汇添富理财14天债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2018年8月25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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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2018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	汇添富理财14天债券	
基金主代码	470014	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年7月10日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,296,968,517.86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14天债券A	汇添富理财14天债券B
下属分级基金的交易代码:	470014	471014
报告期末下属分级基金的份额总额	69,751,120.47份	17,227,217,397.39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	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134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	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	贺倩
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816

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19-22层汇添富基金管理股份有限公司

§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

基金级别	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	1,354,590.71	267,334,215.12
本期利润	1,354,590.71	267,334,215.12
本期净值收益率	2.1516%	2.2979%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	69,751,120.47	17,227,217,397.39
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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)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。

3.2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14天债券A

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
过去一个月	0.3487%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2377%	0.0002%
过去三个月	1.0491%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.7125%	0.0003%
过去六个月	2.1516%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	1.4821%	0.0005%
过去一年	4.2261%	0.0007%	1.3546%	0.0000%	2.8715%	0.0007%
过去三年	8.9201%	0.0057%	4.1096%	0.0000%	4.8105%	0.0057%
自基金合同生效日起至今	24.2189%	0.0074%	8.3455%	0.0000%	15.8734%	0.0074%

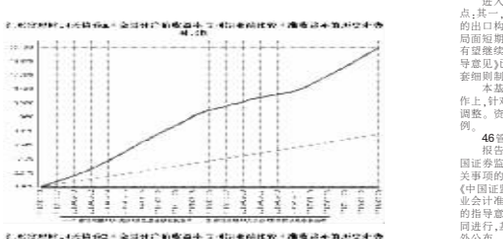
汇添富理财14天债券B

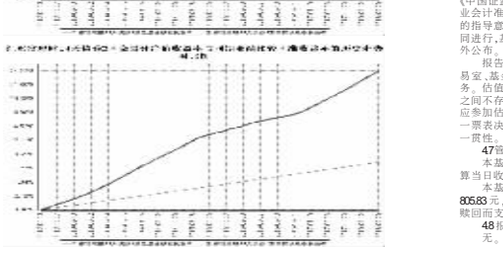
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3727%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2617%	0.0002%
过去三个月	1.1221%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.7855%	0.0003%
过去六个月	2.2979%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	1.6284%	0.0005%
过去一年	4.5278%	0.0007%	1.3546%	0.0000%	3.1732%	0.0007%
过去三年	9.8596%	0.0057%	4.1096%	0.0000%	5.7500%	0.0057%
自基金合同生效日起至今	24.2189%	0.0074%	8.3455%	0.0000%	15.8734%	0.0074%

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





注:本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2012年7月10日)起两周,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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

汇添富基金管理股份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、东航金控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182,724,224元人民币。截止到2018年6月30日,公司管理证券投资基金规模约428.15亿元,有效客户数约988万户,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理10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、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、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、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、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6月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、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、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富纯债债券型证券投资基金(LOF)、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富稳妥收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、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)、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、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金。

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		
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定开债券基金的基金经理,汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2015年3月10日	2018年5月4日	12年	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富优选回报混合基金(原理财21天债券基金)的基金经理,2015年3月10日至2018年5月4日任汇添富理财14天债券基金的基金经理,2016年6月7日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金的基金经理,2016年6月7日至2018年5月4日任理财30天债券基金、理财60天债券基金的基金经理,2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理,2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理,2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理。
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金、汇添富货币基金、汇添富现金宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。	2018年5月4日	-	10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日至今任汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理,2014年8月27日至2018年5月4日任汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理,2014年12月23日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金基金经理,2016年6月7日至2018年5月4日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2018年5月4日至今任汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。
温开强	汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财14天债券、汇添富理财30天债券、汇添富理财60天债券的基金经理助理	2016年8月30日	-	6年	国籍:中国,学历:天津大学管理学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格、CFA、从业经历:曾任长城基金债券交易员、中金基金交易主管、高级经理。2016年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2016年8月30日至今任汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财14天债券、汇添富理财30天债券、汇添富理财60天债券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.本基金的基金经理蒋文玲女士于2017年8月21日起休产假,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,蒋文玲女士休假期间,本基金的投资管理工作由基金经理徐寅喆女士代为履行职责。本基金管理人已于2017年8月18日就上述事项进行公告。

蒋文玲女士已于2018年1月30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2018年2月1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,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿公了授权、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,包括投资确定上决策、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

本报告期内本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4次,由于组合投资策略导致。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

2018年上半年债券市场各期限收益率普遍大幅下行,高评级债券下行幅度好于低评级债券,债券市场的回暖来自于经济基本面、流动性环境等多重利好因素的叠加。经济基本面情况方面,2018年上半年GDP增长6.8%,持平于去年下半年,但分季度分析,二季度增长6.7%,相比一季度的6.8%经微下行。在防风险去杠杆政策的影响下,今年以来的地方政府债务问题得到整治,金融机构过去多年发展的非标业务出现明显压缩,全社会面临信用收缩问题。从数据上看,上半年固定资产投资累计增长仅6%,并且基建和地产均有明显回落趋势。消费上半年社会零售增长9.4%,相比一季度的9.8%也是出现回落。社会融资方面,最新6月份全社会融资在传统贷款大幅增量的情况下,社融增量仅1.18万亿,社融余额增速降至9.9%的历史新低。流动性方面,今年以来货币政策接连发生重大转向,央行于4月份意外降准,6月下旬再次定向降准。在二季度货币政策执行报告中正式明确流动性从"合理稳定"转为"合理充裕"。今年以来,银行间流动性宽松态势普遍超出市场机构的预期,经历传统春节因素、CRA退出和季末MPA考核等关键时点,银行间市场流动性都并未受到明显的冲击。在这些利好因素刺激下,今年上半年债券市场明显回暖,各期限收益率波动下行。10年国债收益率从最高3.98%下探至3.48%,10年国开债收益率更是从最高5.18%下降至4.25%。短端方面,国有股份制银行3M期限存单从年初5.0%降至4月份的3.7%后反弹至5月底的4.55%,6月底再降至3.8%。

本基金上半年组合规模有所增加。针对市场流动性环境的变化,组合投资操作上采取较为进取的策略,努力为基金持有人获取更好的投资收益。整体思路是以拉长组合剩余天数和提高杠杆水平为主,同时对组合债券比例和期限结构进行灵活调整。一季度积极进行存单的配置操作,4月份考虑到收益率的快速大幅下行后适当进行减仓,在5月和6月加大了存款存单的配置比例。债券选择方面,以AAA主体评级为主,规避信用风险。存款合作银行方面,按照公司内部额度管理制度,降低单家存款银行的集中度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富理财14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2.15.6%,截至本报告期末汇添富理财14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2.29.79%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年,债券市场的利好因素有望延续。宏观经济的下行压力难以有效缓解,原因主要有两点,其一,中美贸易战已经升级,特朗普推出反全球化的贸易霸凌主义政策短期不会结束。这对今年的出口构成明显压力。其二,国内防风险去杠杆政策根至半局。国内融资环境大幅收紧,信用收缩的局面短期内难以彻底逆转。货币政策方面,为缓解信用收缩压力,防止去杠杆引发的风险,货币条件有望继续放松,下半年市场流动性可能更加充裕。监管方面,《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》已正式落地,相比此前的征求意见稿在过渡期和部分指标的计算上有所放松。后续相应的配套细则制度将陆续出台,需要密切进行关注。

本基金始终坚持在保障组合流动性安全的情况下,努力为基金持有人争取更好的收益。具体操作上,针对流动性环境的变化,投资策略更加灵活进取,在杠杆水平、组合期限、现券比例等方面灵活调整。资产配置上根据类属资产的收益情况合理配置回购、同业存款、同业存单、短融和利率债的比例。

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、半中期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罕有一票表决权,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(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。

本基金期初应付收益9,109,679.60元,2018年1月1日至2018年6月30日期间累计分配收益268,688,805.83元,其中人民币251,535,110.50元以红利再投资方式结转入实收基金,人民币18,659,858.17元因基金赎回而支付给投资者,其余人民币12,603,516.76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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议约约定,对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:汇添富理财14天债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	10,427,303,632.74	6,887,938,554.47
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	8,853,515,611.80	2,531,624,395.39
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	8,853,515,611.80	2,531,624,395.39
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	98,788,748.43	49,781,569.40
应收股利	-	-
应收申购款	463,004.84	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	19,380,070,997.81	9,469,344,519.26
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	2,064,948,847.55	399,995,200.01
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,415,314.54	1,605,762.26
应付托管费	1,011,945.04	475,781.39
应付销售服务费	145,689.83	68,125.28
应付交易费用	125,854.23	28,027.92
应交税费	-	-
应付利息	676,732.07	197,858.31
应付利润	12,603,516.76	9,109,679.60
递延所得税负债	-	-
其他负债	174,579.93	121,145.00
负债合计	2,083,102,479.95	411,601,579.77
所有者权益:		
实收基金	17,296,968,517.86	9,057,742,939.49
未分配利润	-	-
所有者权益合计	17,296,968,517.86	9,057,742,939.49
负债和所有者权益总计	19,380,070,997.81	9,469,344,519.26

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额17,296,968,517.86份,其中下属A级基金份额总额69,751,120.47份;下属B级基金份额总额17,227,217,397.39份。

6.2利润表

会计主体:汇添富理财14天债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	305,719,791.92	134,103,175.44
1.利息收入	304,713,056.51	134,003,550.58
其中:存款利息收入	174,456,244.90	122,899,152.35
债券利息收入	127,457,737.23	10,366,653.23
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,799,074.38	737,745.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,006,735.41	99,624.86
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,006,735.41	99,624.86
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)	-	-
减:二、费用	37,030,986.09	12,639,523.00
1.管理人报酬	15,880,164.30	7,936,135.16
2.托管费	4,705,233.77	2,351,447.37
3.销售服务费	679,759.78	332,061.31
4.交易费用	-	-
5.利息支出	15,553,899.50	1,916,518.41
其中:卖出回购金融资产支出	15,553,899.50	1,916,518.41
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	211,928.74	103,360.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	268,688,805.83	121,463,652.44

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富理财14天债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	9,057,742,939.49	-	9,057,742,939.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	268,688,805.83	268,688,805.83
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)	8,239,225,578.37	-	8,239,225,578.37
其中:1.基金申购款	15,969,248,279.73	-	15,969,248,279.73
2.基金赎回款	-7,730,022,701.36	-	-7,730,022,701.36
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)	-	-268,688,805.83	-268,688,805.83
五、期末所有者权益(基金净值)	17,296,968,517.86	-	17,296,968,517.86

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	29,236,579.84	-	29,236,579.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	121,463,652.44	121,463,652.44
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)	6,620,268,935.19	-	6,620,268,935.19
其中:1.基金申购款	8,681,942,996.47	-	8,681,942,996.47
2.基金赎回款	-2,061,674,061.28	-	-2,061,674,061.28
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)	-	-121,463,652.44	-121,463,652.44
五、期末所有者权益(基金净值)	6,649,505,515.03	-	6,649,505,515.03

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

张昕 李晓 雷春松

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

汇添富理财14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]842号文《关于核准汇添富理财14天债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人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2012年7月10日正式生效,首次设立募集规模为17,784,864,324.53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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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、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184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。

6.4.2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则》》、《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。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

6.4.6.1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征增值税试点的通知》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《关于进一步明确金融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