汇添富理财30天债券型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年3月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年5月9日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富理财30天债券	
基金主代码	470030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月9日	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,710,800,859.33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30天债券A	汇添富理财30天债券B
下属分级基金的交易代码:	470030	471030
报告期末下属分级基金的份额总额	4,556,888,049.63份	2,153,912,809.70份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	将采用积极管理型的投资策略,原则上将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年5月9日(基金合同生效日)-2012年12月31日	
	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
本期已实现收益	264,219,429.11	95,253,955.16
本期利润	264,219,429.11	95,253,955.16
本期净值收益率	2.30%	2.49%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	
期末基金资产净值	4,556,888,049.63	2,153,912,809.70
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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

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

3、本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9日,至本报告期末未满三年,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2012年12月31日数据,特此说明。

3.2 基金表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财30天债券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
过去三个月	0.8701%	0.0016%	0.3393%	0.0000%	0.5308%	0.0016%
过去六个月	1.7158%	0.0014%	0.6792%	0.0000%	1.0366%	0.0014%
自基金合同生效日起至今	2.2957%	0.0017%	0.8805%	0.0000%	1.4152%	0.0017%

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

2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

3、本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9日,至本报告期末未满一年。

汇添富理财30天债券B

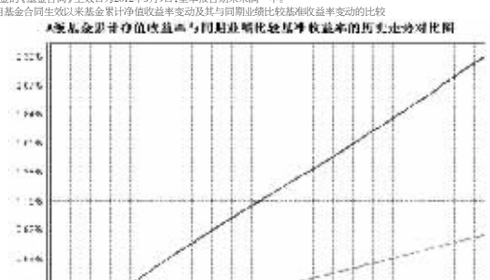
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9441%	0.0016%	0.3393%	0.0000%	0.6048%	0.0016%
过去六个月	1.8645%	0.0014%	0.6792%	0.0000%	1.1853%	0.0014%
自基金合同生效日起至今	2.4882%	0.0018%	0.8805%	0.0000%	1.6077%	0.0018%

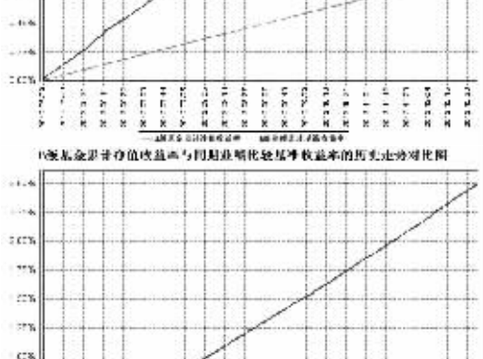
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。

2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

3、本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9日,至本报告期末未满一年。

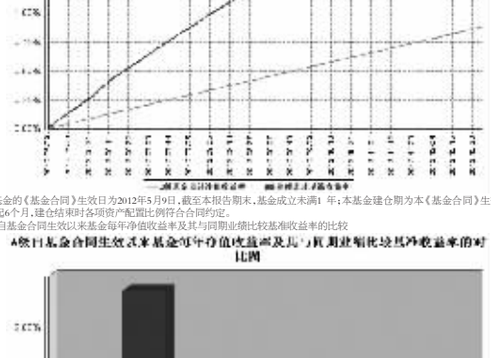
3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

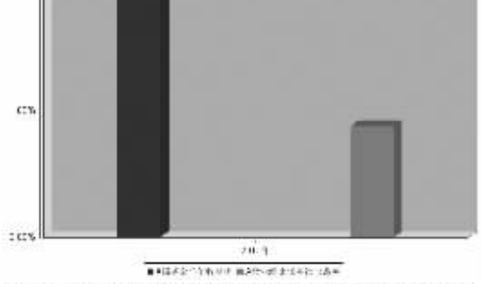




注:本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9日,截至本报告期末,基金成立未满1 年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2012年5月9日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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





注:1、本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9日,至本报告期末未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

汇添富理财30天债券A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2012	145,029,829.13	111,142,034.70	8,047,565.28	264,219,429.11	
合计	145,029,829.13	111,142,034.70	8,047,565.28	264,219,429.11	
汇添富理财30天债券B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2012	53,563,824.76	38,508,870.61	3,181,259.79	95,253,955.16	
合计	53,563,824.76	38,508,870.61	3,181,259.79	95,253,955.16	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理有限公司成立于2005年2月,总部设在上海陆家嘴,公司旗下设立了北京、南方两个分公司,以及全资子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)。

汇添富是中国第一批获得QDII业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得RQFII业务资格的基金公司。同时是全国社会保障基金投资管理人。在投资管理领域,汇添富已形成公募、专户、国际、养老金四大块业务以及股票、固定收益、被动投资、海外投资、另类投资五大块投资领域协同发展的格局。

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

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2012年,汇添富取得优秀的投资业绩,在市场震荡起伏的背景下,公司旗下基金均获得正收益,切实为投资者赢得财富增长。

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

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

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

2012年,汇添富持续开展贴心的投资者服务与教育工作,公司围绕向“现代财富管理机构”转型的思路,从不同类型客户的切身需求出发,大力建设投顾式客户服务体系;同时,公司进一步着力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2012年,汇添富社会责任事业进一步深入开展。“河流2孩子”助学计划启动第五季活动,公司公益基金会捐资在贵州建设“吉邦添富小学”;邀请客户、员工及员工家属参加“红色希望之旅”活动,先后走进甘肃大夏河、四川美姑、云南怒江的“添富小学”,开办“梦想课堂”,捐赠图书和设备;为优秀乡村教师赴提供国内外知名教育机构的师资培训。同时,汇添富还着力开展医疗救助、结对帮扶、国防拥军等社会公益活动。凭借慈善公益事业上的长期坚持和突出贡献,2012年4月,汇添富基金荣获第二届上海慈善表彰大会颁发的“上海慈善奖爱心捐赠企业”奖,成为唯一一家获奖的基金管理公司。

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾刚	本基金的基金经理、汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理、汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理、汇添富理财28天债券型证券投资基金的基金经理。	2012年5月9日	-	11年	国籍:中国,1971年出生,中国科技大学学士、清华大学MBA,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾在红塔证券自营业务总部、以摩证券债券业务总部、华宝兴业基金管理有限公司研究部负责宏观经济和债券的研究、上海电气集团财务有限责任公司资产管理部任经理助理。2008年5月15日至2010年2月5日任华富基金管理有限公司华富货币基金的基金经理。2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强债券基金的基金经理。2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报债券基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部高级经理。2012年5月9日至今任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理。2012年6月12日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月18日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年10月18日至今任汇添富理财28天债券型证券投资基金的基金经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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,独立制定组合配置计划和组合调整方案,并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3)在交易环节,公司实行集中交易,所有交易执行由集中交易室负责完成,投资交易系统参数设置为公平交易模式,按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理,严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配,确保交易的公平性。(4)在交易监控环节,公司通过日常监控、投资交易监控周报、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外以价公允性等等,(5)在报告分析方面,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署,当发生风格相似或同一投资经理管理的投资组合之间业绩表现差异超过5%等情形时,将进行专项分析。同时,投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,报告期内,本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度,进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易行为监控体系由集中交易室、投资研究部、稽核监察部和金融工程部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的监控,确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3日、5日)同向交易的样本,对其进行了95%的置信区间,假设差价率为0的分布检验以及差价率均值的分析。分析结果表明,不同时间窗口下,公司各组合间买卖价差不显著,差价率均值小于1%。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为2次,分别是由于指数基金根据标的指数成份股调整而被动调仓、专户组合到期清算卖出证券所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2012年利率债和高等级信用债的波幅不大,但中低评级信用债走势强劲,呈现上半年强牛,三季度小幅调整但四季度重现转暖势头的整体节奏。上半年资金面中性,关键节点仍有压力,下半年资金面有改善;2012年央行分别降准降息2次,但更核心的是启动了利率市场化的进程,扩大了基准的上下浮动区间,随后以持续逆回购为主,意在推出市场化的基准;银行理财产品等机构新增债券需求对于四季度债市走暖提供了支持。

本基金成立于5月9日,主要投资于协议存款和短融,赶在上半年大幅上涨的后期,前期较为积极,收益较好;进入3季度,本基金规模下降,我们积极应对流动性的挑战,这段期间市场下跌,基金收益有所下降。三季度后我们加强了协议存款的力量,积累经验,收到较好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本期间本基金A级净值收益率为2.2957%,B级净值收益率为2.4882%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

我们将综合分析本基金的份额变动,提前做好债券与存款之间的配置计划。本基金的组合流动性管理特征不同于普通货币基金,在总结前期经验教训的基础上,我们将更加明确地注重流动性,做好份额变动的分析和预测,合理搭配协存、短融、浮息债等品种,力争提高组合收益。

4.6 管理人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历,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金2012年5月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日期间累计分配收益359,473,384.27元,其中人民币198,593,653.89元以红利再投资方式结转入实收基金,人民币149,650,905.31元因基金赎回而支付给投资者,其余人民币11,228,825.07元为期末应付收益。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年,本基金托管人在对汇添富理财30天债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012年,汇添富理财30天债券型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富理财30天债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富理财30天债券型证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所审计,注册会计师徐艳、方俊于2013 年 3 月28 日签字出具了安永华明(2013)审字第60466941_B22号标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:汇添富理财30天债券型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日
资 产:	
银行存款	3,385,964,518.61
结算备付金	2,505,292.78
存出保证金	125,000.00
交易性金融资产	3,232,318,777.65
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	3,232,318,777.65
资产支持证券投资	-
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	72,365,532.60
应收股利	-
应收申购款	32,653,714.24
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	6,725,932,835.88
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,807,970.42
应付托管费	535,694.98
应付销售服务费	1,343,435.08
应付交易费用	36,308.42
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	11,228,825.07
递延所得税负债	-
其他负债	179,742.58
负债合计	15,131,976.55
所有者权益:	
实收基金	6,710,800,859.33
未分配利润	-
所有者权益合计	6,710,800,859.33
负债和所有者权益总计	6,725,932,835.88

注:1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额6,710,800,859.33份,其中,A级份额4,556,888,049.63份,B级份额2,153,912,809.70份。

3、本基金合同于2012年5月9日生效,无比较式的上年度可比期间,因此资产负债表只列示2012年12月31日数据,特此说明。

7.2 利润表

会计主体:汇添富理财30天债券型证券投资基金

本报告期:2012年5月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年5月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	424,698,160.19
1.利息收入	412,592,367.19
其中:存款利息收入	335,737,110.33
债券利息收入	72,197,306.11
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,657,950.75
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	12,105,793.00
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	12,105,793.00
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-
减:二、费用	65,224,775.92
1.管理人报酬	26,455,354.87
2.托管费	7,838,623.87
3.销售服务费	22,299,909.23
4.交易费用	-
5.利息支出	8,194,565.58
其中:卖出回购金融资产支出	8,194,565.58
6.其他费用	436,322.37
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	359,473,384.27

注:1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、本基金合同于2012年5月9日生效,无比较式的上年度可比期间,因此利润表只列示从基金合同生效日至2012年12月31日数据,特此说明。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富理财30天债券型证券投资基金

本报告期:2012年5月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年5月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	24,441,718,012.59	-	24,441,718,012.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	359,473,384.27	359,473,384.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-17,730,917,153.26	-	-17,730,917,153.26
其中:1.基金申购款	30,771,177,646.89	-	30,771,177,646.89
2.基金赎回款	-48,502,094,800.15	-	-48,502,094,800.15
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)	-	-359,473,384.27	-359,473,384.27
五、期末所有者权益(基金净值)	6,710,800,859.33	-	6,710,800,859.33

注:本基金于2012年5月9日成立,无比较式的上年度可比期间,因此所有者权益(基金净值)变动表只列示从基金合同生效日至2012年12月31日数据,特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

林利军 陈灿辉 王小练

基金管理公司负责人 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30天债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]556号文《关于核准汇添富理财30天债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由汇添富基金管理有限公司作为发起人于2012年5月2日至2012年5月7日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第60466941_B02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2012年5月9日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,设立时募集的有效认购款项包括:募集期间产生的活期存款利息为人民币1,665,875.00元,以上实收基金(本息)合计为人民币24,441,718,012.59元,折合24,441,718,012.59份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。本基金采用积极管理型的投资策略,原则上将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2012年12月31日的财务状况以及2012年5月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依据企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2012年5月9日(基金合同生效日)起至2012年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1)债券投资

买入银行间同业市场交易的债券,于成交日确认为债券投资;

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

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

(2)回购协议

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

(3)资产支持证券投资

买入资产支持证券于成交日确认为资产支持证券投资;

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法,其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值;

本基金金融工具的估值方法具体如下:

1)银行存款

基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

2)债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

3)回购协议

(1)基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(2)基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产;若融券业务到期无法履约,则继续持有债券资产。实际持有的相关资产按其性质进行估值:

4)资产支持证券投资

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

(2)在全国银行间债券市场交易的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值;

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(2)为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用其他可参考公允价值指标,对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中,对于偏离度的绝对值达到或超过0.50%的情形,基金管理人应编制并按路径报告:

(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