

汇添富理财7天债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

在经历流动性较为宽松的二季度末后,央行在三季度积极实施稳健性的货币政策,通过多种流动性工具保持资金面“不紧不宽”,总体将资金面维持在紧平衡状态,以此来避免流动性形成持续性宽松的预期,并防止金融结构加剧上行。在金融监管趋严和去杠杆的背景下,3M Shibo利率从6月中旬起持续上行,带动理财产品中短利率抬升,但利率上行幅度在三季度相比此前有所收敛。

操作上,本基金采取相对灵活的投资策略,严格控制信用风险,调整组合久期,根据资金面变化调整配置足量的短期资产应对关键时点的流动性需求,同时,通过积极进行资产配置和仓位调整,主动把握季末流动性紧张阶段性走高的机会,在控制组合风险的前提下为持有人获取稳定回报。

45 报告期内基金的业绩表现
本报告期汇添富理财7天债券A的基金份额净值收益率为0.9578%,本报告期汇添富理财7天债券B的基金份额净值收益率为1.0697%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

46 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明
无。

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

序号	债券代码	债券名称	债券数量(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170404	17国债04	2,780,000	269,213,368.68	5.28
2	11171404	17国债04	2,540,000	248,132,770.69	4.97
3	11171028	17国债10	2,000,000	189,010,462.07	3.93
4	11171038	17国债10	2,000,000	186,177,172.59	3.86
5	11170820	17国债08	1,500,000	148,076,568.68	3.02
6	11171124	17国债11	1,000,000	89,271,768.07	1.85
7	11171409	17国债14	1,000,000	90,262,723.64	1.86
8	11170919	17国债09	1,000,000	89,097,721.80	1.84
9	11170310	17国债03	1,000,000	88,130,040.01	1.80
10	11170308	17国债03	1,000,000	88,048,269.89	1.80

本报告期汇添富理财60天债券A的基金份额净值收益率为1.0256%，本报告期汇添富理财60天债券B的基金份额净值收益率为1.0995%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,000,000.00	10.00
2	固定收益投资	9,000,000.00	90.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
5	其他资产	0.00	0.00
6	其他	0.00	0.00
7	合计	10,000,000.00	100.00