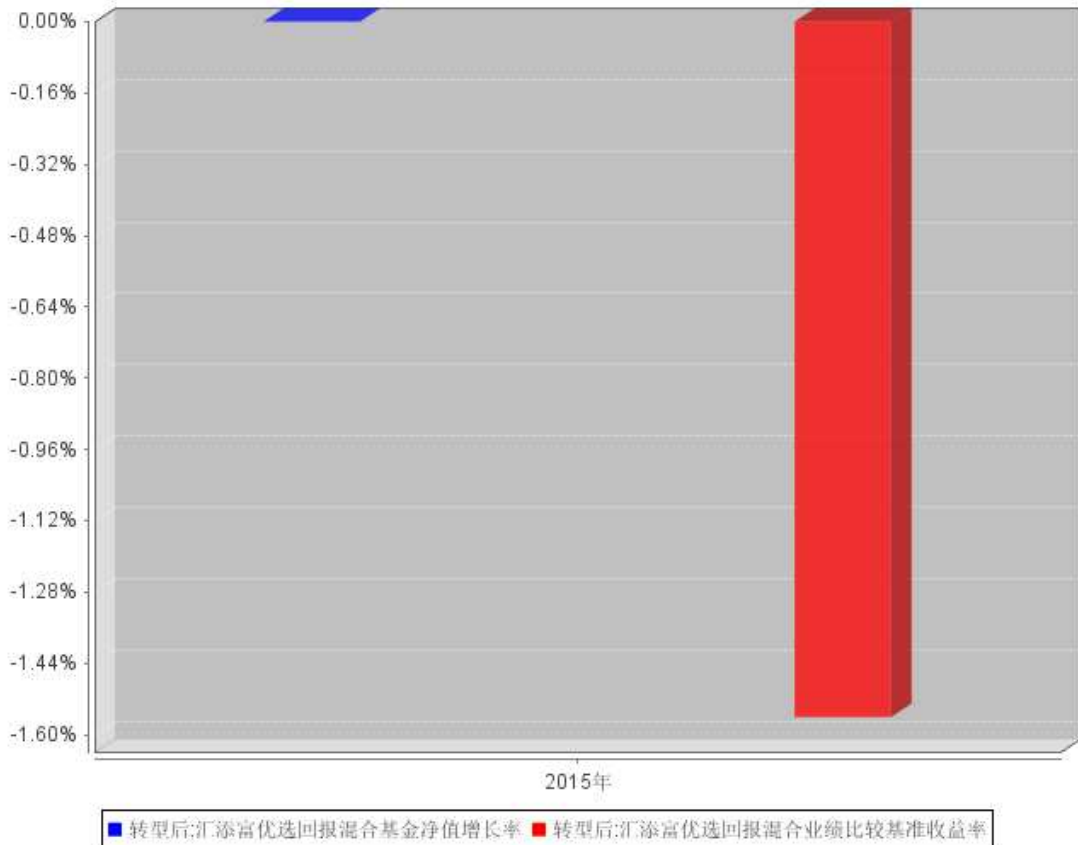
汇添富优选回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于 2015 年 12 月 22 日，截止报告期末本基金基金合同生效未满一年。
 2、按照基金合同的约定，本基金应自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

3.5.3 自基金转型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

汇添富优选回报混合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：1、本基金基金合同生效于 2015 年 12 月 22 日，截止报告期末本基金基金合同生效未满一年。
2、按照基金合同的约定，本基金应自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

3.6 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本基金基金合同生效于 2015 年 12 月 22 日，截至本报告期末未进行利润分配。

§ 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，汇添富基金继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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋文玲	汇添富现金宝、理财 14 天、理财 21 天基金的基金经理，汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。	2015 年 3 月 10 日	-	9 年	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012 年 11 月 30 日至 2014 年 1 月 7 日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014 年 1 月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014 年 4 月 8 日至今任汇添富多元收益债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理助理，2015 年 3 月 10 日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 14 天债券基金、汇添富理财 21 天

					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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋文玲	汇添富现金宝、理财 14 天、优选回报混合基金的基金经理，汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。	2015 年 3 月 10 日	-	9 年	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012 年 11 月 30 日至 2014 年 1 月 7 日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014 年 1 月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014 年 4 月 8 日至今任汇添富多元收益债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理助理，2015 年 3 月 10 日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 14 天债券基金、汇添富优选回报混合基金的基金经理。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年宏观经济基本面延续疲弱格局，工业增加值继续探底，固定资产投资仍在 10%附近的增长率徘徊。央行在货币政策上继续推行积极的放松措施，包括多次进行“双降”，下调公开市场操作的利率等。全年债市涨势较好，其中 10 年金融债由 4%以上的位置大幅下行 90-100 个基点至 3.1%左右，创全年新低。

本基金在 12 月 22 日正式转型为混合基金，在此之前仍然按照 21 天短期理财基金运作。受组合规模过低、定存和现券收益下降的影响，组合收益率逐步走低。今年债券市场信用风险事件频发，并伴随大面积的债券评级下调，因此本基金在债券配置上更为谨慎，组合持仓以 AA-AA+ 等中高等级品种为主，提高了组合的流动性和安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后，自基金合同生效日（2015 年 12 月 22 日）至今，汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的净值增长率为 0.00%，业绩比较基准收益率为-1.56%。

转型前，自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日止，原汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 A 级份额的净值收益率为 3.0370%，B 级份额的净值收益率为 3.3280%，业绩比较基准收益率为 1.3130%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

步入 2016 年，关键词转变为美元加息、人民币贬值和供给侧改革。一方面，美国经济持续复

苏、美元快速升值，新兴市场国家资产价格普遍下跌，流动性也存在一定的风险；另一方面，供给侧改革可能会对就业、过剩产能行业、银行债务的安全性带来冲击，产能出清的背后隐藏的不确定性在加大。在央行货币政策放松空间受汇率制约的前提下，如何有效激发实体经济的需求，引导宽货币向宽信贷的转化，从而提振经济，成为亟需解决的困局。大类资产配置上，经济基本面和流动性环境利好债券，但是债市屡创新低之后，绝对收益率已经极低，货币政策如果没有进一步的放松信号，在目前位置继续大幅下行的空间并不大，债市的波动将会加大。股票市场，2016 年会是一个高波动的市场，相对看好个股结构性机会。可转债方面，由于供求失衡导致的存量个券估值仍处于历史高位，预计 2016 年可转债供给会上升，将有效缓解供给矛盾，转债估值会有所回落，届时将会迎来较好的投资时点。股票资产方面，我们将灵活调整投资比例，精选个股，以把握绝对收益为主。纯债方面，更加注重信用风险的防范，把握高等级债券的交易机会。本基金将保持组合的灵活性，在承担有价值的风险下，力争为持有人创造持续稳定的投资收益。

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，汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金的《基金合同》约定：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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日期间累计分配收益 2,316,470.51 元，其中人民币 2,295,112.52 元以红利再投资方式结转入实收基金，人民币 223,508.32 元因基金赎回而支付给投资者，人民币-202,150.33 为应付利润本年变动。

转型后，汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的《基金合同》约定：本基金收益分配方式为现金分红或红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成同一类别基金份额，红利再投资的份额免收申购费；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金本报告期未进行利润分配。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告（转型前）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富理财 21 天债券型发起式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 21 天债券型发起式证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 21 日的资产负债表（即《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》失效前

	日，以下简称“基金合同失效前日”和 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日（基金合同失效前日）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基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计和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 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年 12 月 21 日（基金合同失效前日）的财务状况以及和 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈露 蔺育化
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	2016 年 3 月 25 日

§ 6 审计报告（转型后）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富优选回报灵活配置混合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优选回报灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 12 月 22 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的

	规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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，公允反映了汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 12 月 22 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈露 蔺育化
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	2016 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金

报告截止日： 2015 年 12 月 21 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	41,316,382.00	22,357,812.92
结算备付金		47,619.05	445,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,996,870.46	24,001,755.43
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		9,996,870.46	24,001,755.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	23,000,127.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	178,097.06	661,869.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		51,538,968.57	70,466,565.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 21 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	7.4.7.3	-	-
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		8,265.58	18,704.14
应付托管费		2,449.05	5,541.99
应付销售服务费		3,061.61	7,516.05
应付交易费用	7.4.7.7	1,240.99	6,579.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	202,150.33
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	222,261.26	159,000.00
负债合计		237,278.49	399,492.31
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	51,301,690.08	70,067,073.43
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		51,301,690.08	70,067,073.43
负债和所有者权益总计		51,538,968.57	70,466,565.74

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 21 日（基金合同失效前日），基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 51,301,690.08 份，其中下属 A 类基金份额总额 14,986,930.18 份；B 类基金份额总额 36,314,759.90 份。

2、自 2015 年 12 月 22 日起，原《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》失效，《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

3、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体：汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		2,996,400.72	8,240,365.57
1.利息收入		2,740,468.68	7,458,541.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,465,314.49	4,973,285.28
债券利息收入		1,020,722.59	2,203,937.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		254,431.60	281,318.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以□□填列）		255,932.04	781,823.90
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	255,932.04	781,823.90
资产支持证券投资收益	7.4.7.12.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
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）	7.4.7.15	-	-
减：二、费用		679,930.21	1,153,218.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	193,171.26	416,700.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	57,236.03	123,466.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	94,835.11	134,649.20
4. 交易费用	7.4.7.16	-	198.27
5. 利息支出		62,396.45	189,936.37
其中：卖出回购金融资产支出		62,396.45	189,936.37
6. 其他费用	7.4.7.17	272,291.36	288,267.61
三、利润总额（亏损总额以□□号填列）		2,316,470.51	7,087,147.23

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 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）	70,067,073.43	-	70,067,073.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,316,470.51	2,316,470.51
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）	-18,765,383.35	-	-18,765,383.35
其中：1.基金申购款	218,162,134.87	-	218,162,134.87
2.基金赎回款	-236,927,518.22	-	-236,927,518.22
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）	-	-2,316,470.51	-2,316,470.51
五、期末所有者权益（基金净值）	51,301,690.08	-	51,301,690.08
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	192,628,852.70	-	192,628,852.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,087,147.23	7,087,147.23
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）	-122,561,779.27	-	-122,561,779.27
其中：1.基金申购款	459,803,490.34	-	459,803,490.34
2.基金赎回款	-582,365,269.61	-	-582,365,269.61
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）	-	-7,087,147.23	-7,087,147.23
五、期末所有者权益（基金净值）	70,067,073.43	-	70,067,073.43

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金(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]1587 号文《关于核准汇添富理财 21 天债券型发起式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有限公司(现汇添富基金管理股份有限公司)向社会公开发行人募集,基金合同于 2013 年 1 月 24 日正式生效,首次设立募集规模为 5,364,940,631.12 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、期限在一年以内(含一年)的债券回购、中期票据、资产支持证券、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本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的投资目标为追求本金安全、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。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,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《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。

根据汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议,本基金于 2015 年 12 月 22 日转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金继续运作,故本财务报表仍以持续经营假设为基础编制。

7.4.3 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 21 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 12 月 21 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日（基金合同失效前日）止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

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

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

(2) 回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

7.4.4.6 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。付息债券、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) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.08%年费率计提；

(3) 对于A类基金份额的基金销售服务费，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) 卖出回购证券支出，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) 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获得当期运作期的基金未支付收益。对于持有超过一个运作期、在当期运作期到期日提出赎回申请的基金份额而言，除获得当期运作期的基金未支付收益外，投资者还可以获得自申购确认日（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) 法律法规或监管机构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

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。

7.4.7 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 2015 年 12 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	8,316,382.00	2,357,812.92
定期存款	33,000,000.00	20,000,000.00
其中：存款期限小于 1 个月	33,000,000.00	20,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	41,316,382.00	22,357,812.92

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 12 月 21 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	9,996,870.46	10,001,000.00	4,129.54	0.0080%
	合计	9,996,870.46	10,001,000.00	4,129.54	0.0080%
资产支持证券		-	-	-	
基金		-	-	-	
其他		-	-	-	
合计		9,996,870.46	10,001,000.00	4,129.54	0.0080%
项目		上年度末 2014 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	24,001,755.43	23,990,700.00	-11,055.43	-0.0158%
	合计	24,001,755.43	23,990,700.00	-11,055.43	-0.0158%
资产支持证券		-	-	-	

基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	24,001,755.43	23,990,700.00	-11,055.43	-0.0158%

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：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 21 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	18,000,000.00	-
银行间市场	5,000,127.50	-
合计	23,000,127.50	-

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：本基金本报告期末及上年度末均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 2015 年 12 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	166.33	869.50
应收定期存款利息	20,644.44	21,710.48
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2.14	220.33
应收债券利息	157,284.15	597,687.12
应收买入返售证券利息	-	41,313.04
应收申购款利息	-	69.42
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	178,097.06	661,869.89

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 21 日	上年度末 2014 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	1,240.99	6,579.80
合计	1,240.99	6,579.80

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付信息披露费	165,341.25	100,000.00
应付审计费	48,631.45	50,000.00
应付账户维护费	8,288.56	9,000.00
合计	222,261.26	159,000.00

7.4.7.9 实收基金

汇添富理财 21 天债券发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,155,998.59	29,155,998.59
本期申购	151,661,302.02	151,661,302.02
本期赎回（以□□号填列）	-165,830,370.43	-165,830,370.43
本期末	14,986,930.18	14,986,930.18

汇添富理财 21 天债券发起式 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,911,074.84	40,911,074.84
本期申购	66,500,832.85	66,500,832.85
本期赎回（以□□号填列）	-71,097,147.79	-71,097,147.79

本期末	36,314,759.90	36,314,759.90
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

汇添富理财 21 天债券发起式 A

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	941,717.52	-	941,717.52
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	-941,717.52	-	-941,717.52
本期末	-	-	-

汇添富理财 21 天债券发起式 B

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	1,374,752.99	-	1,374,752.99
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	-1,374,752.99	-	-1,374,752.99
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

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 12 月 21 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	20,990.62	32,084.73
定期存款利息收入	1,440,437.19	4,930,491.45
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,234.01	3,769.29
其他	2,652.67	6,939.81
合计	1,465,314.49	4,973,285.28

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 2015年1月1日至2015年 12月21日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	44,521,232.57	367,534,209.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	43,090,839.66	359,620,720.68
减：应收利息总额	1,174,460.87	7,131,665.39
买卖债券差价收入	255,932.04	781,823.90

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 其他收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 21日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	-	198.27
合计	-	198.27

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015 年12月21日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
审计费用	48,631.45	50,000.00

信息披露费	165,341.25	170,000.00
银行间划款费用	22,380.10	30,967.61
其他费用	350.00	1,300.00
帐户维护费	35,588.56	36,000.00
合计	272,291.36	288,267.61

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的披露

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

2015 年 11 月 23 日，汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会表决通过了《关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型相关事项的议案》，大会决议自该日起生效。自 2015 年 12 月 22 日起，《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》同时失效，汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金正式变更为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	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	167,000,000.00	100.00%	500,700,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 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	193,171.26	416,700.27
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	24,111.49	31,662.67

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

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 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	57,236.03	123,466.62

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 基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的关联方名称	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富理财 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B	合计
东方证券股份有限公司	21.44	-	21.44
汇添富基金管理股份有限公司	19,604.12	4,073.22	23,677.34
中国银行股份有限公司	36,575.41	-	36,575.41
合计	56,200.97	4,073.22	60,274.19
获得销售服务费的关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富理财 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B	合计
东方证券股份有限公司	143.28	-	143.28
汇添富基金管理股份有限公司	33,175.21	2,429.64	35,604.85
中国银行股份有限公司	80,236.87	-	80,236.87
合计	113,555.36	2,429.64	115,985.00

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：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中划出，分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 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
中国银行股 份有限公司	-	-	-	-	9,702,000.00	1,270.56
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国银行股 份有限公司	-	10,082,567.81	-	-	9,990,000.00	6,590.66

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日	
	汇添富理财 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B
基金合同生效日（2013 年 1 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	10,850,644.73
期间申购/买入总份额	-	396,447.44
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	11,247,092.17
期末持有的基金份额 占基金总份额比例		30.9711%

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	汇添富理财 21 天债券发起式 A	汇添富理财 21 天债券发起式 B
基金合同生效日（2013 年 1 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	10,378,866.41
期间申购/买入总份额	-	471,778.32
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	10,850,644.73
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	26.5225%

注：1、基金管理人于 2013 年 1 月 22 日运用自有资金 10,000,000.00 元认购本基金份额 10,000,000.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 0 元，符合招募说明书规定的认购费率。

2、本报告期内，基金管理人因分红获得份额 396,447.44 份。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 21 日		上年度可比期间 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
中国银行股份有限公司	8,316,382.00	42,690.62	2,357,812.92	142,918.06

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 12 月 21 日（基金合同失效前日）止期间获得的利息收入为人民币 1,234.01 元(2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日止期间：人民币 3,769.29 元)，2015 年 12 月 21 日（基金合同失效前日）结算备付金余额为人民币 47,619.05 元(2014 年末：人民币 445,000.00 元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

汇添富理财 21 天债券发起式 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	794,279.67	212,974.48	-65,536.63	941,717.52

汇添富理财 21 天债券发起式 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	1,500,832.85	10,533.84	-136,613.70	1,374,752.99

7.4.12 期末（2015 年 12 月 21 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 12 月 21 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 12 月 21 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

- 1)国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；
- 2)根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：
 - i)国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；
 - ii)国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别(例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级)。
- 3)同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。
- 4)本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 12 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	-	13,998,565.21
A-1 以下	-	-
未评级	9,996,870.46	10,003,190.22
合计	9,996,870.46	24,001,755.43

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

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 12 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-

未评级	-	-
合计	-	-

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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。本基金所持证券均为剩余期限较短、信誉良好的国家政策性金融债，均在银行间同业市场交易；因此，于本期末均能及时变现。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

金额单位：人民币元

本期末 2015年12月21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	41,316,382.00	-	-	-	-	-	41,316,382.00
结算备付金	47,619.05	-	-	-	-	-	47,619.05
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	9,996,870.46	-	-	-	9,996,870.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-

应收利息						178,097.06	178,097.06
应收股利							
应收申购款							
其他资产							
资产合计:	41,364,001.05		9,996,870.46			178,097.06	51,538,968.57
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						8,265.58	8,265.58
应付托管费						2,449.05	2,449.05
应付销售服务费						3,061.61	3,061.61
应付交易费用						1,240.99	1,240.99
应付税费							
应付利息							
应付利润							
其他负债						222,261.26	222,261.26
负债合计						237,278.49	237,278.49
利率敏感性缺口	41,364,001.05		9,996,870.46			-59,181.43	51,301,690.08
上年度末		1-3 个月					
2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息		合计
资 产 :							
银行存款	22,357,812.92						22,357,812.92
结算备付金	445,000.00						445,000.00
存出保证金							
交易性金融资产		10,003,190.22	13,998,565.21				24,001,755.43
衍生金融资产							
买入返售金融资产	23,000,127.50						23,000,127.50
应收证券清算款							
应收利息						661,869.89	661,869.89
应收股利							
应收申购款							
其他资产							
资产合计:	45,802,940.42	10,003,190.22	13,998,565.21			661,869.89	70,466,565.74
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						18,704.14	18,704.14
应付托管费						5,541.99	5,541.99
应付销售服务费						7,516.05	7,516.05
应付交易费用						6,579.80	6,579.80
应付税费							
应付利息							
应付利润						202,150.33	202,150.33
其他负债						159,000.00	159,000.00
负债合计						399,492.31	399,492.31
利率敏感性缺口		10,003,45,802,940.42	13,998,190.22	565.21		262,377.58	70,067,073.43

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	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（2015 年 12 月 21 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	基准利率增加 25 个基点	-10,187.96	-27,813.77
	基准利率减少 25 个基点	10,223.22	27,896.56

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 21 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属于第二层次的余额为人民币 9,996,870.46 元，无属于第一层次和第三层次的余额（于 2014 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 24,001,755.43 元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	41,375,729.65
结算备付金		47,619.05
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	10,011,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		10,011,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	36,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	172,337.90
应收股利		-
应收申购款		126,543.67
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		87,733,230.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		36,000,000.00
应付赎回款		12,030.73
应付管理人报酬		20,796.11
应付托管费		5,929.74
应付销售服务费		3,061.61
应付交易费用	7.4.7.7	1,240.99
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	229,300.00
负债合计		36,272,359.18
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	51,453,273.72
未分配利润	7.4.7.10	7,597.37
所有者权益合计		51,460,871.09

负债和所有者权益总计		87,733,230.27
------------	--	---------------

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 51,453,273.72 份。

2、本基金合同于 2015 年 12 月 22 日生效。

7.2 利润表

会计主体：汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		30,677.33
1.利息收入		14,885.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,535.55
债券利息收入		7,349.73
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以□□填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以□□号填列）	7.4.7.17	14,129.54
4.汇兑收益（损失以□□号填列）		-
5.其他收入（损失以□□号填列）	7.4.7.18	1,662.51
减：二、费用		23,079.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,530.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,480.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	7,068.74
三、利润总额（亏损总额以□□号填列）		7,597.37

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 12 月 22 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)	51,301,690.08	-	51,301,690.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,597.37	7,597.37
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)	151,583.64	-	151,583.64
其中：1.基金申购款	1,444,398.34	-	1,444,398.34
2.基金赎回款(以□□号填列)	-1,292,814.70	-	-1,292,814.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以□□号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	51,453,273.72	7,597.37	51,460,871.09

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来。2015 年 11 月 23 日，汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会表决通过了《关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型相关事项的议案》，大会决议自该日起生效。自 2015 年 12 月 22 日起，《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效，基金合同生效日的规模为 51,301,690.08 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

原汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中

中国证监会□证监许可[2012]1587 号文《关于核准汇添富理财 21 天债券型发起式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有限公司（现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 1 月 24 日正式生效，首次设立募集规模为 5,364,940,631.12 份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司发行的短期公司债券、次级债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、货币市场工具、股指期货、股票期权、权证、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则□基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称□企业会计准则□）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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。

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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 12 月 22 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。

7.4.4 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 2015 年 12 月 22 日（基金合同生效日）至 2015 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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括债券投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项等。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类

金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调

整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍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，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 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

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 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损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)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；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)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。

7.4.4.10 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 0.90%的年费率计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提；

(3)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；

(4)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。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成同一类别基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去

每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3)同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(4)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 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2015 年 12 月 31 日
活期存款	41,375,729.65
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	41,375,729.65

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	9,996,870.46	10,011,000.00
	合计	9,996,870.46	10,011,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,996,870.46	10,011,000.00	14,129.54

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末无衍生金融资产或负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	36,000,000.00	-
合计	36,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告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 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	7,650.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	23.54
应收债券利息	164,633.88
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	29.66

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	172,337.90

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 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,240.99
合计	1,240.99

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付审计费	50,000.00
应付信息披露费	170,000.00
应付账户维护费	9,300.00
合计	229,300.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	51,301,690.08	51,301,690.08
本期申购	1,444,398.34	1,444,398.34
本期赎回（以□号填列）	-1,292,814.70	-1,292,814.70
本期末	51,453,273.72	51,453,273.72

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、原汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金的实收基金为 51,301,690.08 元，折合 51,301,690.08 份基金份额，已于 2015 年 12 月 22 日（本基金合同生效日）全部转为本基金的基金

资产份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-6,532.17	14,129.54	7,597.37
本期基金份额交易产生的变动数	-241.84	241.84	-
其中：基金申购款	-335.87	335.87	-
基金赎回款	94.03	-94.03	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,774.01	14,371.38	7,597.37

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,484.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	21.40
其他	29.66
合计	7,535.55

注：表中□其他□指直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期末有股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期末有债券投资收益。

7.4.7.13.1 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末有贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期末有衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期末未有股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	14,129.54
□ □ 股票投资	-
□ □ 债券投资	14,129.54
□ □ 资产支持证券投资	-
□ □ 贵金属投资	-
□ □ 其他	-
2.衍生工具	-
□ □ 权证投资	-
3.其他	-
合计	14,129.54

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,662.51
合计	1,662.51

7.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期末未有交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	1,368.55
信息披露费	4,658.75
银行划款费用	30.00
账户维护费	1,011.44
合计	7,068.74

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、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

7.4.10 本报告期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 12 月 22 日（基金合同生效日）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	36,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 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 2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	12,530.53
其中：支付销售机构的客 户维护费	1,136.56

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	3,480.69

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2015 年 12 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日	
基金合同生效日（2013 年 12 月 13 日）持有的基金份额	-	
期初持有的基金份额	11,247,092.17	
期间申购/买入总份额	-	
期间因拆分变动份额	-	
减：期间赎回/卖出总份额	-	
期末持有的基金份额	11,247,092.17	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	21.8588%	

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

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	41,375,729.65	7,484.49

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 12 月 22 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间获得的利息收入为人民币 21.40 元，2015 年末结算备付金余额为人民币 47,619.05 元。

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：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况 非货币市场基金

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。

本基金所持证券均在银行间同业市场交易；因此，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 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	41,375,729.65	-	-	-	-	-	41,375,729.65
结算备付金	47,619.05	-	-	-	-	-	47,619.05
交易性金融资产	-	-	10,011,000.00	-	-	-	10,011,000.00
买入返售金融资产	36,000,000.00	-	-	-	-	-	36,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	172,337.90	172,337.90
应收申购款	121,617.56	-	-	-	-	4,926.11	126,543.67
资产总计	77,544,966.26	-	10,011,000.00	-	-	177,264.01	87,733,230.27
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	36,000,000.00	36,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,030.73	12,030.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,796.11	20,796.11
应付托管费	-	-	-	-	-	5,929.74	5,929.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,061.61	3,061.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,240.99	1,240.99

其他负债	-	-	-	-	229,300.00	229,300.00
负债总计	-	-	-	-	36,272,359.18	36,272,359.18
利率敏感度缺口	77,544,966.26	-	10,011,000.00	-	-36,095,095.17	51,460,871.09

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	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；	
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；	
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；	
	银行存款、结算备付金和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；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（2015 年 12 月 31 日）
	基准利率增加 25 个基点	-9,561.08
	基准利率减少 25 个基点	9,593.63

7.4.13.4.2 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。

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。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，且本期期末未持有股票和在交易所交易的可转换债券，因此无重大市场价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 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 10,011,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，自2015年3月23日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于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(转型前)

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	9,996,870.46	19.40
	其中：债券	9,996,870.46	19.40
	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	41,364,001.05	80.26

7	其他资产	178,097.06	0.35
8	合计	51,538,968.57	100.00

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 21 日。

8.1.1 报告期债券回购融资情况

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	2.52	
	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：1、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；

2、上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 21 日。

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。

8.1.2 基金投资组合平均剩余期限

8.1.2.1 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	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 21 日。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本基金合同约定：□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 141 天□ 本报告期内，本基金未发生超标情况。

8.1.2.2 报告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	80.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397	-	-

	天的浮动利率债		
3	60 天(含)-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	19.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.12	-

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 21 日。

8.1.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,996,870.46	19.49
	其中：政策性金融债	9,996,870.46	19.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	9,996,870.46	19.49
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 21 日。

8.1.4 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	150413	15 农发 13	100,000	9,996,870.46	19.49

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 21 日。

8.1.5 □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	35
报告期内偏离度的最高值	0.3214%
报告期内偏离度的最低值	0.0005%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1507%

8.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.1.7 投资组合报告附注

8.1.7.1

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

8.1.7.2

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。

8.1.7.3

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。

8.1.8 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	178,097.06
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	178,097.06

§ 8 投资组合报告(转型后)

8.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,011,000.00	11.41
	其中：债券	10,011,000.00	11.41
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	36,000,000.00	41.03
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,423,348.70	47.22
8	其他资产	298,881.57	0.34
9	合计	87,733,230.27	100.00

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 31 日。

8.1.2 报告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 报告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 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,011,000.00	19.45
	其中：政策性金融债	10,011,000.00	19.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,011,000.00	19.45

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 31 日。

8.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150413	15 农发 13	100,000	10,011,000.00	19.45

注：上表中□报告期末□指 2015 年 12 月 31 日。

8.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.1.7 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。

8.1.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

8.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	172,337.90
5	应收申购款	126,543.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	298,881.57

8.1.11.2 报告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。

8.1.11.3 报告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。

§9 基金份额持有人信息(转型前)

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 21 天债券发起式 A	583	25,706.57	2,654.84	0.02%	14,984,275.34	99.98%
汇添富理财 21 天债券发起式 B	2	18,157,379.95	36,314,759.90	100%	-	-
合计	585	87,695.20	36,317,414.74	70.79%	14,984,275.34	29.21%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富理财 21 天债券发起式 A	0.00	0.0000%
	汇添富理财 21 天债券发起式 B	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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、基金投资和相关部门负责人持	汇添富理财 21 天债券发起式 A	0

有本开放式基金	汇添富理财 21 天债券发起式 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富理财 21 天债券发起式 A	0
	汇添富理财 21 天债券发起式 B	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,247,092.17	21.92	10,000,000.00	19.49	认购的基金份额持有期限不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,247,092.17	21.92	10,000,000.00	19.49	认购的基金份额持有期限不低于三年

注：基金管理人于 2013 年 1 月 22 日运用固有资金 10,000,000.00 元认购本基金份额 10,000,000.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 0 元，符合招募说明书规定的认购费率。截至本报告期末，基金管理人持有本基金 11,247,092.17 份。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
571	90,110.81	36,317,414.74	70.58%	15,135,858.98	29.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

10.1 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	51,301,690.08
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	1,444,398.34
减:本报告期基金总赎回份额	1,292,814.70
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	51,453,273.72

注：□总申购份额□含红利再投份额。

10.2 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

	汇添富理财 21 天 债券发起式 A	汇添富理财 21 天 债券发起式 B
基金合同生效日（2013 年 1 月 24 日）基金份额总额	4,974,067,004.23	390,873,626.89
本报告期期初基金份额总额	29,155,998.59	40,911,074.84
本报告期基金总申购份额	151,661,302.02	66,500,832.85
减:本报告期基金总赎回份额	165,830,370.43	71,097,147.79
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	14,986,930.18	36,314,759.90

注：□总申购份额□含红利再投份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2015 年 11 月 23 日，汇添富理财 21 天债券型发起式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理财 21 天债券型发起式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 60,000,000.00 份，占权益登记日基金总份额 106,713,121.81 份的 56.23%，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《关于汇添富理财 21 天债券型发起式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，王翔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，基金托管人中国银行股份有限公司 2015 年 4 月公告，李爱华先生不再担任中

国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。

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 12 月 22 日原□汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金□转型为□汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金□。汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、投资范围、投资策略请详见本公司刊登在 2015 年 12 月 22 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司网站的《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

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（2015 年 12 月 22 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付当期审计费用为人民币伍万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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（转型后）

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	-	-	-	-	-

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 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		例		成交总额 的比例		比例
东方证券			36,000,000.00	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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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					-

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 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			167,000,000.00	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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

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（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于原汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型为汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 12 月 22 日

11.8 其他重大事件（转型前）

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 2014 年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	2015 年 1 月 5 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于设立上海虹桥机场分公司的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 1 月 10 日
3	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 1 月 22 日
4	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年春节假期前两个交易日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	2015 年 2 月 11 日
5	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 3 月 7 日
6	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号）	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 3 月 7 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于开展现金宝用户销售活动的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 3 月 10 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告（理财 21 天）	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 3 月 11 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理	2015 年 3 月 11 日

	券开展的网上交易系统申购基金购费率优惠活动的公告	人网站	
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参与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	2015 年 3 月 26 日
11	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年清明节假期前两个交易日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	2015 年 3 月 30 日
12	汇添富基金管理股份有限公司北京分公司办公地址变更公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 3 月 31 日
13	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2014 年年度报告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 3 月 31 日
14	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 3 月 31 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告(理财 21 天)	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 4 月 1 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 4 月 4 日
17	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(总经理、法人变更)	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 4 月 17 日
18	汇添富基金管理股份有限公司	中国证券报,上海证	2015 年 4 月 17 日

	关于高级管理人员变更的公告 (董事长变更)	券报,证券时报,管理人网站	
19	汇添富基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构并参与费率优惠活动的公告(自 TA 产品)	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 4 月 18 日
20	汇添富基金管理股份有限公司 关于董事会成员变更的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 4 月 18 日
21	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 4 月 21 日
22	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年五一假期前两个交易日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	2015 年 4 月 24 日
23	汇添富基金管理股份有限公司 关于开展现金宝用户销售活动的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 6 月 5 日
24	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年端午节假期前两个交易日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	2015 年 6 月 15 日
25	汇添富基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加龙湾农商行为销售机构并参与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	2015 年 6 月 26 日
26	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	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 6 月 27 日

		人网站	
27	汇添富基金管理股份有限公司 关于旗下基金 2015 年上半年 资产净值的公告（网站披露）	管理人网站	2015 年 7 月 1 日
28	汇添富基金管理股份有限公司 关于公司、高管及基金经理投 资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报,上海证 券报,证券时报,管理 人网站	2015 年 7 月 6 日
29	汇添富基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加华融证 券为销售机构并参与费率优惠 活动的公告	中国证券报,上海证 券报,证券时报,管理 人网站	2015 年 7 月 11 日
30	汇添富理财 21 天债券型发起 式证券投资基金 2015 年第 2 季 度报告	中国证券报,上海证 券报,证券时报,管理 人网站	2015 年 7 月 18 日
31	汇添富基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加诺亚正 行为销售机构并参与费率优惠 活动的公告	中国证券报,上海证 券报,证券时报,管理 人网站,深交所	2015 年 7 月 31 日
32	汇添富基金管理股份有限公司 关于设立成都分公司的公告	中国证券报,上海证 券报,证券时报,管理 人网站,深交所	2015 年 8 月 6 日
33	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,深交所	2015 年 8 月 6 日
34	汇添富基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加中信期 货为销售机构的公告	中国证券报,上海证 券报,证券时报,管理 人网站,深交所	2015 年 8 月 11 日
35	汇添富基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金参加天天基	中国证券报,上海证 券报,证券时报,管理	2015 年 8 月 22 日

	金网费率优惠活动的公告	人网站,深交所	
36	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 9 月 1 日、9 月 2 日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	2015 年 8 月 27 日
37	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年半年度报告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 8 月 29 日
38	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 8 月 29 日
39	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金更新招募说明书(2015 年第 2 号)	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 9 月 1 日
40	汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金更新招募说明书(2015 年第 2 号)	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 9 月 1 日
41	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金 2015 年国庆节假期前两个交易日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	2015 年 9 月 24 日
42	汇添富基金管理股份有限公司关于召开汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 11 月 6 日
43	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 11 月 11 日
44	汇添富基金管理股份有限公司	中国证券报,上海证	2015 年 11 月 18 日

	关于召开汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性公告	券报,证券时报,管理人网站	
45	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型期间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	2015 年 11 月 24 日
46	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 11 月 24 日
47	关于汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金实施转型的提示公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2015 年 12 月 18 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金托管协议》;
- 4、《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 5、《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、报告期内汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
- 8、中国证监会要求的其他文件;
- 9、报告期内汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金和汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司
2016 年 3 月 29 日