

---

# 汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

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，《汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2015 年 12 月 22 日起正式生效。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文  
本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	213,399,571.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富优选回报混合 A	汇添富优选回报混合 C
下属分级基金的交易代码:	470021	002418
报告期末下属分级基金的份额总额	212,435,787.09 份	963,784.78 份

### 2.2 基金产品说明

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
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95566
传真	021-28932998	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网	www.99fund.com
--------------------	----------------

网址	
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼汇添富基金管理股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	汇添富优选回报混合 A	汇添富优选回报混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	171,265.19	-1,393.89
本期利润	488,478.79	-68.57
本期加权平均净值利润率	0.70%	-0.02%
本期基金份额净值增长率	0.00%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0004	0.0026
期末基金资产净值	212,503,129.54	967,012.02
期末基金份额净值	1.000	1.003

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、本基金于 2016 年 2 月 3 日起增设 C 类基金份额类别。

#### 3.2 基金净值表现

##### 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

汇添富优选回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.20%	0.03%	-0.07%	0.50%	0.27%	-0.47%
过去三个月	-0.10%	0.04%	-1.25%	0.51%	1.15%	-0.47%
过去六个月	0.00%	0.04%	-7.84%	0.92%	7.84%	-0.88%
自基金合同生效日起至 今	0.00%	0.04%	-9.13%	0.90%	9.13%	-0.86%

汇添富优选回报混合 C

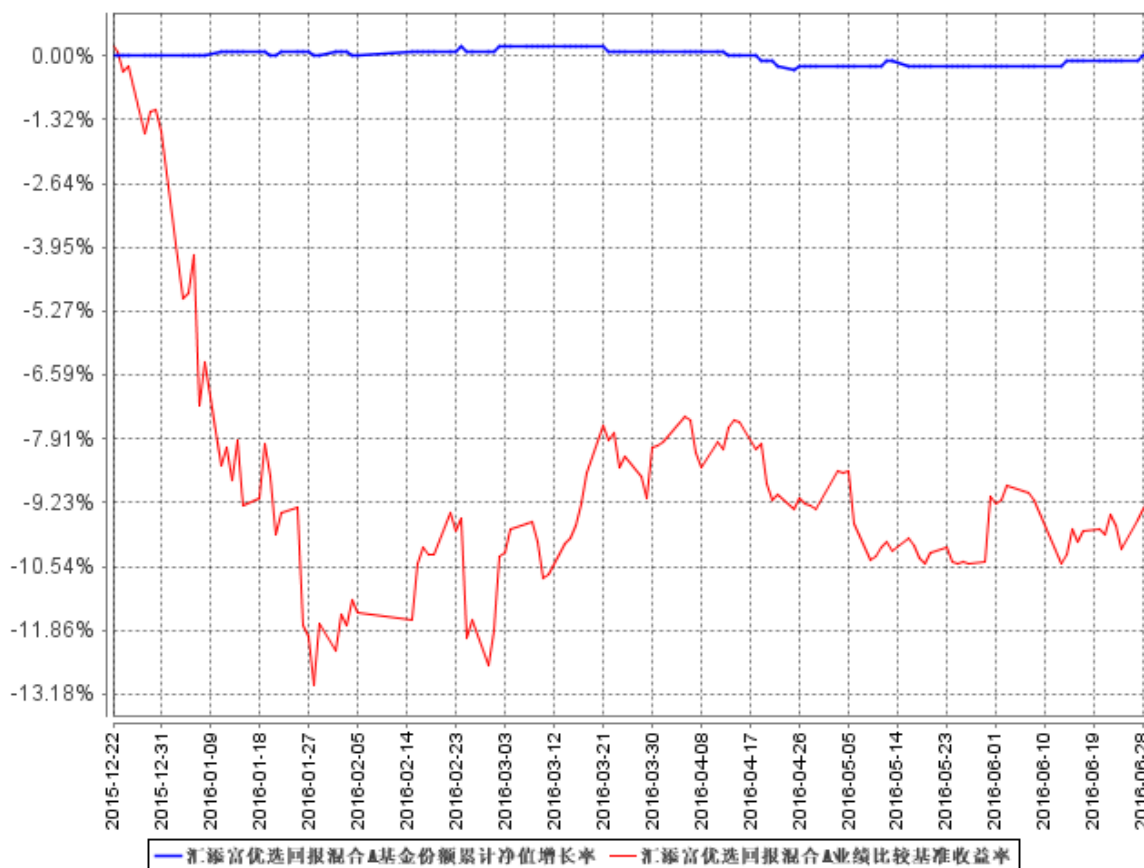
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.10%	0.04%	-0.07%	0.50%	0.17%	-0.46%
过去三个月	-0.10%	0.05%	-1.25%	0.51%	1.15%	-0.46%
自基金合同生效日起至今	0.20%	0.05%	3.18%	0.68%	-2.98%	-0.63%

注：1、汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金是由汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金自 2015 年 12 月 22 日起转型而来，本表列示的是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%；

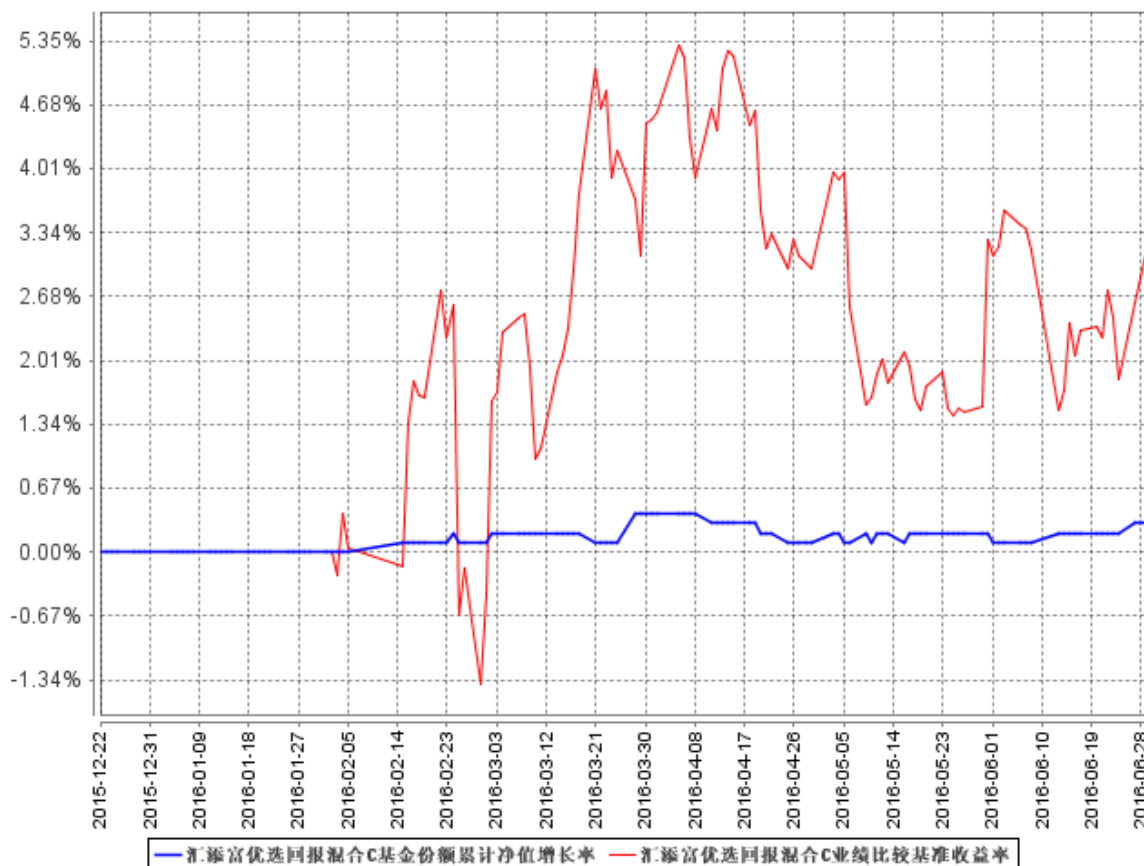
2、本基金于 2016 年 2 月 3 日起增设 C 类基金份额类别。

### 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

汇添富优选回报混合 A 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



### 汇添富优选回报混合C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、汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的合同生效日为 2015 年 12 月 22 日；  
2、本基金于 2016 年 2 月 3 日起增设 C 类基金份额类别。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字(2005)5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 1 亿元人民币。截止到 2015 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2,198.54 亿元，有效客户数约 600 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 53 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数

证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金。

#### 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		
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富货币基金、理财 14 天债券基金、理	2015 年 3 月 10 日	-	10 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

	财 30 天 债券基 金、理财 60 天债 券基金、 实业债 券基金、 优选 回报混 合基金 的基金 经理。			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(原理财 21 天债券基 金)的基金经理，2016 年 6 月 7 日至今任汇添富货 币基金、添富通货币基金、 理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金、实业债 券基金的基金经理。
--	---	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，



确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债市波动加大，走出“过山车”行情，1 季度收益率快速下行后触底反弹，整体波动不大，但是 3-4 月中下旬在铁物资、中城建等企业爆出违约事件后，市场情绪悲观，收益率窜升 50-60BP 以上，5 月份又在强劲配置需求的推动下快速下行，至 6 月底再度逼近一季末的低点。截至半年末，10 年金融债收益率为 3.18%左右，与去年末相比上行约 5-6BP，短融收益率则上行 7-8BP 至 2.90%，企业债和公司债则基本持平，收益率曲线进一步平坦化，不同信用资质的个券表现则有所分化。

股市春节前后连续触及“熔断”，跌幅较深，3 月份之后呈现震荡行情，波动收窄，沪深 300 指数报告期内下跌 15.7%，上证 50 指数下跌 12.5%。

受制于基本面和供给压力，上半年上证转债指数震荡下跌 12.9%，二季度整体表现弱于正股，个券表现有所分化。

本基金在 5 月份份额增加到 2 亿左右，整体规模仍然偏低，组合建仓进展缓慢。我们也注意到二季度股市的结构性行情对混合型基金的净值增长贡献较大，本基金表现落后，主要原因是在股票投资上较为谨慎，力求控制组合波动，债券配置则偏重于 AA 以上中高等级的信用债，规避信用风险，待净值表现稳定之后，有足够安全边际的保护下进行股票一、二级市场的相关投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日，汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准增长率为-7.84%；C 类基金份额设立于 2016 年 2 月 3 日，自 2016 年 2 月 3 日至 2016 年 6 月 30 日期间，C 类基金份额净值增长率为 0.20%，

同期业绩比较基准增长率为 3.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年的阶段，债市仍未摆脱纠结的局面，虽然经济短暂企稳后再次掉头向下得到印证，个位数的固定资产投资增速大幅低于市场预期，房地产开工和投资增速也显著放缓，基本面仍然利好债市，但是从央行的表态和动作来看，为控制杠杆率的高企，避免资产价格进一步泡沫化，降准降息等宽松货币政策出台的可能性极小，MLF 和公开市场操作投放短期资金的方式更加具备操控性和精准性，名义宽松实际稳健的货币政策短期内不会有大的调整。债市在收益率绝对水平偏低的情况下难有想象空间，交易盘的过于集中和脆弱导致其波动频繁，区间狭窄。权益市场方面，增量资金入市缓慢，个股仍然存在结构性行情，可转债方面，一级供给会继续放量，将等待转债整体估值回落后，选择优质个券进行重点配置。

下半年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，把握中高等级信用债和利率债的交易机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金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。

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

2016 年 1 月 20 日起，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告。截止本报告期末，本基金资产净值已恢复至 5 千万元以上。

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

本报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	9,473,374.10	41,375,729.65
结算备付金	-	47,619.05
存出保证金	-	-
交易性金融资产	182,925,265.84	10,011,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	182,925,265.84	10,011,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	15,000,000.00	36,000,000.00
应收证券清算款	5,003,905.56	-
应收利息	1,417,293.95	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	33,221.44	-
资产总计	213,853,060.89	87,733,230.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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	-	-
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	157,496.37	20,796.11
应付托管费	43,748.97	5,929.74
应付销售服务费	317.61	3,061.61
应付交易费用	1,958.00	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	179,398.38	229,300.00
负债合计	382,919.33	36,272,359.18
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	213,399,571.87	51,453,273.72
未分配利润	70,569.69	7,597.37
所有者权益合计	213,470,141.56	51,460,871.09
负债和所有者权益总计	213,853,060.89	87,733,230.27

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.000 元，C 类基金份额净值为 1.003 元。基金份额总额 213,399,571.87 份，其中，A 类份额 212,435,787.09 份，B 类份额 963,784.78 份；

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	1,060,488.65
1.利息收入	696,977.51
其中：存款利息收入	76,820.68
债券利息收入	600,851.26
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	19,305.57
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	20,535.10
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	20,535.10
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	318,538.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	24,437.12
<b>减：二、费用</b>	572,078.43
1. 管理人报酬	312,789.73

2. 托管费	86,885.99
3. 销售服务费	802.48
4. 交易费用	2,275.00
5. 利息支出	14,187.67
其中：卖出回购金融资产支出	14,187.67
6. 其他费用	155,137.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>488,410.22</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>488,410.22</b>

注：1、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据；

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	51,453,273.72	7,597.37	51,460,871.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	488,410.22	488,410.22
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）	161,946,298.15	-425,437.90	161,520,860.25
其中：1.基金申购款	206,296,132.01	-394,745.49	205,901,386.52
2.基金赎回款	-44,349,833.86	-30,692.41	-44,380,526.27
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）	213,399,571.87	70,569.69	213,470,141.56

注：1、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因

此不存在上年度可比期间数据；

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

本基金由汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，转型后的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于 2015 年 12 月 22 日起生效。

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人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）。

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.4.1 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 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股票等投资。

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、存出保证金和各类应收款项等。

##### (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，主要包括卖出回购金融资产款各类应付款项。



#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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) 本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。

本基金 A 类基金份额不计提销售服务费。

#### 6.4.4.11 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。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2 . 营业税、增值税

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

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

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

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

## 3 . 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[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。

## 4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由

上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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[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。

## 6.4.7 关联方关系

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

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

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	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
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业

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

2、以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：1、本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易；  
2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：1、本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易；  
2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	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	35,000,000.00	100.00%	-	-

注：本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：1、本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易；  
2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：1、本基金本报告期无应支付关联方的佣金；  
2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	312,789.73	-
其中：支付销售机构的客户维护费	19,350.03	-

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.90% 的年费率计提。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 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	86,885.99	-

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.2.3 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富优选回报混合 A	汇添富优选回报混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	0.00	802.48	802.48
合计	0.00	802.48	802.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		



	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富优选回报混合 A	汇添富优选回报混合 C	合计

注：1. 本基金于 2015 年 12 月 22 日从理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来。因此不存在上年度可比期间数据。

2. 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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 2 至 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：1、本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易；

2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	汇添富优选回报混合 A	汇添富优选回报混合 C
基金合同生效日（2015 年 12 月 22 日）持有的基金份额	11,247,092.17	-
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	11,247,092.17	-
期末持有的基金份额	0.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	汇添富优选回报混合 A	汇添富优选回报混合 C
基金合同生效日（2015 年 12 月 22 日）持有的基金份额	-	-

期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：1. 本基金于 2015 年 12 月 22 日从理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来。因此不存在上年度可比期间数据。

2. 本基金期初份额由原理财 21 天债券型发起式证券投资基金的份额转换而来。

3. 本公司于 2016 年 2 月 24 日赎回本基金份额 11,247,092.17 份，赎回费用为 0.00 元。符合招募说明书规定的赎回费率。

4. 本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本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。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	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	9,473,374.10	72,523.57	-	-

注：本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：1、本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券的情况；

2、本基金于 2015 年 12 月 22 日从汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金转型而来，因此不存在上年度可比期间数据。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：截止本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：截止本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	182,925,265.84	85.54
	其中：债券	182,925,265.84	85.54
	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	15,000,000.00	7.01
	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	9,473,374.10	4.43
7	其他各项资产	6,454,420.95	3.02
8	合计	213,853,060.89	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末持有股票。

### 7.3 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末持有股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,998,000.00	4.68
	其中：政策性金融债	9,998,000.00	4.68
4	企业债券	52,531,283.29	24.61
5	企业短期融资券	100,098,000.00	46.89
6	中期票据	20,099,000.00	9.42
7	可转债（可交换债）	198,982.55	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	182,925,265.84	85.69

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	011599735	15 澜沧江 SCP004	200,000	20,094,000.00	9.41
2	139122	16 浏城建	200,000	20,082,000.00	9.41
3	011605002	16 联通 SCP002	200,000	20,018,000.00	9.38
4	011606002	16 电网 SCP002	200,000	20,008,000.00	9.37
5	011699787	16 大唐集 SCP005	200,000	20,006,000.00	9.37

**7.7 7.7 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：本基金本报告期末持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末持有贵金属投资。

**7.9 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：本基金本报告期末持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期期末持有股指期货投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期期末持有股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期期内未持有国债期货投资。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期期内未持有国债期货投资。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期期内未持有国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1**

基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2**

本基金本报告期末持有股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	5,003,905.56
3	应收股利	-
4	应收利息	1,417,293.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	33,221.44
8	其他	-
9	合计	6,454,420.95

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有股票。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
汇添富优选回报混合 A	432	491,749.51	200,470,122.17	94.37%	11,965,664.92	5.63%
汇添富优选回报混合 C	8	120,473.10	0.00	0.00%	963,784.78	100.00%
合计	440	484,999.03	200,470,122.17	93.94%	12,929,449.70	6.06%

#### 8.2 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有本开放式基金	汇添富优选回报混合 A	0
	汇添富优选回报混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富优选回报混合 A	0
	汇添富优选回报混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富优选回报混合 A	汇添富优选回报混合 C
基金合同生效日（2015 年 12 月 22 日）基金份额总额	51,301,690.08	0.00
本报告期期初基金份额总额	51,453,273.72	0.00
本报告期基金总申购份额	205,180,806.81	1,115,325.20
减：本报告期基金总赎回份额	44,198,293.44	151,540.42
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	212,435,787.09	963,784.78

注：总申购份额含红利再投资份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

16、本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。



### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

注：此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	35,000,000.00	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、此 2 个交易单元与汇添富多元收益债券型证券投资基金共用。本报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

汇添富基金管理股份有限公司  
2016 年 8 月 27 日