汇添富理财 14 天债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2017 年 3 月 29 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 2017 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 2016 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 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	29,236,579.84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	22,213,353.89份	7,023,225.95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	本基金将采用权益管理型的投资策略,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	林蕊
	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

登载基金半度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半度报告备置地点	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

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	汇添富理财 14 天债券 A	汇添富理财 14 天债券 B	汇添富理财 14 天债券 A	汇添富理财 14 天债券 B	汇添富理财 14 天债券 A	汇添富理财 14 天债券 B
本期已实现收益	548,215.47	384,659.43	1,679,538.07	482,108.71	5,604,498.98	2,720,895.81
本期利润	548,215.47	384,659.43	1,679,538.07	482,108.71	5,604,498.98	2,720,895.81
本期净值收益率	1.7048%	2.0002%	2.8152%	3.0750%	4.4777%	4.7812%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末基金资产净值	22,213,353.89	7,023,225.95	29,728,967.61	20,108,428.24	72,006,922.86	18,178,386.42
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00

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、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 10 日,至本报告期末未满五年。

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
过去三个月	0.3684%	0.0011%	0.3393%	0.0000%	0.0291%	0.0011%
过去六个月	0.7409%	0.0009%	0.6787%	0.0000%	0.0622%	0.0009%
过去一年	1.7048%	0.0064%	1.3500%	0.0000%	0.3548%	0.0064%
过去三年	9.2501%	0.0098%	4.1049%	0.0000%	5.1452%	0.0098%
自基金合同生效日起至今	15.1993%	0.0084%	6.1914%	0.0000%	9.0079%	0.0084%

汇添富理财 14 天债券 B

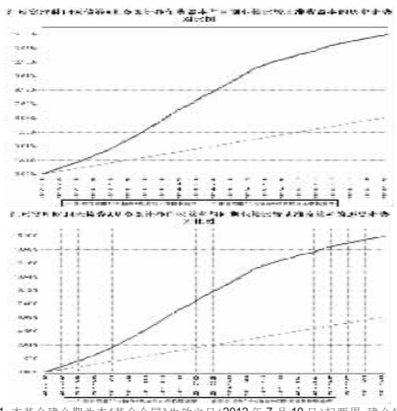
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4414%	0.0011%	0.3393%	0.0000%	0.1021%	0.0011%
过去六个月	0.8879%	0.0009%	0.6787%	0.0000%	0.2092%	0.0009%
过去一年	2.0002%	0.0064%	1.3500%	0.0000%	0.6502%	0.0064%
过去三年	10.1633%	0.0098%	4.1049%	0.0000%	6.0584%	0.0098%
自基金合同生效日起至今	16.6641%	0.0084%	6.1914%	0.0000%	10.4727%	0.0084%

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、本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 7 月 10 日,至本报告期末未满五年。

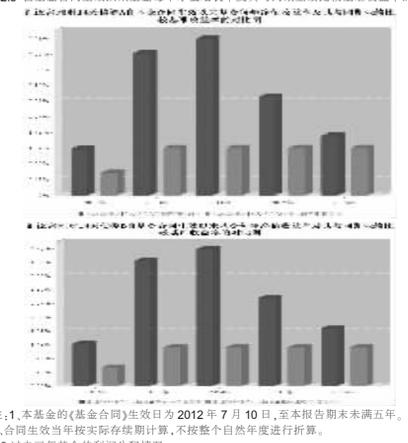
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1. 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。

2. 本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 7 月 10 日,至本报告期末未满五年。

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 10 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 14 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
2016	474,690.18	73,756.14	- 230.85	548,215.47	
2015	1,516,232.14	270,357.86	- 107,051.93	1,679,538.07	
2014	4,071,387.64	1,534,740.29	- 1,628.95	5,604,498.98	
合计	6,062,309.96	1,878,854.29	- 108,911.73	7,832,252.52	

汇添富理财 14 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
2016	352,610.76	30,926.61	1,122.06	384,659.43	
2015	414,992.49	102,209.89	- 35,093.67	482,108.71	
2014	2,019,196.10	682,568.55	19,131.16	2,720,895.81	
合计	2,786,799.35	815,705.05	- 14,840.45	3,587,663.95	

§ 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、上海虹桥机场及成都四个分公司,以及两个子公司—汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)和汇添富资本管理有限公司。

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,基本养老保险基金委托投资管理人。截至目前,汇添富已经构建起公募、专户、社保基金、养老金、国际业务等投融资业务以及互联网金融业务协同发展的统一的资产管理服务平台。

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。2016 年,汇添富保持了优秀的投资业绩:截至 2016 年年底,汇添富基金旗下权益主动管理型基金过去 5 年平均收益率 139%,在大型基金公司中持续排名第一(数据来源:银河证券基金研究中心)。优秀的投资业绩获得了行业高度认可。2016 年,公司先后获得"年度十大明星基金公司"、"五年持续回报明星基金公司"、"金基金 TOP 公司"等多项荣誉;汇添富民营活力、汇添富价值精选、汇添富金额宝获得"金牛基金"大奖。

2016 年,汇添富基金新发 16 只基金,包括 2 只股票型基金,5 只指数基金,3 只债券型基金,4 只保本基金,以及 2 只混合型基金。其中,上海国企 ETF 首募规模达 152 亿元,位居今年所有权益类产品发行规模首位。全年,公司公募基金产品达到 75 只,涵盖权益、固定收益、混合、灵活配置、指数、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。

2016 年,汇添富基金在规范电子商务运作的基础上,陆续完成安全中心体系、快捷支付渠道及新版手机 APP 建设,加强优化客户体验,提升客户服务能力。公司电子商务平台保有规模排名行业前列。

2016 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 2250 亿元。12 月,公司成功竞获基本养老保险基金管理人资格,未来将为做好做大养老金投资业务而努力。

2016 年,公司积极开展渠道销售和培训工作。优秀的投资业绩、专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑带来了汇添富品牌在渠道影响力的显著提升。在传统大中型银行和券商渠道的基础上,公司进一步拓展了中小型银行及券商渠道,助力新基金发行。2016 年,公司所有新发基金规模在同期同类新基金中排名均位居前列。公司大力开展"汇定投汇添富"系列定投推广活动,营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部,全力打造汇添富定投品牌。

2016 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、理财基金、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。

2016 年,香港子公司的国际业务取得较大进展。香港子公司顺利成为韩国退休教师基金 KTCU 选聘的 A 股投资管理人,并获得台湾第一金证券投资信托股份有限公司委任,成为其两只公募基金的投资顾问。

2016 年,公司持续加强公益事业建设,践行企业社会责任,公益活动影响力得到进一步提升。1 月,公司开展第二期"添富之爱"员工与贫困地区学生一对一结对帮扶认领活动,160 名乡村学子与汇添富员工完成结对。3 月,南京山地马拉松通过报名筹款为"河流孩子"项目筹得善款近 7 万元。5 月,公司员工参加"一个鸡蛋的暴走"筹得善款 12 万元。6 月,公司首次开展海外学子支教活动,组织优秀中国留学生赴宁夏泾源县兰大庄添富小学,开展为期 1 周的公益支教活动。志愿者们充分借鉴海外教学的授课方式,帮助乡村小学生打开视野。8 月,南方多省遭遇严重洪涝灾害,公司员工自发地发起赈灾捐款,成功募集 20 余万元善款,全部用于为受灾地区学校捐赠图书、教学和生活用品。10 月,上海国际马拉松赛的"金马完赛公益捐赠活动"累计筹集 17 万善款。

2017 年是实施"十三五"规划的重要一年,资本市场改革进一步深化,财富管理行业在混业竞争、互联网金融、两地基金互认的多重推动下将面临更大的挑战与机遇。汇添富基金将始终坚信长期的力量,拥抱变革、奋勇拼搏、砥砺前行,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		
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、理财 14 天债券基金、理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金、实业债券基金、优选回报混合基金的基金经理,汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2015年3月10日	-	10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、债券风险研究员。2012 年 11 月 30 日至 2014 年 1 月 7 日任通银安盈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、汇添富理财 14 天债券基金、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,2016 年 6 月 7 日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金、实业债券基金的基金经理。

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、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 10 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

2016 年中国经济以供给侧结构性改革为主线,持续深入推进"三去一降一补"重点任务,三季度基本面出现边际改善,四季度经济回暖得到进一步印证。在大宗商品库存回补的拉动下,工业品价格持续上涨,PPI 指数 9 月份由负转正,终止了 54 个月连续下滑的走势,至 12 月份上涨 5.5%,进出口数据也扭转颓势,逐月改善,工业增加值同比增幅好于去年同期,居民消费则保持稳定态势。与此同时,国内资产价格涨幅明显,金融机构"脱实向虚"、层层加杠杆迹象显著,因此货币政策在 8 月份出现明显转向,央行公开市场操作重启 14 天逆回购,资金投放"缩短放长"意图逐渐显现。央行提出把防控金融风险放在更重要的位置,引导金融机构去杠杆,并于 12 月中央经济工作会议正式定调货币政策转向"稳健中性"。2016 年债券市场走势一波三折。4 月受中钢物资违约事件影响,债券收益率快速反弹近 50bp,随后收益率逐步修复至年初位置,10 月以来在央行货币政策转向、基础货币投放不足的背景下,银行间资金极度紧张逐渐常态化,"钱荒 2.0"魅影再现,11-12 月债券收益率快速上行,各期限收益率最高攀升 100-150bp。

报告期内,本基金规模较小,持续下降,具体操作上根据组合运作周期匹配到期资产,以流动性管理和合规性风险管理为主,在债券投资上仅配置高流动性的金融债,较好地规避了组合的负偏离风险和流动性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 级本期净值收益率为 1.7048%,B 级本期净值收益率为 2.0002%。

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 2017 年,国内经济延续稳中求进的总基调。尽管供给侧结构性改革依然任重道远,但积极因素不断累积,经济阶段性探底已经完成。海外政治环境面临较大的不确定性,欧洲进入新一轮政治竞选周期,美国特朗普政府的经济贸易政策发生较大调整转向。货币政策方面,美元处于加息周期,国内通胀仍有隐忧,央行资金投放管控严格,继续完善 MPA 考核机制,针对同业业务加杠杆等行为的监管政策将陆续出台,多部门的联合监管呼之欲出,这些措施可能对债市产生重大影响。在"稳健中性"的货币政策预期下,债市流动性波动加剧,管理难度加大。

鉴于此,本基金将始终坚持流动性管理的思路,根据运作周期进行期限匹配操作,严格控制组合的剩余期限和杠杆,科学分配存款与债券之间的配置比例。在满足组合流动性和安全性的条件下,积极把握金利率波动带来的机会,在合适时点锁定高收益的投资品种。债券配置方面,因组合规模较小,将以高流动性的金融债为主。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,公司以维护基金份额持人利益为宗旨,有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则,认真履行职责,通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作,强化对基金运作和公司运营的合规性监察,促进内部控制和风险管理的不断改进,并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内,本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面:

(一)完善规章制度,健全内部控制体系

在本报告期内,督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估,并根据各项业务特点、业务发展实际,建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程,进一步明确了内部控制和风险管理责任,公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善,为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

(二)加强稽核监察,确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内,督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据,按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察,包括对基金投资交易行为、投资指标的监控,对投资组合的风险度量、评估和建议,对基金信息披露的审核、监督,对基金销售、营销的稽核、控制,对基金营运、技术系统的稽核、评估,切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

(三)强化培训教育,提高全员合规意识

本报告期内,督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流,提升了员工的风险意识、合规意识,提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平,公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作,本报告期内,本基金管理人所管理的基金运作合法合规,充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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,可以提议调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。

4.8 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 12,650.60 元,本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日期间累计分配收益 932,874.9 元,其中人民币 827,300.94 元以红利再投资方式结转入实收基金,人民币 104,682.75 元因基金赎回而支付给投资者,其余人民币 13,541.81 元为期末应付收益。

4.9 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、托管协议的约定,对本基金基金管理人—汇添富基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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 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、阚青化于 2017 年 3 月 28 日签字出具了安永华明(2017)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:汇添富理财 14 天债券型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	9,055,234.45	31,592,344.00
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	19,997,557.07	18,028,985.22
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	19,997,557.07	18,028,985.22
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	434,898.00	514,391.74
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	29,487,689.52	50,135,720.96

负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	28,830.08
应付管理人报酬	9,087.55	12,024.30
应付托管费	2,692.58	3,562.73
应付销售服务费	5,763.26	8,413.32
应付交易费用	504.00	3,284.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	13,541.81	12,650.60
递延所得税负债	-	-
其他负债	219,520.48	229,560.00
负债合计	251,109.68	298,325.11
所有者权益:		
实收基金	29,236,579.84	49,837,395.85
未分配利润	-	-
所有者权益合计	29,236,579.84	49,837,395.85
负债和所有者权益总计	29,487,689.52	50,135,720.96

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.00 元,基金份额总额 29,236,579.84 份,其中下属 A 类基金份额总额 22,213,353.89 份;下属 B 类基金份额总额 7,023,225.95 份。

7.2 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:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	1,494,042.42	2,968,470.19
1.利息收入	1,494,042.42	2,647,097.62
其中:存款利息收入	961,195.76	1,580,519.98
债券利息收入	532,846.66	840,259.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	226,318.11
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-	321,372.57
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	321,372.57
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	561,167.52	806,823.41
1、管理人报酬	137,305.81	187,957.37
2、托管费	40,683.29	55,961.78
3、销售服务费	96,360.41	168,512.50
4、交易费用	-	-
5、利息支出	21,608.87	112,668.60
其中:卖出回购金融资产支出	21,608.87	112,668.60
6、其他费用	265,209.14	281,723.16
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	932,874.90	2,161,646.78

7.3 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:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 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)	49,837,395.85	-	49,837,395.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	932,874.90	932,874.90
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)	-20,600,816.01	-	-20,600,816.01
其中:1.基金申购款	135,708,704.29	-	135,708,704.29
2.基金赎回款	-156,309,520.30	-	-156,309,520.30
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)	-	-932,874.90	-932,874.90
五、期末所有者权益(基金净值)	29,236,579.84	-	29,236,579.84

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	90,185,309.28	-	90,185,309.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,161,646.78	2,161,646.78
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)	-40,347,913.43	-	-40,347,913.43
其中:1.基金申购款	245,390,559.40	-	245,390,559.40
2.基金赎回款	-285,738,472.83	-	-285,738,472.83
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)	-	-2,161,646.78	-2,161,646.78
五、期末所有者权益(基金净值)	49,837,395.85	-	49,837,395.85

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

张晖 李骁 韩从慧

基金管理人负责人 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 11,784,864,324.53 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。本基金采用权益管理型的投资策略,原则上将投资组合的平均剩余期限控制在 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。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

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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《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 >)及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 2016 年 12 月 31 日的财务状况及