# 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金

## 【2013】半年度报告摘要

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8月26日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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2013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 | 汇添富季季红定期开放债券(场内简称:添富季红) |
| 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 | 621,973,430.09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层汇添富基金管理有限公司 |

§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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 18,886,794.19 |
| 本期利润 | 25,359,404.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0408 |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.04% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0286 |
| 期末基金资产净值 | 649,723,522.57 |
| 期末基金份额净值 | 1.045 |

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。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.00% | 0.07% | 0.41% | 0.02% | -0.41% | 0.05% |
| 过去三个月 | 1.74% | 0.07% | 1.26% | 0.02% | 0.48% | 0.05% |
| 过去六个月 | 4.04% | 0.07% | 2.55% | 0.02% | 1.49% | 0.05% |
| 自基金合同生效日起至今 | 6.02% | 0.07% | 4.88% | 0.02% | 1.14% | 0.05% |

注:1、本基金的《基金合同》生效日为2012年7月26日,至本报告期末未满一年。

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:1、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,基金成立未满一年。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,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

2、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%。

§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由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金戎控股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,注册资本金为1亿元人民币。截止到2013年6月30日,公司管理证券投资基金规模逾650亿元,基金份额持有人户数近200万,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理33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(A级、B级)、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、汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选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、汇添富保本混合型证券投资基金、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、汇添富理财28天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。

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 | 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,汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理,汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理,固定收益投资副总监。 | 2012年7月26日 | - | 11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,现任固定收益投资副总监。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2013年2月7日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,2012年12月31日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理。 |

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,基金管理人对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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保同同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。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,分别是由于基金流动性需要、专户组合到期清算卖出证券所致。

本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

2013年上半年美国经济维持稳步复苏,就业和房地产市场继续好转,欧债危机处于可控范围,全球主要央行维持宽松政策,但二季度以后市场对美联储退出量化宽松的预期逐渐增强,美国债券收益率明显上升,资金回流美国的迹象也较为明显,股市和商品市场波动加剧。国内经济运行低于预期,内外需增长均出现放缓态势,二季度GDP增速降至7.5%,通胀压力保持低位运行,PPI已连续16个月负增长。上半年流动性前松后紧,1-5月份流动性环境较为宽松,6月份受半年末效应和外汇占款大幅波动等因素影响,资金面出现极度紧张,回购利率创出历史新高。

上半年债券市场表现较好,中债综合指数上涨2.34%,各类债券均有不同幅度上涨,信用债表现显著好于利率债,二季度以后市场波动有所加剧,6月份受资金面紧张冲击,债券收益率明显上升,收益率曲线平坦化上移。本基金上半年采取了较为积极的配置策略,维持信用债高比例配置,较好分享了债券市场上涨的收益,可转债以阶段投资为主,6月份以后受股市大幅下跌的影响,可转债对组合净值造成了一定拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为4.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着美国经济继续复苏,下半年美联储何时正式开始退出QE将越来越成为市场关注焦点,全球流动性格局和资金流向的改变对市场的影响值得密切关注。国内经济继续处于调结构、去产能的转型过程中,政府对经济增速偏低的容忍度会有所提高,在内需和外需均偏弱的情况下,下半年经济增存在继续回落的可能,但如果经济下滑速度过快,政策将出台一些刺激政策进行应对。下半年物价有望继续保持低位运行,PPI可能维持负增长,全年CPI超过3%的可能性很小。货币政策取向将维持中性,降息的可能性较低,如果外行占款下降较快,存在降准可能,下半年监管层对银行表外业务的监管力度可能逐渐加强,金融机构存在降杠杆压力,市场资金面可能比上半年有所收紧,回购融资成本将有所提高。总体判断,下半年偏弱的经济基本面环境对债券市场依然有利,但资金面的不确定性可能加剧市场波动。信用利差目前依然维持在低位,但考虑到信用债较高的票息,依然具备一定的持有价值,需要关注的是在经济下行的背景下信用事件出现的频率会明显增加,对信用债可能造成结构性的冲击。本管理人将密切关注经济基本面的走势和政策变化积极调整组合结构,更多关注绝对收益,积极把握利率债和可转债的投资机会,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、产品创新部、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签订了《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。

本基金于2013年4月12日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.15元人民币。

§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,本基金实施利润分配的金额为9,329,602.02元。

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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 511,348.40 | 315,055.06 |
| 结算备付金 | 34,090,927.24 | 15,255,941.44 |
| 存出保证金 | 10,652.10 | - |
| 交易性金融资产 | 1,009,162,464.84 | 878,769,862.84 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 989,192,464.84 | 878,769,862.84 |
| 资产支持证券投资 | 19,970,000.00 | - |
| 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 | 24,059,734.14 | 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 | 1,067,835,126.72 | 937,948,727.63 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 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 | 416,699,687.80 | 302,974,509.14 |
| 应付证券清算款 | 202,580.91 | 270,418.04 |
| 应付赎回款 | 0.27 | - |
| 应付管理人报酬 | 320,985.55 | 321,072.77 |
| 应付托管费 | 106,995.18 | 107,024.24 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 6,489.91 | 1,765.00 |
| 应交税费 | 384,000.00 | 384,000.00 |
| 应付利息 | 152,836.86 | 56,198.58 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 238,027.67 | 140,000.00 |
| 负债合计 | 418,111,604.15 | 304,254,987.77 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 621,973,430.09 | 621,973,449.13 |
| 未分配利润 | 27,750,092.48 | 11,720,290.73 |
| 所有者权益合计 | 649,723,522.57 | 633,693,739.86 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,067,835,126.72 | 937,948,727.63 |

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.045元,基金份额总额621,973,430.09份。

6.2 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:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | 35,038,176.77 |
| 1.利息收入 | 22,000,480.84 |
| 其中:存款利息收入 | 277,583.82 |
| 债券利息收入 | 21,656,310.72 |
| 资产支持证券利息收入 | 66,586.30 |
| 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) | 6,565,085.70 |
| 其中:股票投资收益 | - |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | 6,565,085.70 |
| 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) | 6,472,610.23 |
| 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 | 9,678,772.35 |
| 1.管理人报酬 | 1,917,669.33 |
| 2.托管费 | 639,223.12 |
| 3.销售服务费 | - |
| 4.交易费用 | 6,565.02 |
| 5.利息支出 | 6,844,475.34 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 6,844,475.34 |
| 6.其他费用 | 270,839.54 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 25,359,404.42 |

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,因此利润表只列示本期数据,特此说明。

6.3 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:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013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) | 621,973,449.13 | 11,720,290.73 | 633,693,739.86 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 25,359,404.42 | 25,359,404.42 |
| 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) | -19.04 | -0.65 | -19.69 |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | -19.04 | -0.65 | -19.69 |
| 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) | - | -9,329,602.02 | -9,329,602.02 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 621,973,430.09 | 27,750,092.48 | 649,723,522.57 |

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)变动表只列示本期数据,特此说明。

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:

林利军 陈灿辉 王小练

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

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%。

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。

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2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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相一致的说明

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。

6.4.5 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、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。

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、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

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、证监会财税[2012]85号《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,对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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 |
|---|---|
| 汇添富基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 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 |
| 东航金戎控股有限责任公司 | 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 |
| 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 | 基金管理人的子公司 |

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:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 166,227,976.26 | 100.00% |

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 2013年1月1日至2013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 |
| 东方证券股份有限公司 | 32,407,700,000.00 | 100.00% |

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

注:本基金本期未有应支付关联方的佣金。

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 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,917,669.33 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 236,306.14 |

注:基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.60%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 639,223.12 |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,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:本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券(回购)交易。

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

注:本基金的基金管理人本报告期内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:本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

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 2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 511,348.40 | 52,251.32 |

注:由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

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:本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2013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

6.4.12.1.2 受限证券类别:债券

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 123470 | 13民族债 | 2013年6月7日 | 2013年7月8日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 112172 | 13晋邦债 | 2013年5月14日 | 2013年7月12日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 112178 | 12墨龙01 | 2013年6月13日 | 2013年7月23日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 112180 | 12奥飞债 | 2013年6月14日 | 2013年7月23日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌股票。

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

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,基金从事上海证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额266,700,000.00元,于2013年7月1日和2013年7月5日到期;从事深圳证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额149,999,687.80元,于2013年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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 | 1,009,162,464.84 | 94.51 |
| | 其中:债券 | 989,192,464.84 | 92.64 |
| | 资产支持证券 | 19,970,000.00 | 1.87 |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 34,602,275.64 | 3.24 |
| 6 | 其他各项资产 | 24,070,386.24 | 2.25 |
| 7 | 合计 | 1,067,835,126.72 | 100.00 |

7.2 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。

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:本基金本报告期末未持有股票。

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:本基金本报告期未投资股票。

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:本基金本报告期未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期未投资股票。

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