

# 汇添富理财 14 天债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 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：2021 年 07 月 21 日

## § 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责任。

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 2021 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 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       | 2019 年 12 月 27 日                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额(份) | 49,120,774.27                                                                                                            |
| 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。本基金的投资策略主要包括：利率策略、信用策略、个券选择策略、其他衍生工具投资策略。 |
| 业绩比较基准        | 七天通知存款利率(税后)                                                                                                             |
| 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，高于货币市场基金。                                                                           |
| 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   |                |
| 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(份) | 29,785,894.15  | 19,334,880.12  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2021 年 04 月 01 日 - 2021 年 06 月 30 日) |                |
|-----------------|------------------------------------------|----------------|
|                 | 汇添富理财 14 天债券 A                           | 汇添富理财 14 天债券 B |
| 1. 本期已实现收益      | 40,974.26                                | 45,002.75      |
| 2. 本期利润         | 68,681.21                                | 65,445.80      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0022                                   | 0.0030         |
| 4. 期末基金资产净值     | 30,416,485.47                            | 20,173,776.62  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0212                                   | 1.0434         |

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，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

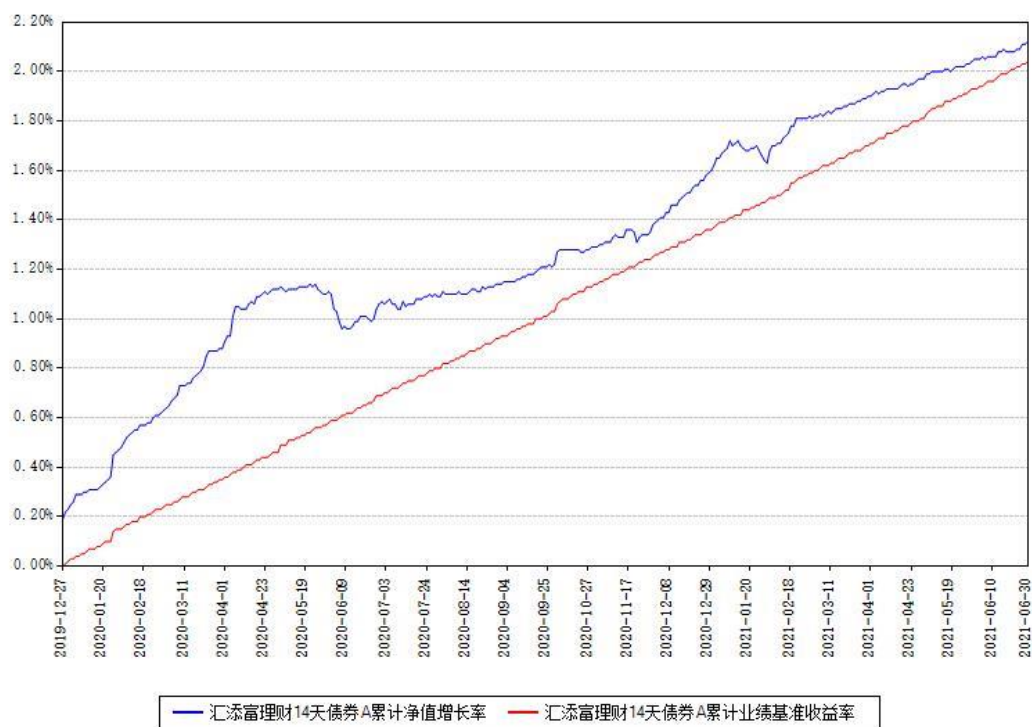
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富理财 14 天债券 A |          |             |            |               |        |       |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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          | 0.22%    | 0.01%       | 0.34%      | 0.00%         | -0.12% | 0.01% |
| 过去六个月          | 0.49%    | 0.01%       | 0.67%      | 0.00%         | -0.18% | 0.01% |

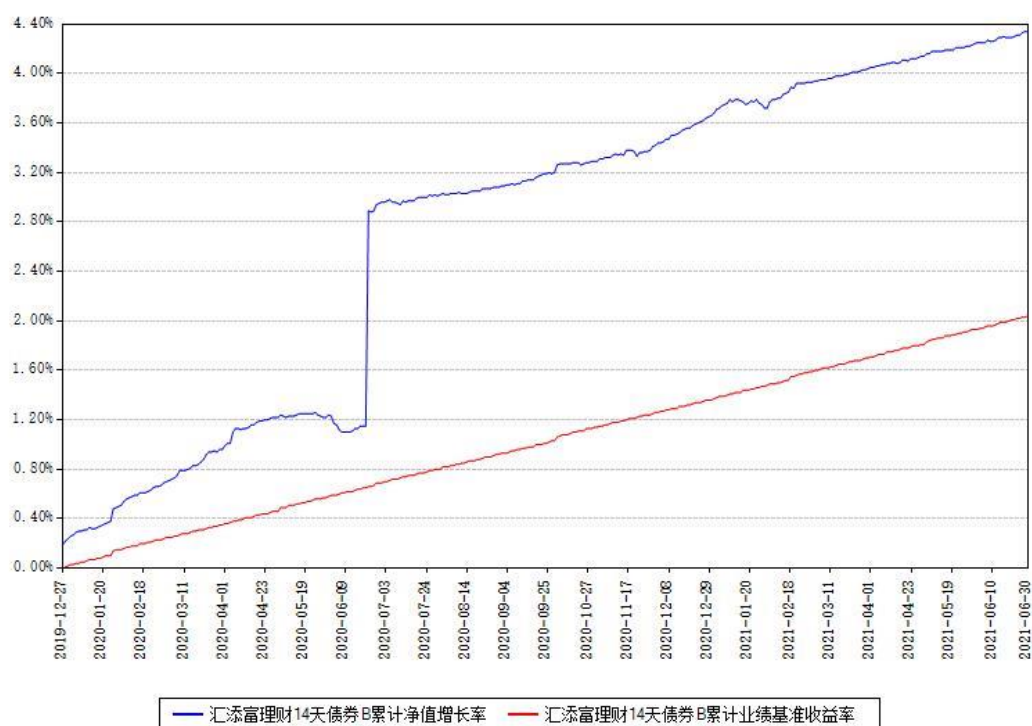
| 过去一年           | 1.05%        | 0.01%               | 1.35%              | 0.00%                     | -0.30% | 0.01% |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 自基金合同生效日起至今    | 2.12%        | 0.02%               | 2.04%              | 0.00%                     | 0.08%  | 0.02% |
| 汇添富理财 14 天债券 B |              |                     |                    |                           |        |       |
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
| 过去三<br>个月      | 0.29%        | 0.01%               | 0.34%              | 0.00%                     | -0.05% | 0.01% |
| 过去六<br>个月      | 0.64%        | 0.01%               | 0.67%              | 0.00%                     | -0.03% | 0.01% |
| 过去一年           | 1.35%        | 0.01%               | 1.35%              | 0.00%                     | 0.00%  | 0.01% |
| 自基金合同生效日起至今    | 4.34%        | 0.09%               | 2.04%              | 0.00%                     | 2.30%  | 0.09% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长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14天债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富理财14天债券B累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 12 月 27 日）起 6 个月，建仓期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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务               | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限<br>(年) | 说明                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----|------------------|------------------|------|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                  | 任职日期             | 离任日期 |               |                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 徐寅喆 | 本基金的基金经理，现金管理部主管 | 2018 年 05 月 04 日 |      | 13            | 国籍:中国。<br>学历:复旦大学管理学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历: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, 历任债券交易员、固定收益基金经理助理, 现任现金管理部主管。2014 年 8 月 27 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富利率债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 日任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。2014 年 11 月 26 日 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>至今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市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至至今任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至 2020 年 8 月 18 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 25 日至至今任汇添</p> |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                   |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>富添富通货币市场基金的基金经理。2019 年 9 月 10 日至今任汇添富汇鑫浮动净值型货币市场基金的基金经理。</p> <p>2020 年 2 月 26 日至今任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。2021 年 6 月 24 日至今任汇添富稳利 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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“离任日期”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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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。本基金无重大违法、违规行为,



本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司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成交量的 5% 的情况有 5 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度疫情影响持续消退，全球经济整体上延续复苏态势。海外美联储的宽松货币政策仍在延续，但鹰派信号越来越多，政策态度边际转紧。尤其是在美国 4 月 CPI 和 5 月 CPI 连创新高后，市场对美联储的一举一动更加小心关注。国内方面，二季度国内生产制造企业面临严峻的成本压力。以工业金属、煤炭和原油为代表的诸多大宗商品价格都出现剧烈的价格跳升。原材料价格的快速上涨激化产业链上中下游企业之间利润分配的矛盾，将对制造业造

成明显冲击。我们也观察到，5 月 PMI 数据分项中新订单指数、新出口订单指数和原材料库存指数都呈现了明显的下滑态势。央行政策方面，基于对国内经济运行稳中加固、稳中向好的判断，政策基调依旧维持灵活精准和合理适度。通过存款利率改革以降低银行成本，最终推动实际贷款利率降低。结构性货币政策仍强调对制造业、小微企业和碳减排的普惠金融支持。

在央行贯彻不急转弯，强调稳字当头的政策思路下，二季度银行间市场流动性合理充裕，DR007 大体围绕政策利率小幅波动。存单市场非常稳定，以 3M 国股行存单为代表的短期收益率在 2.35%至 2.5%之间小幅波动，而 12M 国股行存单收益率则在 2.83%至 3.0%之间起伏。本基金转型完成后规模较小，以做好流动性管理为首要目标。组合投资策略保守，以配置短期利率债为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 0.22%;B 类基金份额净值增长率为 0.29%。同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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         | —             | —            |
|    | 其中：股票        | —             | —            |
| 2  | 基金投资         | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资       | 49,775,000.00 | 98.27        |
|    | 其中：债券        | 49,775,000.00 | 98.27        |
|    | 资产支持证券       | —             | —            |
| 4  | 贵金属投资        | —             | —            |
| 5  | 金融衍生品投资      | —             | —            |
| 6  | 买入返售金融资产     | —             | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返 | —             | —            |

|   |              |               |        |
|---|--------------|---------------|--------|
|   | 售金融资产        |               |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 720,373.14    | 1.42   |
| 8 | 其他资产         | 157,026.85    | 0.31   |
| 9 | 合计           | 50,652,399.99 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金报告期末未投资境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 49,775,000.00 | 98.39        |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 4  | 企业债券      | —             | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |
| 6  | 中期票据      | —             | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —             | —            |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 49,775,000.00 | 98.39        |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 219923 | 21 贴现<br>国债 23 | 500,000 | 49,775,000.00 | 98.39        |

## 5.6 报告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。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

## 5.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

## 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称    | 金额（元） |
|----|-------|-------|
| 1  | 存出保证金 | -     |

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -          |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | 89,526.85  |
| 5 | 应收申购款   | 67,500.00  |
| 6 | 其他应收款   | -          |
| 7 | 待摊费用    | -          |
| 8 | 其他      | -          |
| 9 | 合计      | 157,026.85 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目            | 汇添富理财 14 天债券 A | 汇添富理财 14 天债券 B |
|---------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 32,247,723.89  | 24,188,165.24  |
| 本报告期基金总申购份额   | 2,846,918.68   | -              |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 5,308,748.42   | 4,853,285.12   |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 29,785,894.15  | 19,334,880.12  |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 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             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间         | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比 (%) |
| 机构    | 1              | 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 19,334,880.12 | -    | -    | 19,334,880.12 | 39.36    |

### 产品特有风险

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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、转换运作方式或与其他基金合并。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富理财 14 天债券型证券投资基金募集的文件；

- 2、《汇添富理财 14 天债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富理财 14 天债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富理财 14 天债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 07 月 21 日