

(上接B066版)

办公地址：上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼  
法定代表人：龚德雄  
联系人：张瑞  
客户服务电话：(021) 962518、4008918918（全国热线）  
公司网站：www.962518.com  
69)申银万国证券股份有限公司  
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场46层  
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层  
法定代表人：储晓明  
电话：021-33389888  
传真：021-33388224  
客服电话：96523或4008895623  
电话委托：021-962650  
网址：www.syywg.com  
电话委托：96523  
网址：www.syywg.com  
70)世纪证券有限责任公司  
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40—42层  
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40—42层  
法定代表人：卢长才  
联系人：袁媛  
电话：0755-83199611  
传真：0755-83199645  
网站：www.cscso.com.cn  
客服热线：0755-83199611  
71)万联证券有限责任公司  
注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层  
办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层  
法定代表人：张建军  
咨询电话：400-8888-133  
接收传真：020-22373718-1013  
联系人：王鑫  
联系电话：020-38286651  
邮箱：wangxin@wlzq.com.cn  
72)五矿证券有限公司  
注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元  
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室48层  
法定代表人：张永衡  
电话：0755-82545555  
公司网站：http://www.wkzq.com.cn/wkzq/web/index.aspx  
73)厦门证券有限公司  
地址：厦门市莲前西路2号  
客户服务电话：0692-5163588  
公司网站：www.xmzq.cn  
74)湘财证券有限责任公司  
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋

11层  
办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋  
11层  
法定代表人：林波  
电话：021-68634518  
传真：021-68665680  
联系人：赵小明021-68634510-8620  
客服电话：400-888-1561  
公司网站：www.xcsc.com  
75)新时代证券有限责任公司  
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
法定代表人：刘汝军  
开放式基金咨询电话：400-698-9898  
开放式基金业务传真：010-83561094  
联系人：孙伟  
联系电话：010-83561149  
网址：www.xsdzq.cn  
76)信达证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
法定代表人：张志刚  
联系人：唐静  
联系电话：010-63081000  
传真：010-63080978  
客服电话：400-800-8899  
公司网站：www.cindasc.com  
77)兴业证券股份有限公司  
注册地址：福州市湖东路268号  
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层  
法定代表人：兰荣  
客服电话：96662  
业务联系电话：0691-38162212  
公司网站：http://www.xyq.com.cn/xyzq/index.html  
78)中国银河证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
法定代表人：陈有安  
开放式基金咨询电话：400-688-8888  
开放式基金业务传真：010-66568990  
联系人：田薇  
联系电话：010-66568430  
网址：www.chinastock.com.cn  
79)招商证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层  
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层  
法定代表人：宫少林  
电话：0755-82943666  
传真：0755-82943636  
联系人：林建迎  
客户服务电话：96565或4008888111  
公司网站：www.newone.com.cn  
80)浙商证券有限责任公司  
注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6—7层  
办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6—7层  
电话：0671-87901908、0671-87901053  
传真：0671-87901913  
联系人：刘凯、谢明辉  
客户服务电话：0671-967777  
公司网站：www.stocke.com.cn  
81)中航证券有限公司  
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼  
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：王宜四  
电话：0791-86768681  
联系人：戴蕾  
客户服务电话：400-8866-567  
网址：www.avicsec.com  
82)中国国际金融有限公司  
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层  
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层  
法定代表人：金立群  
电话：010-65051166  
传真：010-86679535  
公司网站：http://www.cicc.com.cn  
83)中天证券有限责任公司  
注册地址：沈阳市和平区光荣街23甲  
办公地址：沈阳市和平区南五马路121号万丽城晶座4楼中天证券经纪业务部  
法定代表人：马功勋  
联系人：袁妙松  
联系电话：024-23280942  
客服电话：4006180315  
公司网站：www.stockren.com  
联系人：袁劲松  
94)中国中投证券有限责任公司  
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层、21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元  
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层  
法定代表人：龙增来  
联系人：刘毅  
电话：0755-82023442  
传真：0755-82026539  
网址：www.china-invs.cn  
客服电话：400-600-8008、95532  
85)中信建投证券股份有限公司  
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址：北京市朝阳区门内大街188号  
法定代表人姓名：王常青  
基金业务对外联系人：权恒  
联系电话：400-8888-108  
联系传真：010-65182261  
公司网站：www.csc.com.cn  
客服电话：400-8888-108  
86)中信证券（浙江）有限责任公司  
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层  
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层  
法人代表：沈强  
联系人：王茜露  
联系电话：95548  
公司网站：www.bigsun.com.cn  
87)中信证券（山东）有限责任公司  
注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广场1号楼20层（266061）  
办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广场1号楼20层（266061）

法定代表人：杨宝林基金业务联系人：吴思超  
电话：0532-86022326  
传真：0532-86022606  
客户服务电话：96548  
公司网址：www.citicssd.com  
88)中信证券股份有限公司  
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座  
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  
传真：010-60833739  
联系人：顾凌  
公司网址：www.cs.citic.com  
89)中银国际证券有限责任公司  
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层  
法定代表人：许刚  
联系人：李丹  
电话：021-68604866  
传真：021-50372474  
客户服务电话：021-68604866  
公司网站：www.bocichina.com  
90)中原证券股份有限公司  
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号  
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号  
法定代表人：菅明军  
联系人：程旭艳  
联系电话：0371-65858670  
联系传真：0371-65858665  
客服电话：967218（郑州市外客户需要加拨区号0371）、400-813-9666  
网址：www.ccnew.com  
91)天相投资顾问有限公司  
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701邮编：100032  
办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座505邮编：100088  
法定代表人：林义相  
联系人：尹伶  
联系电话：010-66045152  
客服电话：010-66045678  
传真：010-66045518  
天相视频网：http://www.txsec.com  
天相基金网站：www.jim.com.cn  
92)江苏金太阳证券投资咨询有限公司  
注册地址：无锡市滨湖区湖滨路99号  
办公地址：无锡市滨湖区湖滨路99号  
法定代表人：费晓燕  
电话：0510-82785877  
传真：0510-88655858  
93)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006  
公司地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006  
法定代表人：马令海  
订购热线：4009-945-899  
客服中心：0755-88390099  
传真号码：0755-88394677  
新兰德网站：http://www.new-rand.cn/  
94)和讯信息科技有限公司  
注册地址：北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层  
办公地址：北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层  
法定代表人：王利  
客服电话：400-920-0022  
联系人：周欣  
电话：021-20835789  
传真：021-20835885  
网址：itlake.hexun.com  
95)厦门市鑫鼎盛证券投资咨询有限公司  
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼  
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼  
法定代表人：林松  
联系人：高雷  
电话：0592-3122719  
传真：0592-8060771  
客户服务电话：400-6980-777  
网址：www.dhhs.com  
96)诺亚正行（上海）基金销售有限公司  
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室  
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801  
法定代表人：汪静波  
电话：021-38600735  
传真：021-38509777  
97)深圳众禄基金销售有限公司  
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单  
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单  
法定代表人：薛峰  
联系电话：0755-33227950  
客服电话：4006-788-887  
传真：0755-82067089  
联系人：童彩平  
网址：www.zlfund.cn及www.jimw.com  
98)上海天天基金销售有限公司  
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼  
注册资本：人民币伍千元  
法定代表人：其实  
电话：021-54509998  
传真：021-64385308  
99)上海好买基金销售有限公司  
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室  
办公地址：上海市浦东新区南汇新金桥1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室  
法定代表人：杨文斌  
电话：021-58870011  
传真：021-68596919  
公司网站：http://www.howbuy.com/  
100)杭州数米基金销售有限公司  
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号  
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人：陈柏青  
联系人：张裕  
电话：021-60897840  
传真：0571-26698933  
客服电话：4000-766-123  
网址：http://www.fund123.cn/  
101)浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室  
办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼  
邮编：310012  
联系人：胡蝶  
联系电话：0571-88911818  
传真：0571-86800423  
客服电话：4008-773-772  
公司网站：www.5ifund.com  
102)北京展恒基金销售有限公司  
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号  
办公地址：北京市朝阳区德胜门内大街北里2号民建大厦6层  
法定代表人：闫俊波  
电话：010-62020088  
网址：http://www.5ifund.com/  
103)上海利得基金销售有限公司  
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室  
办公地址：上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼  
法定代表人：盛大  
电话：021-50683533-3006  
传真：021-50683633  
客服电话：400-05-6365  
网址：www.leadfund.com.cn  
104)中期时代基金销售有限公司  
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层  
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层  
法定代表人：路瑶  
电话：010-65807865  
传真：010-65807868  
客服电话：951624008888160  
网址：www.citicofund.com  
105)北京创金启富投资管理有限公司  
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A  
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A  
法定代表人：梁睿  
电话：010-66154828  
传真：010-66154826  
客服电话：010-88067525  
网站：www.5irich.com  
106)泛普益基金销售有限公司  
注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室  
办公地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室  
法定代表人：于海峰  
电话：028-82000996  
传真：028-82000996-806  
客服电话：4008-588-588  
网站：http://www.pyfund.cn/  
107)万银财富（北京）基金销售有限公司  
注册地址：北京市朝阳区东三环中路27号院5号楼3201内3201单元  
办公地址：北京市朝阳区东三环中路27号院5号楼3201内3201单元  
法定代表人：王煜  
电话：010-59339323  
传真：010-59330774  
客服电话：400-608-0069  
网站：www.wy-fund.com  
108)北京增财基金销售有限公司  
住所：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室  
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室  
法定代表人：罗细安

电话：010-67000988  
传真：010-67000988-6000  
联系人：孙晋峰  
网址：www.zwcfund.com  
客户服务电话：400-001-8811  
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。  
（二）注册登记机构  
名称：汇添富基金管理股份有限公司  
住所：上海市浦东新区陆家嘴288号6楼538室  
办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼21楼  
法定代表人：李文  
电话：（021）28932888  
传真：（021）28932998  
联系人：韩从慧  
（三）律师事务所和经办律师  
名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人：韩朝  
电话：（021）31358666  
传真：（021）31358600  
经办律师：吕红、黎明  
联系人：吕红  
（四）会计师事务所和经办注册会计师  
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  
首席合伙人：吴港平  
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼16层  
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼安永大楼16层  
邮政编码：100738  
公司电话：（010）58153000  
公司传真：（010）85189238  
签字会计师：黄育华、汤媛  
业务联系人：黄育华  
四、基金的名称  
本基金名称：汇添富理财60天债券型证券投资基金。  
五、基金的类型  
本基金为债券型证券投资基金。  
六、基金的投资目标  
本基金在追求基金本金安全、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。  
七、基金的投资方向  
本基金投资于法律法规允许的投资品种包括：现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的央行银行票据、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。  
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。  
八、基金的投资策略  
（一）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限控制在180天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。  
1、利率策略  
本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券组合，并管理组合风险。  
首先通过全面分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求，判断宏观经济与流动性状况及其变化趋势，进而对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向进行研判，从而判断金融市场利率水平变动趋势，在此基础上，结合期限利差与凸度的综合分析，确定投资组合的久期配置，制定出具体的投资策略。  
具体而言，本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究宏观经济变量指标，分析宏观经济情况，建立经济前景的情景模拟，进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的情景模拟。  
在宏观分析与流动性分析的基础上，结合历史与经验数据，确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等因素，得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲线与零利率所面临的历史分位，然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线参数变动的程度和概率，确定组合的平均剩余期限，并据此动态调整投资组合。  
（二）信用策略  
本基金依靠内部信用评级体系跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，我们设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”-“公司风险”（公司背景+公司行业地位+企业盈利模式+公司治理结构和信息披露状况+企业财务状况）-“外部支持”（外部流动性支持能力+信贷支持增信）-“得到评分”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，它是定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。  
本基金内部的信用评级体系定位为短期评级，侧重于评级的准确性。因此，通过全面的信用分析，我们能够积极主动的挖掘到风险收益匹配、甚至存在超额收益的投资品种，为信用产品的实时交易提供参考。本基金还会对宏观经济、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，并快速做出反应，及时有效地抓住信用利差变化带来的市场交易机会。  
除了跟踪债券自身的信用变化以外，本基金还会定期研究各评级、各期限信用利差的变化趋势，分析它们的相对投资价值，确定各类债券的投资比例和期限选择。  
3、个券选择策略  
本基金认为普通债券的投资，主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并找出因投资者偏好、供求、流动性、信用利差等因素导致债券价格偏离的原因，同时，基于收益率曲线判断出定价偏高或偏低的情形，从而指导相对价值投资，选择出估值较低的债券品种。  
对于合同含条款的债券，本基金将仅买入距回售日不超过397天以内的债券，并在回售日前进行回售或者卖出。  
4、其他衍生工具投资策略  
本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向，一旦有新的产品推出市场，在履行适当程序后，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规通过利用其他衍生金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，并通过灵活运用投资策略获取投资收益。  
（二）投资决策依据和投资程序  
1、投资决策依据  
（1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；  
（2）国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响；  
（3）企业信用评级；  
（4）国家货币政策及债券市场政策；  
（5）商业银行的信贷扩张。  
2、投资决策机制  
本基金实行投资决策团队制，强调团队合作，充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究人员整合，设立了投资研究部，策略分析师、固定收益分析师、数量分析师和基金经理，充分发挥主观能动性，渗透到投资研究的关键环节，群策群力，为基金份额持有人谋求中长期稳定的较高投资回报。  
3、投资决策程序  
本基金具体的投资决策机制与流程为：  
（1）宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向，提交策略报告；  
（2）债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告；  
（3）信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。  
（4）数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析。  
（5）在分析研究部门的基础上，基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议。  
（6）投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。  
（7）如审议通过，基金经理在考虑资产配置的情况下，挑选合适的债券品种，灵活采取各种策略，构建投资组合。  
（8）基金交易室执行交易指令。  
（三）投资限制  
1、本基金不得投资于以下金融工具：  
（1）股票、权证；  
（2）可转换债券；  
（3）剩余期限（或回售期限）超过397天的债券；  
（4）信用等级在A+级以下的企业债券；  
（5）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；  
（6）非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；  
（7）中国证监会禁止投资的其他金融工具。  
法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。  
2、组合限制  
基金的投资组合应遵循以下限制：  
（1）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180天；  
（2）投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的10%；  
（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的10%；  
（4）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%；  
（5）存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；  
（6）本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%；  
（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金管理人管理的全部资产支持证券占同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金应投资于信用级别评级为AAA以上（含AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，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3个月内予以全部卖出；  
（8）本基金投资的短期融资券的信用评级，应不低于以下标准：  
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：  
1）国内信用评级机构评定的AA+级或相当于AA+级的长期信用级别；  
1）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评级（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个交易日予以全部减持。  
（9）中国证监会规定的其他比例限制。  
法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。  
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。  
基金管理人应当自基金合同生效之日起五日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。  
3、禁止行为  
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：  
（1）承销证券；  
（2）向他人贷款或提供担保；  
（3）从事承担无限责任的债务；  
（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；  
（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；  
（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；  
（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；  
（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。  
九、基金的业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为：7天通知存款税后利率。  
通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。  
如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。  
十、基金的风险收益特征  
本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。  
十一、基金的投资组合报告  
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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月23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。  
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。  
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	固定收益投资	199,829,145.17	51.36
	其中：债券	199,829,145.17	51.36
2	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	185,568,202.34	47.70
4	其他资产	3,641,962.02	0.94
5	合计	389,039,309.53	100.00

本报告期末2015年7月1日起至9月30日止。

投资组合报告

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	固定收益投资	199,829,145.17	51.36
	其中：债券	199,829,145.17	51.36
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	185,568,202.34	47.70
4	其他资产	3,641,962.02	0.94
5	合计	389,039,309.53	100.00

1.2 报告期末债券回购融资情况

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	4.80
	其中：买断式回购融资	-
项目	金额	占基金资产净值的比例（%）

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。  
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明  
注：本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”，本报告期内，本基金未发生超比例情况。  
1.3 投资组合平均剩余期限  
1.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	127
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	86

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	40.88	9.31
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.28	-
2	30天（含）-60天	5.64	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）-90天	14.16	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）-180天	14.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）-397天（含）	33.90	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	108.70	9.31

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	49,346,274.80	13.92
	其中：政策性金融债	49,346,274.80	13.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	150,482,870.37	42.44
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	199,829,145.17	56.36
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,358,349.38	8.28

1.5 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	120233	12国开33	300,000	29,358,349.38	8.28
2	041468095	14粤海02	200,000	20,194,917.41	5.70
3	041556016	15本外CP001	200,000	20,039,288.31	5.65
4	041569006	15鲁鲁工CP001	100,000	10,088,949.45	2.85
5	041556828	15金城1	100,000	10,079,682.94	2.84
6	041558003	15南商01	100,000	10,063,691.80	2.84
7	041554005	15金田PP	100,000	10,049,491.00	2.83
8	041551013	15华能CP001	100,000	10,000,282.12	2.82
9	041556032	15佰利联CP001	100,000	9,997,123.76	2.82
10	041556028	15舜乡城CP001	100,000	9,996,909.11	2.82

1.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.2%(含)-0.5%间的次数	41
报告期内偏离度的最高值	0.4120%
报告期内偏离度的最低值	-0.1337%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3113%

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。  
1.8 投资组合报告附注  
1.8.1

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

剩余期限内平均摊摊。

1.8.2  
本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

1.8.3  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.8.4  
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	3,641,962.02
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,641,962.02

十二、基金的业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书（本基金业绩数据为截至2015年9月30日的数字）。  
（一）本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表  
汇添富理财60天债券A

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)
2012年6月12日 (基金合同生效日) 至2012年12月31日	1.7722 %	0.0023 %	0.7514 %	0.0000 %	1.0208 %	0.0023 %
2013年1月1日至 2013年12月31日	4.6991 %	0.0047 %	1.3500 %	0.0000 %	3.3491 %	0.0047 %
2014年1月1日至 2014年12月31日	5.1456 %	0.0111 %	1.3500 %	0.0000 %	3.7956 %	0.0111 %
2015年1月1日至 2015年9月30日	3.3518 %	0.0105 %	1.0097 %	0.0000 %	2.3421 %	0.0105 %
2012年6月12日 (基金合同生效日) 至2015年6月30日	15.7891 %	0.0085 %	4.5350 %	0.0000 %	11.2541 %	0.0085 %