汇添富理财30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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月29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30天债券	
基金主代码	470030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月9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	525,432,216.98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30天债券A	汇添富理财30天债券B
下属分级基金的交易代码:	470030	471030
报告期末下属分级基金的份额总额	432,506,681.09份	92,925,535.89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	将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150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	长期风险收益率不低于投票型基金,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@cbc.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30天债券A	汇添富理财30天债券B	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
本期已实现收益	14,724,478.46	2,707,835.84	31,032,564.42	1,911,270.44	51,705,762.08	12,988,633.34
本期利润	14,724,478.46	2,707,835.84	31,032,564.42	1,911,270.44	51,705,762.08	12,988,633.34
本期净值收益率	2.8596%	3.1579%	4.1065%	4.4081%	4.8086%	5.1119%
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	432,506,681.09	92,925,535.89	599,760,453.25	11,141,190.59	990,558,360.70	99,901,593.91
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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、本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9日,至本报告期末未满五年,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2016年12月31日数据,特此说明。

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30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	0.6934%	0.0029%	0.3393%	0.0000%	0.3541%	0.0029%
过去六个月	1.3709%	0.0042%	0.6787%	0.0000%	0.6922%	0.0042%
过去一年	2.8596%	0.0064%	1.3500%	0.0000%	1.5096%	0.0064%
过去三年	12.2326%	0.0080%	4.1049%	0.0000%	8.1277%	0.0080%
自基金合同生效日起至今	19.6598%	0.0068%	6.4394%	0.0000%	13.2204%	0.0068%

汇添富理财30天债券B

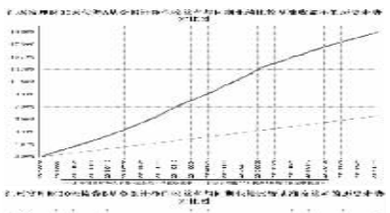
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7667%	0.0029%	0.3393%	0.0000%	0.4274%	0.0029%
过去六个月	1.5185%	0.0042%	0.6787%	0.0000%	0.8398%	0.0042%
过去一年	3.1579%	0.0064%	1.3500%	0.0000%	1.8079%	0.0064%
过去三年	13.2108%	0.0080%	3.8971%	0.0000%	9.3137%	0.0080%
自基金合同生效日起至今	21.2810%	0.0068%	6.4394%	0.0000%	14.8416%	0.0068%

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,并在运作期末集中支付。

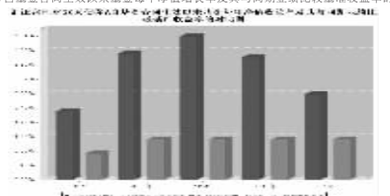
3、本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9日,至本报告期末未满五年。

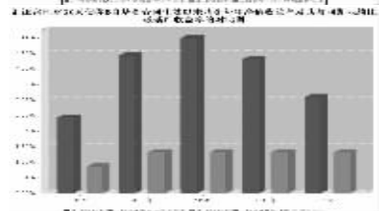
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2012年5月9日)起6个月,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





注:1、本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9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30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	13,512,669.36	1,662,412.65	-457,923.12	14,717,158.89	
2015	26,963,845.14	4,984,372.31	-915,653.03	31,032,564.42	
2014	44,544,177.56	8,516,418.72	-1,354,834.20	51,705,762.08	
合计	85,020,692.06	15,163,203.68	-2,728,410.35	97,455,485.39	
汇添富理财30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	2,138,126.83	395,191.73	181,836.85	2,715,155.41	
2015	1,505,019.49	617,346.85	-211,095.90	1,911,270.44	
2014	8,549,093.26	7,503,769.79	-3,064,229.71	12,988,633.34	
合计	12,192,239.58	8,516,308.37	-3,093,488.76	17,615,059.19	

§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,做中长期投资市局,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、汇添富全额宝获得"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,并获得台湾第一金融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涿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"全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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蔡文玲	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。	2016年6月7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价格基金经理。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、实业债债券基金的基金经理。
冯丛珺	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富添富通货币基金的基金经理。	2014年1月21日	2016年6月7日	8年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士,相关业务资格:基金从业资格,从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员,2013年7月31日至2016年6月7日任汇添富货币基金的基金经理,2013年12月13日至2016年6月7日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至2016年6月7日任汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理,2014年5月28日至2015年7月30日任汇添富和聚宝货币基金的基金经理,2015年1月16日至2016年6月7日任汇添富添富通货币基金(原汇添富新农业债券基金)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年债券市场步入一波三折。4月受中铁物资违约事件影响,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,本基金规模较为稳定。操作策略上,根据宏观经济、货币政策和基金规模变化特点,结合组合运作周期进行期限匹配,少量错配,降低对债券的配置比例,并逐步替换成高等级的短融,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

本期间本基金A级净值收益率为2.8596%,B级净值收益率为3.1579%。

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,适当错配,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,积极把握资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和高等级短融为主。

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、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。

4.7 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1,096,832.88元,本基金2016年1月1日至2015年12月31日期间累计分配收益17,432,314.30元,其中人民币15,650,796.19元以红利再投资方式结转入实收基金,人民币2,057,604.38元因基金赎回而支付给投资者,其余人民币820,746.61元为期末应付收益。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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

本报告期内,本基金托管人在对汇添富理财30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》及其他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30天债券型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富理财30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有限公司编制和披露的汇添富理财30天债券型证券投资基金2015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、阚育化于2017年3月28日签字出具了安永华明(2017)审字第60466941_B23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30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	361,563,270.90	201,288,726.11
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	169,303,155.77	420,462,819.34
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	169,303,155.77	420,462,819.34
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	2,740,542.37	9,873,056.28
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	533,606,969.04	631,624,601.73

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	6,799,669.80	18,999,790.50
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	126,743.90	142,969.75
应付托管费	37,553.75	42,361.46
应付销售服务费	116,160.82	154,959.26
应付交易费用	3,049.62	15,572.49
应交税费	-	-
应付利息	1,527.56	1,171.55
应付利润	820,746.61	1,096,832.88
递延所得税负债	-	-
其他负债	269,300.00	269,300.00
负债合计	8,174,752.06	20,722,957.89
所有者权益:		
实收基金	525,432,216.98	610,901,643.84
未分配利润	-	-
所有者权益合计	525,432,216.98	610,901,643.84
负债和所有者权益总计	533,606,969.04	631,624,601.73

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额525,432,216.98份,其中下属A类基金份额总额432,506,681.09份;下属B类基金份额总额92,925,535.89份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富理财30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	21,683,686.63	38,815,146.71
1.利息收入	18,264,748.38	32,162,008.09
其中:存款利息收入	10,229,583.57	15,630,348.31
债券利息收入	8,035,164.81	15,728,981.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	802,678.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,418,938.25	6,653,138.62
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,418,938.25	6,653,138.62
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	4,251,372.33	5,871,311.85
1、管理人报酬	1,642,424.67	2,152,729.52
2、托管费	486,644.38	637,845.81
3、销售服务费	1,569,911.27	2,274,109.52
4、交易费用	-	-
5、利息支出	206,018.80	461,862.98
其中:卖出回购金融资产支出	206,018.80	461,862.98
6、其他费用	346,373.21	344,764.02
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	17,432,314.30	32,943,834.86

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富理财30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)	610,901,643.84	-	610,901,643.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	17,432,314.30	17,432,314.30
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)	-85,469,426.86	-	-85,469,426.86
其中:1.基金申购款	763,922.381.01	-	763,922.381.01
2.基金赎回款	-849,391,807.87	-	-849,391,807.87
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)	-	-17,432,314.30	-17,432,314.30
五、期末所有者权益(基金净值)	525,432,216.98	-	525,432,216.98

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)	1,090,459,954.61	-	1,090,459,954.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	32,943,834.86	32,943,834.86
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)	-479,558,310.77	-	-479,558,310.77
其中:1.基金申购款	1,120,238,402.53	-	1,120,238,402.53
2.基金赎回款	-1,599,796,713.30	-	-1,599,796,713.30
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)	-	-32,943,834.86	-32,943,834.86
五、期末所有者权益(基金净值)	610,901,643.84	-	610,901,643.84

注:本基金合同于2012年5月9日生效,因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2012年12月31日数据,特此说明。

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30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]556号文《关于核准汇添富理财30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5月9日正式生效,首次设立募集规模为24,441,718,012.59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、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)的中央银行票据、短期融资券及法律法规或中国证监会允许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,将投资组合的平均剩余期限控制在150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>》、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2016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

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.4.3 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。

7.4.5 税项

7.4.5.1 营业税、增值税

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,继续免征营业税;

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