汇添富季季红定期开放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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2013年3月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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7月26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	汇添富季季红定期开放债券
基金主代码	164702
交易代码	164702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月26日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	621,973,449.13份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年10月25日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种,在严格管理投资风险的基础上,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金80%以上的基金资产投资于债券资产,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机,力争为基金资产获取稳健回报。
业绩比较基准	银行三年期定期存款税后利率+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	田青
	联系电话	021-28932888	010-67595096
	电子邮箱	service@99fund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	010-67595096
传真		021-28932998	010-66275853

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7月26日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	8,231,121.20
本期利润	11,720,290.81
加权平均基金份额本期利润	0.0188
本期基金份额净值增长率	1.90%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0132
期末基金资产净值	633,693,739.86
期末基金份额净值	1.019

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、上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、期末可供分配利润采用期末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。

4、本基金的《基金合同》生效日为2012年7月26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

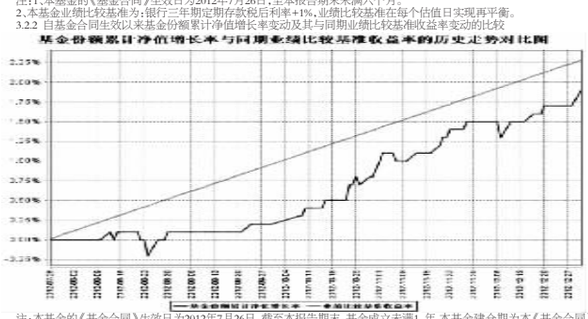
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.70%	0.07%	1.31%	0.02%	0.39%	0.05%
自基金合同生效日起至今	1.90%	0.06%	2.28%	0.01%	-0.38%	0.05%

注:1、本基金的《基金合同》生效日为2012年7月26日,至本报告期末未满六个月。

2、本基金业绩比较基准为:银行三年期定期存款税后利率+1%,业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

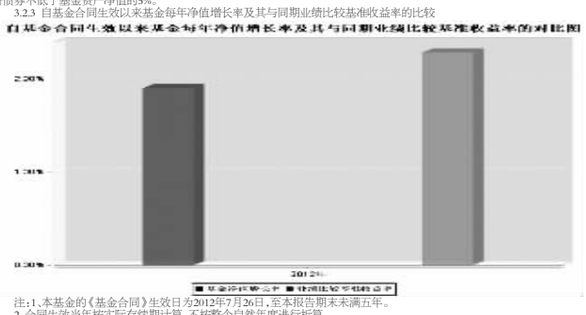
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的《基金合同》生效日为2012年7月26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7月26日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回,每三年(含三年)为一个封闭期。在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(但在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制)。权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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



注:1、本基金的《基金合同》生效日为2012年7月26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

注:本基金成立于2012年7月26日,2012年度未进行利润分配。

§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

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

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

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

汇添富始终坚持"以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益"这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。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快回业务,极大地提升货币基金的理财便捷性。

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

2012年,汇添富社会责任事业进一步深入开展。"河流•孩子"助学计划启动第五季活动,公司公益基金会捐资在贵州建设"古邦添富小学";邀请客户、员工及员工家属参加"红色希望之旅"活动,先后走进甘肃大夏河、四川美姑、云南怒江的"添富小学",开办"梦想课堂",捐赠图书和设备;为优秀乡村教师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		
陆文磊	本基金的基金经理,汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。	2012年7月26日	-	10年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理有限公司任固定收益高级经理。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币市场基金的基金经理,2011年1月26日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放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,在投资范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在投权范围内根据投资组合的风格和投资策略,独立制定资产配置计划和组合调整方案,并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3)在交易环节,公司实行集中交易,所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式,按照"时间优先、价格优先、比例分配"的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理,严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配,确保交易的公平性。(4)在交易监控环节,公司通过日常监控、投资交易监控周报、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5)在报告分析方面,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。当发生风格相似或同一投资经理管理的投资组合之间业绩表现差异超过5%等情形时,将进行专项分析。同时,投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3日、5日)同向交易的样本,对其进行了95%的置信区间,假设差异率为0的分布检验以及差异均值的分析。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年美国经济全年以稳步复苏为主,欧元区经济仍非常低迷,但下半年欧债危机有所好转,各主要央行继续维持极度宽松的货币政策,在流动性的助推下,全球投资者风险偏好上升,股市、商品市场均有不同程度上涨。国内经济全年运行表现出前低后高的走势,前三季度GDP增长率逐季回落,四季度开始企稳回升,外需较为低迷,固定资产投资仍是经济增长的主要推动因素。全年物价涨幅保持低位,CPI年平均涨幅为2.6%左右,比上年大幅回落。央行货币政策取向偏宽松,全年准备金率和基准利率各下调两次,市场资金面环境比2011年显著改善,货币市场利率大幅回落。

2012年债券市场整体出现较大幅度上涨,中债综合财富指数年上涨3.6%,但不同类型债券分化较为明显,国债、金融债先扬后抑,至年末收益率比年初有较大幅度上行,而信用债全年涨幅明显超过利率债,尤其是中低评级信用债年持有期回报显著高于利率品种和高评级信用品种。本基金于7月末成立,恰逢市场利率低点,因此本基金成立之初采取了较为谨慎的投资策略,主要以把握较为确定的投资机会为主,逐渐增加对债券的配置比例,较好的规避了三季度债券市场的调整风险,基金成立以来实现了净值的稳定增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本期净值收益率为1.90%,同期业绩比较基准收益率2.28%

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年全球经济有望维持弱复苏态势,美国去杠杆化已经进入尾声,但缺少实质性的新产业形成新的经济增长点,经济将保持相对低速增长。欧债危机对欧元区的负面影响将在2013年延续,经济内生增长动力欠缺,债务危机对实体经济的影响还会继续深入。中国经济仍处于转型阶段,2013年企业短期去库存、中期去产能的进程将延续,潜在增长率下降是一个长期趋势,经济增长有望低位企稳。制造业部门去产能过程深化,造成居民收入增速回落将进一步压低消费增速;而房地产投资底部企稳,基建投资持续将促使经济增速略高于2012年。2013年通胀预计不会显著上行,但通胀压力略大于2012年,货币政策基调将以稳健为主,大规模放松或收紧的可能性都不大。

随着经济增长和通胀底部企稳回升,债券市场会受到一定的基本面压力,预计2013年债券市场难以出现单边上涨行情,但从中期来看,转型期内经济增长难以出现强劲回升,通胀中枢水平也将维持相对稳定,债券市场也没有明显的系统性风险,目前大部分信用债券的绝对收益率水平仍然有吸引力,加上政策继续推动债券市场加快发展,2013年债券市场同样不乏投资机会,本管理人将更加注重债券的票息收益,精选优质债券进行配置,同时采取一定的杠杆比例进行操作,保持较高的组合静态收益率,对利率债和高等级信用债则以把握阶段性的投资机会为主,力争在控制风险的前提下为投资者创造持续稳定的收益。

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。

4.7 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:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的50%。基金合同生效满6个月后,若每季度最后一个自然日每10份基金份额的可供分配利润不低于0.20元,则基金须进行收益分配并以该日作为收益分配基准日。若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配。

本基金2012年7月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

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、方侃于2013年3月28日签字出具了安永华明(2013)审字第60466941_B25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:汇添富季季红定期开放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	315,055.06
结算备付金	15,255,941.44
存出保证金	-
交易性金融资产	878,769,862.84
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	878,769,862.84
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	31,027,444.62
应收利息	12,580,423.67
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	937,948,727.63
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	302,974,509.14
应付证券清算款	270,418.04
应付赎回款	-
应付管理人报酬	321,072.77
应付托管费	107,024.24
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,765.00
应交税费	384,000.00
应付利息	56,198.58
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	140,000.00
负债合计	304,254,987.77
所有者权益:	
实收基金	621,973,449.13
未分配利润	11,720,290.73
所有者权益合计	633,693,739.86
负债和所有者权益总计	937,948,727.63

注:1、本基金于2012年7月26日成立,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。

2、报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.019元,基金份额总额621,973,449.13份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2012年7月26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7月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	15,353,966.70
1.利息收入	11,752,690.32
其中:存款利息收入	167,925.47
债券利息收入	9,322,255.53
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,262,509.32
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	111,991.63
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	111,991.63
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)	3,489,169.61
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	115.14
减:二、费用	3,633,675.89
1.管理人报酬	1,621,560.85
2.托管费	540,520.30
3.销售服务费	-
4.交易费用	5,218.90
5.利息支出	1,146,867.34
其中:卖出回购金融资产支出	1,146,867.34
6.其他费用	319,508.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	11,720,290.81

注:本基金于2012年7月26日成立,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:汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2012年7月26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7月26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)	621,973,458.86	-	621,973,458.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,720,290.81	11,720,290.81
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)	-9.73	-0.08	-9.81
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-9.73	-0.08	-9.81
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)	621,973,449.13	11,720,290.73	633,693,739.86

注:本基金于2012年7月26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

汇添富季季红定期开放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")证监许可许可[2011]2031号文《关于核准汇添富季季红定期开放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6月14日至2012年7月20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_B06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7月26日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币621,837,618.81元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币135,840.05元,以上实收基金(本息)合计为人民币621,973,458.86元,折合621,973,458.86份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于固定收益类金融工具。本基金可投资于一级市场新股申购、股票增发以及可转债转股所得的股票或者权证等中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但不可直接从二级市场上买入股票和权证。本基金80%以上的基金资产投资于债券资产,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机,力争为基金资产获取稳健回报。本基金的业绩比较基准为:银行三年期定期存款税后利率+1%。

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7月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2012年7月26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期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、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投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(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划分为其他金融负债。

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

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。

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的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的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;

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;

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;

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;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方):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;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出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;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资,权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)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

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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,按最近交易日的收盘价估值;如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的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B.首次公开发行的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算;

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所 挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

D.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,按中国证监会相关规定处理;

2) 债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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,按最近交易日的收盘价估值;如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