

# 汇添富理财 7 天债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 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 2018 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 2017 年 1 月 1 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 7 天债券	
基金主代码	471007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,978,470,524.21 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 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
下属分级基金的交易代码:	471007	472007
报告期末下属分级基金的份额总额	206,568,822.52 份	10,771,901,701.69 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全，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	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控制在 127 天内。在控制利率风险的，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	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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭明
	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
基金年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 楼 汇添富基金管理股份有限公司

## § 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

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）

3.1.1 期间 数据 和指 标	2017 年		2016 年		2015 年	
	汇添富理财 7 天 债券 A	汇添富理财 7 天债 券 B	汇添富理财 7 天 债券 A	汇添富理财 7 天债 券 B	汇添富理财 7 天 债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
本期 已实 现收 益	10,647,531.49	272,595,252.64	10,585,947.98	2,403,260.13	19,204,199.25	6,907,150.94
本期 利润	10,647,531.49	272,595,252.64	10,585,947.98	2,403,260.13	19,204,199.25	6,907,150.94
本期 净值 收益 率	3.8713%	4.3276%	2.7944%	3.2478%	3.9278%	4.3863%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	期末 基金 资产 净值	10,771,901,701.69	302,754,405.95	2,005,214,723.86	406,876,238.20	167,265,962.92
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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 7 天债券 A

阶段	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	------	-------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	1.0042%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.6639%	0.0004%
过去六个月	1.9715%	0.0006%	0.6805%	0.0000%	1.2910%	0.0006%
过去一年	3.8713%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	2.5213%	0.0018%
过去三年	10.9678%	0.0059%	4.1049%	0.0000%	6.8629%	0.0059%
过去五年	17.2047%	0.0066%	5.7484%	0.0000%	11.4563%	0.0066%
自基金合同生效日起至 今	19.7450%	0.0065%	6.3572%	0.0000%	13.3878%	0.0065%

汇添富理财 7 天债券 B

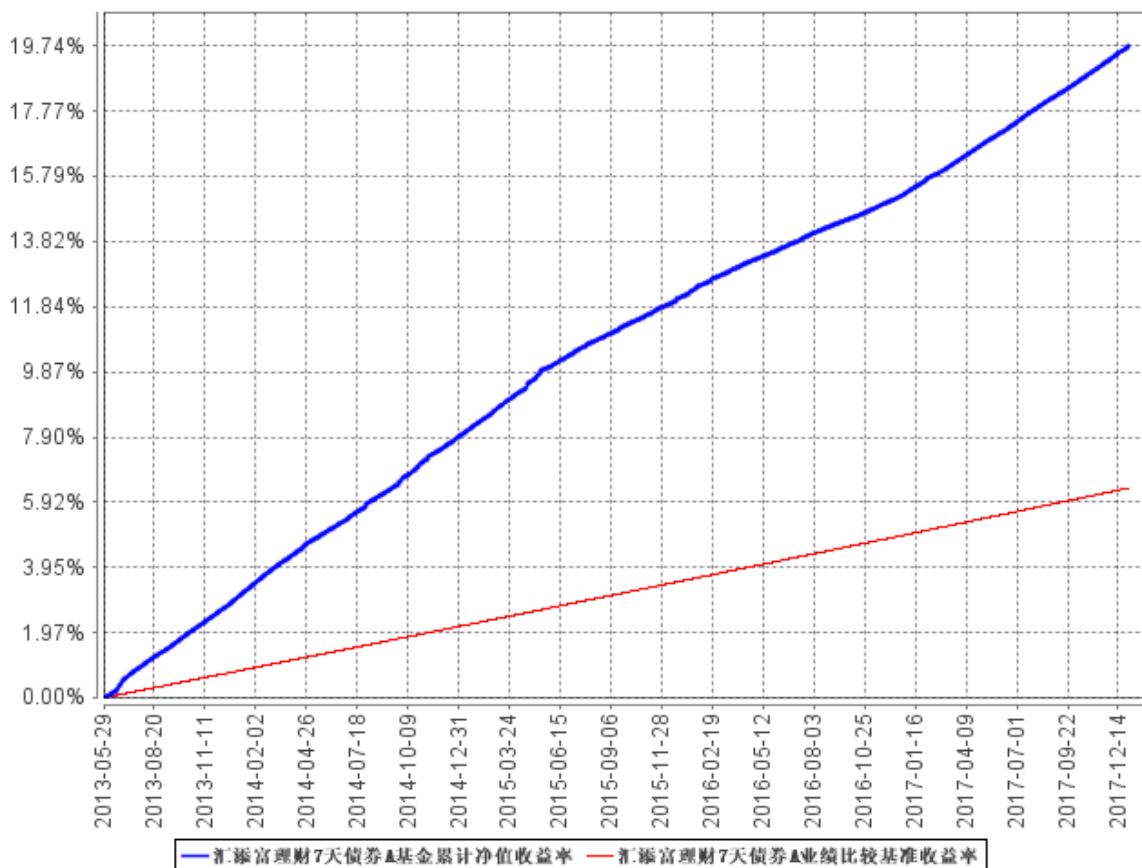
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标准差②	业绩比较 基准收益率③	业绩比较基 准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.1165%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.7762%	0.0004%
过去六个月	2.1981%	0.0006%	0.6805%	0.0000%	1.5176%	0.0006%
过去一年	4.3276%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.9776%	0.0019%
过去三年	12.4407%	0.0059%	4.1049%	0.0000%	8.3358%	0.0059%
过去五年	19.3718%	0.0066%	5.7484%	0.0000%	13.6234%	0.0066%
自基金合同生效日起至 今	22.1873%	0.0065%	6.3572%	0.0000%	15.8301%	0.0065%

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。

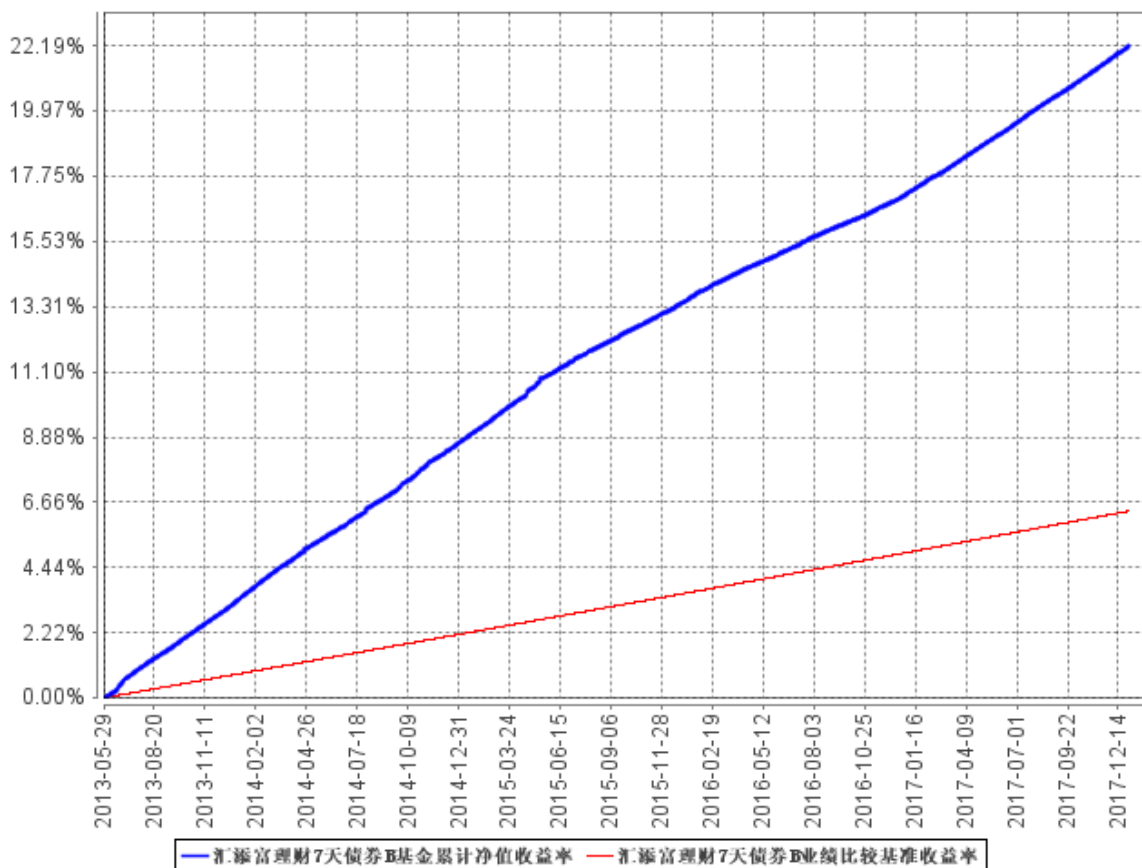
2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

### 汇添富理财7天债券A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 汇添富理财7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

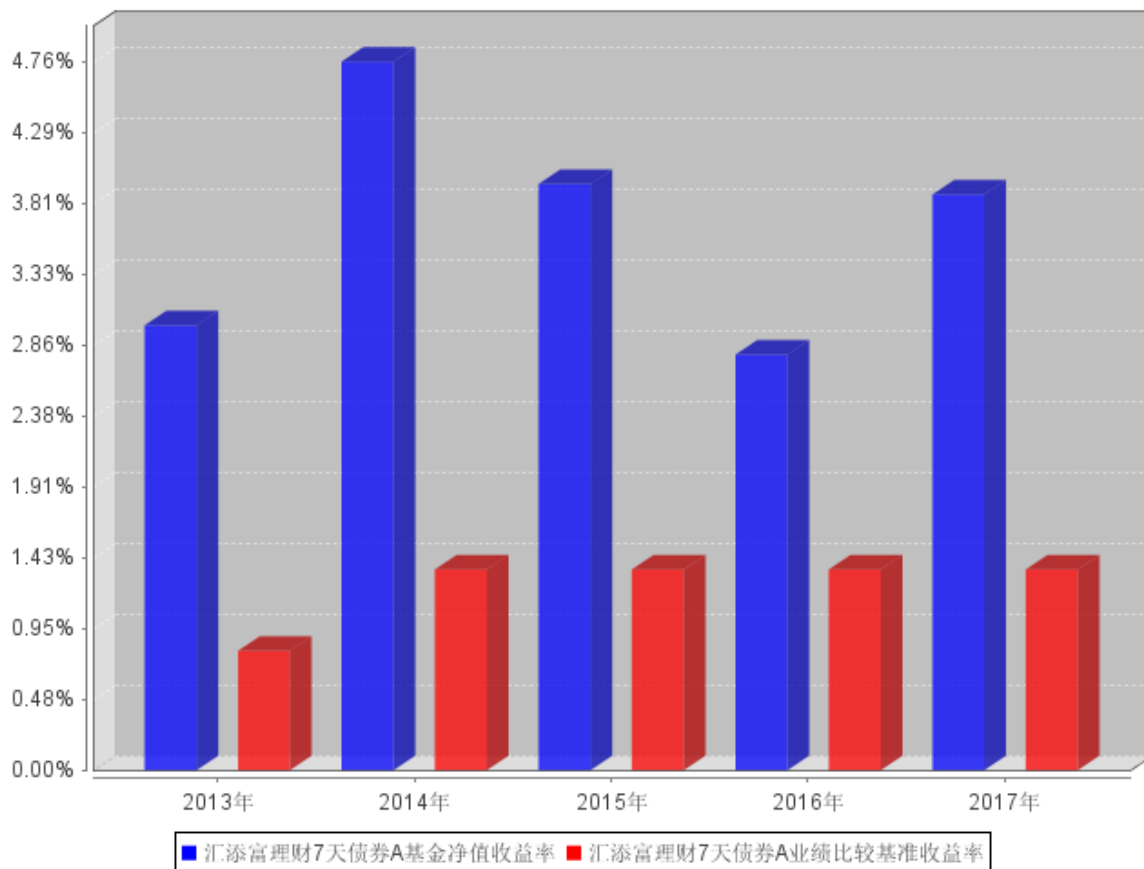


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年5月29日）起5日，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

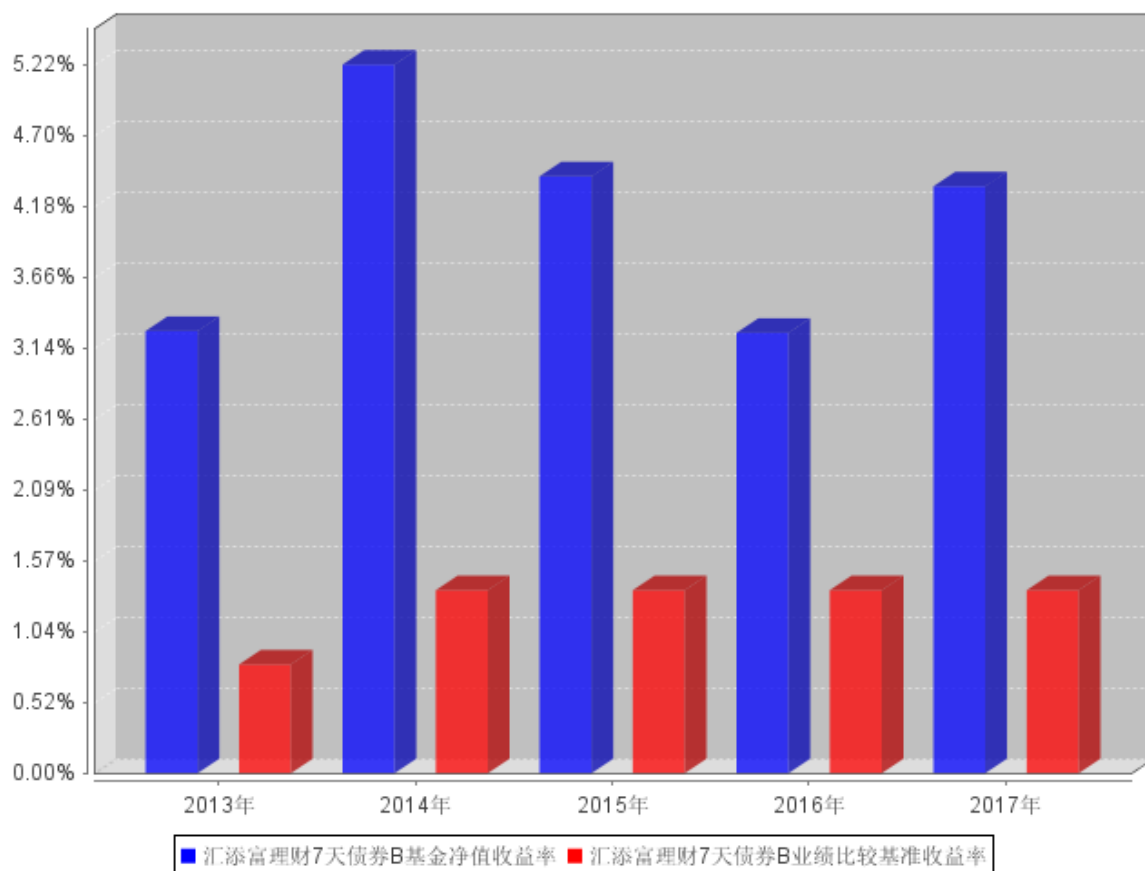


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财7天债券A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对比图



汇添富理财7天债券B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对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29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7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
2017	10,057,406.37	593,020.19	-2,895.07	10,647,531.49	
2016	9,809,488.91	736,550.50	39,908.57	10,585,947.98	
2015	17,716,627.95	1,740,655.41	-253,084.11	19,204,199.25	
合计	37,583,523.23	3,070,226.10	-216,070.61	40,437,678.72	
汇添富理财7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
2017	256,770,789.14	11,102,586.70	4,721,876.80	272,595,252.64	
2016	1,469,439.22	99,584.33	834,236.58	2,403,260.13	
2015	6,260,367.81	681,385.01	-34,601.88	6,907,150.94	
合计	264,500,596.17	11,883,556.04	5,521,511.50	281,905,663.71	

## § 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

目前，汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至 2017 年 12 月 31 日，汇添富资产管理总规模超过 5500 亿元，其中公募资产管理规模（剔除货基口径）1892 亿元，位居行业第 7；服务客户超过 6000 万人。根据银河证券基金研究中心数据，汇添富旗下股票基金最近 3 年、5 年的股票投资主动管理平均收益率分别达到 89.86%、184.98%，在公募规模（不含货基）前十大基金公司中均排名第一。优秀的业绩赢得了行业与市场的高度认可。2017 年，汇添富基金荣获“金基金·TOP 公司奖”、“三年持续回报明星基金公司”、“优秀资产管理机构”等奖项，汇添富价值精选、汇添富民营活力荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，汇添富上海国企 ETF 荣获“上海金融创新成果奖”，“添富智投”荣登“2017 中国智能投顾新锐榜”。

2017 年，汇添富基金新发行 22 只公募基金，包括 11 只混合型基金，5 只指数基金，3 只债券基金以及 3 只 QDII 基金。其中，上证上海改革发展主题 ETF 为助力国企改革创新产品，汇添富全球移动互联混合基金和汇添富全球医疗保健混合基金布局海外市场，进一步丰富完善了公司的国际产品线。全年，公司管理公募基金产品达到 97 只，涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品，为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2017 年，汇添富基金大力发展自有平台建设，不断引领行业创新。全年推出多款树立行业标杆的拳头功能：添富智投、添富养老、汇闪付、工资宝、理财日历、在线客服机器人等。规模稳定在千亿级别，服务客户数量超 5000 万，处于行业领先水平。与此同时，互联网金融对外合作业务取得重大突破。截至年底，对外合作伙伴数量已超 80 家，成为业内对外合作最多的公司之一。

2017 年，汇添富基金稳步推行大机构战略，截至年底，公司机构理财总部保有规模达 2900 亿元；获得全国社保基金及基本养老保险基金投资管理资格，社保基金和基本养老保险基金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量持续增加。

2017 年，公司积极开展渠道销售和培训工作，专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动，营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2017 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提高客服体验。

2017 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，深入发掘港股价值洼地，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年五星评级，在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一；汇添富港币债券基金获得晨星三年四星评级，在同类型基金中持续名列第一。社保海外组合业绩在所有社保管理人中排名第一。

2017 年，公司公益事业蓬勃发展，公益活动精彩纷呈，公益品牌建设更上一个台阶。一是依托公司旗下上海汇添富公益基金会的专业平台，连续第十年开展“河流·孩子”公益助学计划，并成立“河流·孩子”公益助学联盟，将项目的平台化建设推向新的高度。二是将公益事业与公司党建结合，催生出新活力和亮点。公司党委下属的八个党支部分别与各地“添富小学”建立结对关系，党员们通过实地探访，了解学校实际困难和发展需求，积极寻求社会公益资源给予帮助。三是持续开展“河流·孩子”相关品牌活动，延续爱心传递温暖。持续开展“河流·孩子”公益助学计划，组织 100 名添富小学乡村一线教师分赴上海苏州参加专业教师培训；继续组织西部助学公益活动，邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”参加公益服务；继续举办海外留学志愿者支教，帮助山区孩子打开的视野。其余员工公益活动持续精彩纷呈，向公司员工发售筹款台历、参加沪上知名的群众性公益活动——一个鸡蛋的暴走筹款 4 万多元，作为“添富小学”多媒体教室建设费用等。

2018年，资产管理行业面临重大行业变革期：混业竞争格局下严格依法从严监管；资管业务回归本源，短期业务失去快速扩张的土壤；互联网与金融的融合与碰撞将重构现有行业发展格局；港股通、沪伦通的发展，带动了A股国际化也进一步带来新的机遇与挑战。汇添富基金将始终坚信长期的力量，开拓进取、奋勇前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

#### 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		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快线货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理。	2014年8月27日	-	9年	国籍：中国。学历：复旦大学法学学士。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014年8月27日至今任汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理；2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理；2014年12月23日至今任汇添富收益快钱货币基金基金经理；2016年6月7日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。
陶然	汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币基金的基金经理，汇添富收益快线货币基金、汇添富和聚宝货币	2016年9月9日	-	7年	国籍：中国，学历：法国图卢兹国立综合理工学院信息系统与软件开发硕士、法国图卢兹第一大学金融工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格、CFA。从业经历：曾任海富通基金、华安基金债券交易员，2016年9月加入汇添富基金管

	基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财 7 天债券基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理助理。			理股份有限公司，2016 年 9 月 9 日至今任汇添富收益快线货币基金、汇添富和聚宝货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财 7 天债券基金的基金经理助理，2016 年 9 月 13 日至今任汇添富收益快钱货币基金的基金经理助理，2017 年 9 月 7 日至今任汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币基金的基金经理。
--	---	--	--	---

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、本基金管理人于 2017 年 3 月 2 日公告，本基金的基金经理徐寅喆女士于 2017 年 3 月 1 日至 8 月 31 日休产假及年假，无法正常履行职务。依据法律法规及公司制度规定，本公司研究决定，徐寅喆女士休假期间，本基金的投资管理工作由基金经理陆文磊先生代为履行职责。

徐寅喆女士已于 2017 年 8 月 11 日结束休假，恢复履行本基金的基金经理职务。本基金管理人已于 2017 年 8 月 19 日就上述事项进行公告。

## 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、境外投资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，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、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。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。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等相关部门组成，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风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有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，根据95%置信区间下差价率的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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 11 次，均是因为投资策略原因，并经过公司内部风控审核。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

2017 年世界经济增长明显回升，以美国、欧元区和日本为代表的发达经济体增速普遍提升。由于处在不同的发展与复苏阶段，因此全球主要央行的货币政策存在一定的差异。美联储全年完成 3 次加息，同时于 10 月启动缩表，并认为经济的增长将继续支持未来美联储渐进加息。欧洲央行目前仍处于量化宽松的中期，尚未有加息安排，但正在大幅放缓购债计划。相对而言，日本央行是目前全球主要经济体中最偏鸽派的央行，继续坚持宽松的货币政策以期能达到设定的通胀目标。

面对国际政治和经济形势的日益多样化和复杂化，2017 年以来中国经济运行稳中向好，全年 GDP 同比增长 6.9%，实现经济较快增长，同时物价较为平稳，CPI 同比上涨 1.6%。消费需求对经济增长的拉动作用保持强劲，投资增长稳中略缓、结构优化，进出口较快增长。回顾 2017 年，经济韧性超市场预期，我国经济正经历从经济高增速阶段到高质量发展阶段，产业结构优化，消费升级延续。同时，金融监管、地产调控、供给侧改革成为贯穿 2017 年的三大主线，以实现政府防范风险、抑制资产泡沫、化解产能过剩等目标。

2017 年海外货币政策普遍由宽松转向中性至收紧，国内经济基本面韧性较强，在严监管，去杠杆，资金面紧平衡的大环境下，债券市场整体呈现震荡熊市格局。一季度央行上调公开市场操作和 MLF 利率，叠加春节与 3 月底 MPA 考核因素使得年初即将全年的资金利率中枢抬升。二季度债市迎来一轮“监管风暴”，银监会开启针对银行体系内“三违反”、“三套利”、“四不当”的专项治理，市场对银行表内外资产收缩的担忧使得利率快速上行。三季度央行继续积极落实稳健中性的货币政策，通过多种流动性工具将流动性保持在中性偏紧状态，以维持稳增长与去杠杆之间的平衡。四季度资管新规、流动性风险管理新规等监管政策的出台不仅对当前市场，更是对行业未来格局产生了深远的影响。

操作上，本基金始终将信用风险把控列为首位，在流动性整体呈现紧平衡的大背景下，采取相对灵活的投资策略，调整组合久期，严格控制组合的现券比例与风险敞口。根据资金面变化情况配置足额到期资产应对关键时点的流动性需求。同时，通过适度的杠杆操作提高组合收益，主动把握短期利率阶段性大幅走高的机会，在控制组合风险的前提下为持有人获取稳定回报。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末理财 7 天债券 A 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.8713%；截至本报告期末理财 7 天债券 B 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.3276%；同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，全球经济回暖上行，中国经济基本面长期向好的趋势没有改变。当前经济已由高速增长阶段转向高质量发展阶段，货币政策需要更好平衡稳增长、调结构、促改革、去杠杆和防风险之间的关系，预料货币政策将继续保持稳健中性的态势。通胀方面，受去产能、环保督查、大宗商品价格上升、2017 年 CPI 低基数等叠加影响，通胀水平可能存在小幅上升压力，但预计总体保持稳定。监管政策方面，防范化解金融风险、严控金融体系内部空转套利、助力金融回归服务于实体经济的本源仍会是 2018 年的政策主线，严监管的态势预计仍将延续，政策落地的宏观效应将会长远影响金融机构未来的运行格局。

从流动性管理角度分析，央行未来预计仍将延续“不松不紧”的原则，灵活运用多种货币政策工具组合，通过“削峰填谷”熨平临时性因素对流动性的扰动，维持稳健中性基调不变。在去杠杆的大背景下，流动性不会出现过于宽松的局面，市场也较难形成对于未来宽松的一致预期。在货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架下，整体流动性格局将呈现平衡状态，但应警惕短期和关键时点流动性边际收紧的风险。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，做好债券、同业存单与定期存款之间的资产配置以及比例的动态调整。同时，严防信用风险，规避高风险个券。组合将延续积极的投资策略，保持投资收益吸引力，为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

#### 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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《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》、

《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止)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验,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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

本基金期初应付收益 995,076.05 元,本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日期间累计分配收益 283,242,784.13 元,其中人民币 266,828,195.51 元以红利再投资方式结转入实收基金,人民币 11,695,606.89 元因基金赎回而支付给投资者,其余人民币 5,714,057.78 元为期末应付收益。

#### 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

无。

## § 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，本基金托管人在对汇添富理财 7 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》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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

本报告期内，汇添富理财 7 天债券型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富理财 7 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股份有限公司编制和披露的汇添富理财 7 天债券型证券投资基金 2017 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(特殊普通合伙)审计,注册会计师陈露、陈军于2018年3月27日签字出具了安永华明(2018)审字第60466941\_B30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7天债券型证券投资基金

报告截止日: 2017年12月31日

单位: 人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产:</b>		
银行存款	7,190,559,612.99	2,171,048,123.72
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,392,575,333.28	189,637,036.03
其中: 股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,392,575,333.28	189,637,036.03
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	456,975,125.47	64,880,457.32
应收证券清算款	-	-
应收利息	46,918,702.71	3,980,044.97
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	11,087,028,774.45	2,429,545,662.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016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	99,974,730.04	119,997,420.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,798,682.81	119,336.85
应付托管费	532,943.05	35,359.06
应付销售服务费	145,923.36	124,032.77
应付交易费用	34,886.76	12,871.76
应交税费	-	-
应付利息	87,726.44	23,135.74
应付利润	5,714,057.78	995,076.05
递延所得税负债	-	-
其他负债	269,300.00	269,300.00
负债合计	108,558,250.24	121,576,532.23
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	10,978,470,524.21	2,307,969,129.81
未分配利润	-	-
所有者权益合计	10,978,470,524.21	2,307,969,129.81
负债和所有者权益总计	11,087,028,774.45	2,429,545,662.04

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.00元，基金份额总额

10,978,470,524.21份，其中下属A类基金份额总额206,568,822.52份；下属B类基金份额总额10,771,901,701.69份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富理财7天债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
<b>一、收入</b>	314,158,100.90	17,257,660.59
1.利息收入	314,992,672.73	15,723,111.27
其中：存款利息收入	247,471,214.88	7,344,099.54
债券利息收入	65,872,761.22	7,919,521.43
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,648,696.63	459,490.30
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-834,571.83	1,534,549.32
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-834,571.83	1,534,549.32
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）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>30,915,316.77</b>	<b>4,268,452.48</b>
1. 管理人报酬	18,038,998.06	1,205,855.28
2. 托管费	5,344,888.25	357,290.48
3. 销售服务费	1,912,118.47	1,735,767.76
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	5,245,563.70	626,769.45
其中：卖出回购金融资产支出	5,245,563.70	626,769.45
6. 其他费用	373,748.29	342,769.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>283,242,784.13</b>	<b>12,989,208.11</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富理财7天债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	2,307,969,129.81	-	2,307,969,129.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	283,242,784.13	283,242,784.13
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）	8,670,501,394.40	-	8,670,501,394.40
其中：1. 基金申购款	23,718,082,348.38	-	23,718,082,348.38
2. 基金赎回款	-15,047,580,953.98	-	-15,047,580,953.98

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）	-	-283,242,784.13	-283,242,784.13
五、期末所有者权益（基金净值）	10,978,470,524.21	-	10,978,470,524.21
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	574,142,201.12	-	574,142,201.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	12,989,208.11	12,989,208.11
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）	1,733,826,928.69	-	1,733,826,928.69
其中：1. 基金申购款	3,294,187,857.58	-	3,294,187,857.58
2. 基金赎回款	-1,560,360,928.89	-	-1,560,360,928.89
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）	-	-12,989,208.11	-12,989,208.11
五、期末所有者权益（基金净值）	2,307,969,129.81	-	2,307,969,129.81

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

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 7 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[2013]238 号文《关于核准汇添富理财 7 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（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集。基金合同于 2013 年 5 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 2,985,787,730.07 份基金份额。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

与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为现金、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、中期票据、资产支持证券、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本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的投资目标为追求本金安全、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。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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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相一致。

#### 7.4.5 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 增值税

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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 7.4.6.2 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[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。

#### 7.4.6.3 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。

### 7.4.7 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	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
上海上报资产管理有限公司	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
汇添富资本管理有限公司	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

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,038,998.06	1,205,855.28
其中：支付销售机构的客户维护费	335,806.28	475,049.67

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.27%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,344,888.25	357,290.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前2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、公休日等，支付日期顺延。

**7.4.8.2.3 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富理财 7 天 债券 A	汇添富理财 7 天债 券 B	合计
东方证券股份有限公司	2,981.44	0.00	2,981.44
中国工商银行股份有限公司	594,718.38	297.34	595,015.72
汇添富基金管理股份有限公司	160,740.53	638,611.62	799,352.15
合计	758,440.35	638,908.96	1,397,349.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富理财 7 天 债券 A	汇添富理财 7 天债 券 B	合计
东方证券股份有限公司	4,409.88	-	4,409.88
中国工商银行股份有限公司	779,634.68	787.79	780,422.47
汇添富基金管理股份有限公司	173,706.79	2,552.71	176,259.50
合计	957,751.35	3,340.50	961,091.85

注：本基金各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，A 类基金的基金销售服务费按前一日 A 类基金资产净值的 0.45% 的年费率计提；B 类基金的基金销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日			
银行间市场交易	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	832,349,000.00	82,511.95
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	25,000,000.00	3,965.75

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	559,612.99	20,353.93	27,048,123.72	9,527.52

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 99,974,730.04 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170410	17 农发 10	2018 年 1 月 11 日	99.79	1,075,000	107,279,111.41
合计				1,075,000	107,279,111.41

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

##### 7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金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中属于第二层次的余额为人民币 3,392,575,333.28 元，无划分为第一层次及第三层次的余额。

（于 2016 年 12 月 31 日，本基金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中属于第二层次的余额为人民币 189,637,036.03 元，无划分为第一层次及第三层次的余额）。

##### 7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### 7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

##### 7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 21 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	固定收益投资	3,392,575,333.28	30.60
	其中：债券	3,392,575,333.28	30.60
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	456,975,125.47	4.12
	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	7,190,559,612.99	64.86
4	其他各项资产	46,918,702.71	0.42
5	合计	11,087,028,774.45	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	2.70	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	99,974,730.04	0.91
	其中：买断式回购融资	-	-

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，本基金未发生超标情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金合同约定：“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 127 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

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	11.27	0.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	48.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	13.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	9.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.56	0.91

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

## 8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	558,569,546.30	5.09
	其中：政策性金融债	558,569,546.30	5.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,037,521.20	0.91
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,733,968,265.78	24.90
8	其他	-	-
9	合计	3,392,575,333.28	30.90
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111789512	17 宁波银行 CD227	5,000,000	496,448,353.39	4.52
2	170410	17 农发 10	3,000,000	299,383,566.73	2.73
3	111716259	17 上海银行 CD259	3,000,000	297,926,441.00	2.71
4	111770376	17 宁波银行 CD234	3,000,000	297,381,803.93	2.71
5	170211	17 国开 11	2,600,000	259,185,979.57	2.36
6	111783816	17 九江银行 CD128	2,000,000	198,458,525.64	1.81
7	111771208	17 重庆银行 CD194	2,000,000	197,905,927.19	1.80
8	111711540	17 平安银行 CD540	1,500,000	148,227,469.80	1.35
9	111796535	17 四川天府银行 CD065	1,100,000	109,648,107.14	1.00
10	111786618	17 江苏江南农村商业银行 CD153	1,000,000	99,795,474.99	0.91

## 8.7 “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 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1947%
报告期内偏离度的最低值	-0.0619%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0259%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

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销。

### 8.9.2

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。

### 8.9.3 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	-
3	应收利息	46,918,702.71
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	46,918,702.71

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
汇添富理财 7 天债券 A	6,690	30,877.25	32,557.75	0.02%	206,536,264.77	99.98%
汇添富理财 7 天债券 B	24	448,829,237.57	10,751,394,221.29	99.81%	20,507,480.40	0.19%
合计	6,714	1,635,160.94	10,751,426,779.04	97.93%	227,043,745.17	2.07%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富理财 7 天债券 A	18,300.28	0.0089%
	汇添富理财 7 天债券 B	0.00	0.0000%
	合计	18,300.28	0.0002%

### 9.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富理财 7 天债券 A	0
	汇添富理财 7 天债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富理财 7 天债券 A	0
	汇添富理财 7 天债券 B	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
基金合同生效日（2013 年 5 月 29 日）基金份额总额	2,164,467,560.24	821,320,169.83
本报告期期初基金份额总额	302,754,405.95	2,005,214,723.86
本报告期基金总申购份额	979,952,797.41	22,738,129,550.97
减:本报告期基金总赎回份额	1,076,138,380.84	13,971,442,573.14
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	206,568,822.52	10,771,901,701.69

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 11.2 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. 《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年1月25日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。
2. 基金管理人于2017年2月4日公告，增聘欧阳沁春先生和杨璿先生担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
3. 《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于2017年3月13日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
4. 基金管理人于2017年3月10日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。
5. 《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2017年3月15日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
6. 基金管理人于2017年3月16日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。
7. 《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于2017年3月20日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
8. 《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年4月14日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
9. 《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于2017年4月20日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。
10. 《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年4月20日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
11. 《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2017年4月20日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
12. 《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年5月15日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于2017年5月20日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。
14. 基金管理人于2017年5月20日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

15. 基金管理人2017年6月21日公告,雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理,由刘伟林先生单独管理该基金。

16. 《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2017年6月23日正式生效,吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

17. 《汇添富添福吉祥混合型证券投资基金基金合同》于2017年7月24日正式生效,何旻先生任该基金的基金经理。

18. 基金管理人于2017年7月29日公告,增聘胡昕炜先生担任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理,与何旻先生共同管理该基金。

19. 《汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》于2017年8月10日正式生效,吴振翔先生任该基金的基金经理。

20. 《汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金基金合同》于2017年8月16日正式生效,刘江先生担任该基金的基金经理。

21. 《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月6日正式生效,何旻先生任该基金的基金经理。

22. 《汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》于2017年9月6日正式生效,楚天舒女士任该基金的基金经理。

23. 基金管理人于2017年9月8日公告,增聘陶然先生为汇添富现金宝货币市场基金、汇添富添富通货币市场基金的基金经理,与蒋文玲女士共同管理上述基金。

24. 基金管理人于2017年9月21日公告,增聘胡昕炜先生为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理,与何旻先生共同管理该基金。

25. 《汇添富民丰回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月27日正式生效,吴江宏先生任该基金的基金经理。

26. 基金管理人于2017年9月28日公告,增聘赵鹏飞先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理,与吴江宏先生共同管理该基金。

27. 《汇添富弘安混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月29日正式生效,何旻先生和赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

28. 《汇添富睿丰混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月29日正式生效,李怀定先生任该基金的基金经理。

29. 基金管理人于2017年9月30日公告,增聘赵鹏飞先生为汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理,与李怀定先生共同管理该基金。

30. 《汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 10 日正式生效，余中强先生和倪健先生任该基金的基金经理。
31. 《汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 11 月 24 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。
32. 《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 1 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。
33. 《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 12 月 4 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。
34. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘董瑾女士为中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）和汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。
35. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，与何旻先生、曾刚先生共同管理该基金。
36. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。
37. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与李怀定先生、陆文磊先生、胡娜女士共同管理该基金。
38. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利增强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。
39. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。
40. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富多元收益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。
41. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生、蒋文玲女士共同管理该基金。
42. 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。

### 11.3 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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2013 年 5 月 29 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币伍万元整。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	3	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指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。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：



- (1) 基金交易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。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 10 日; 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 8 月 17 日; 2017 年 8 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日	2,000,000,000.00	11,193,050,719.75	10,148,130,685.31	3,044,920,034.44	27.74%
	2	2017 年 12 月 28 日至 2017 年 12 月 31 日	-	2,500,000,000.00	-	2,500,000,000.00	22.77%
个人	-	-	-	-	-	-	-

-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇添富基金管理股份有限公司  
2018 年 3 月 28 日