

# 汇添富利率债债券型证券投资基金(原汇添富 理财 7 天债券型证券投资基金)2020 年第 4 季度报告

2020 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：2021 年 01 月 22 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 20 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 2020 年 10 月 30 日（基金合同生效日）起至 2020 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	汇添富利率债
基金主代码	472007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 30 日
报告期末基金份额总额(份)	5,133,718,554.11
投资目标	在科学严格管理风险的前提下，本基金力争创造超越业绩比较基准的较高收益。
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期。本基金采取的投资策略主要包括久期策略、骑乘策略、期限结构配置策略、息差策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。
业绩比较基准	中债-总全价（总值）指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型

	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	中国工商银行股份有限公司

## 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	汇添富理财 7 天债券	
基金主代码	471007	
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)	4,244,856,477.25	
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 127 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，预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。	
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	
下属分级基金的基金简称	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
下属分级基金的交易代码	471007	472007
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	49,774,261.68	4,195,082,215.57

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020 年 10 月 30 日 - 2020 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	21,946,294.33
2. 本期利润	36,516,665.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0078
4. 期末基金资产净值	5,188,264,769.84
5. 期末基金份额净值	1.0106

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年10月01日 - 2020年10月29日)	
	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
1. 本期已实现收益	45,958.62	1,340,410.27
2. 本期利润	41,564.36	1,238,504.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0008	0.0006
4. 期末基金资产净值	49,920,765.65	4,207,787,491.43
5. 期末基金份额净值	1.0029	1.0030

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（转型后）

#### 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

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
自基金合同生效日起至今	1.06%	0.05%	0.82%	0.07%	0.24%	-0.02%

#### 3.2.2 自基金转型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

汇添富利率债累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为 2020 年 10 月 30 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

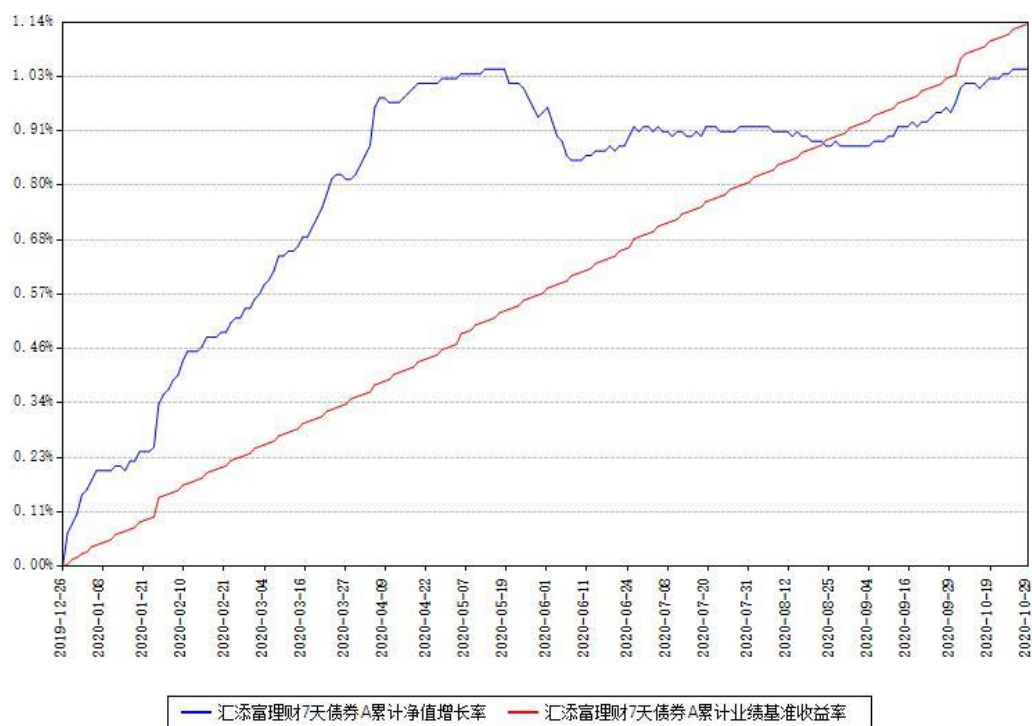
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财 7 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	0.12%	0.01%	0.33%	0.00%	-0.21%	0.01%
过去六个月	0.02%	0.01%	0.67%	0.00%	-0.65%	0.01%
自基金合同生效日起至今	1.04%	0.01%	1.14%	0.00%	-0.10%	0.01%
汇添富理财 7 天债券 B						

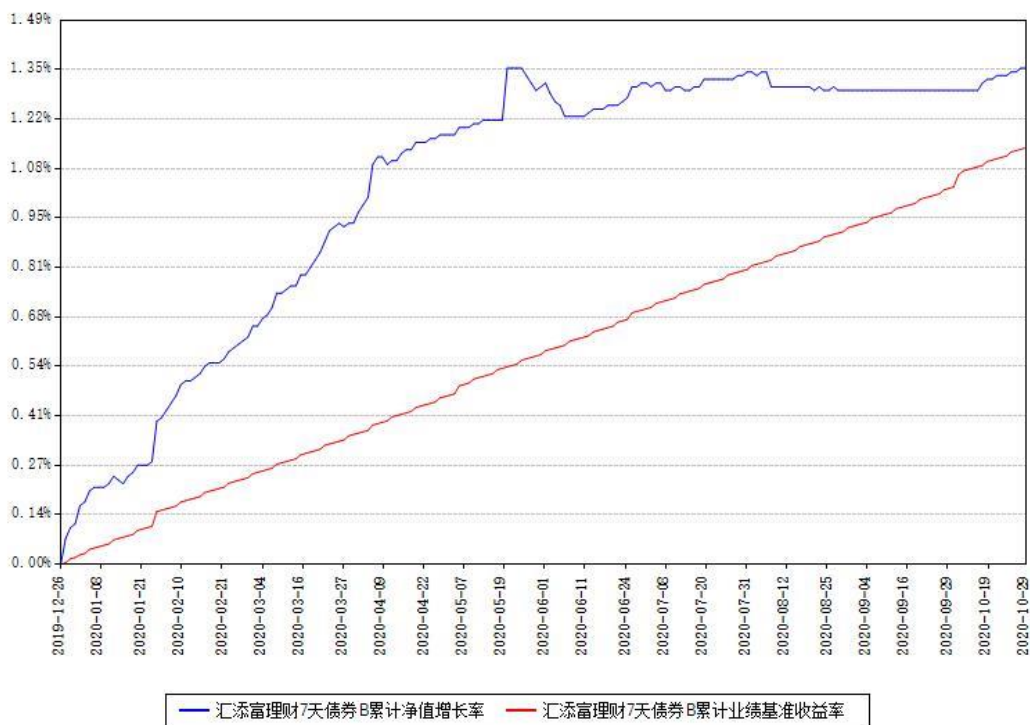
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三 个月	0.12%	0.01%	0.33%	0.00%	-0.21%	0.01%
过去六 个月	0.02%	0.01%	0.67%	0.00%	-0.65%	0.01%
自基金 合同生 效日起 至今	1.04%	0.01%	1.14%	0.00%	-0.10%	0.01%

### 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7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7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 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
蒋文玲	本基金的 基金经理	2020年10 月30日		14	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任汇添富基金管理股份有限公司债券交易员、债券风控研究员,浦银安盛基金管理公司基金经理。2014年1月加入汇添富基

				<p>金管理股份有限公司，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。</p> <p>2014 年 4 月 8 日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>2015 年 3 月 10 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 3 月 10 日至今任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理。2015 年 3 月 10 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富货币市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添</p>
--	--	--	--	--



					<p>富添富通货币市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月 15 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 8 月 2 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 8 月 2 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 13 日至今任汇添富短债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 24 日至今任汇添富丰润中</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 18 日至今任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月 12 日至今任汇添富 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。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。2020 年 10 月 30 日至今任汇添富利率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。

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
徐寅喆	本基金的基	2014 年 08	2020 年 10	12	国籍:中国。学

	<p>金经理，现金管理部主管</p>	<p>月 27 日</p>	<p>月 30 日</p>	<p>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 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今</p>
--	--------------------	---------------	---------------	---

					<p>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 日至今任汇添富添富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。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。</p>
温开强	本基金的基金经理	2019 年 01 月 25 日	2020 年 10 月 30 日	8	<p>国籍:中国。学历:天津大学管理学硕士。从业资格: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</p>

				<p>月 30 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富货币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至今任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富添富通货币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至今任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2018 年 8 月 7 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理助理。2018 年 8 月 7 日至今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 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2019 年 1 月 25 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。</p>
--	--	--	--	---

					2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

#### 4.1.1 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:本报告期末本基金不存在基金经理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

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成,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。

对于同向交易,我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下(日内、3 日内和 5 日内)同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异(即价差率)序列,然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、

同向交易占优比等方面进行综合分析,来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易,我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析,未发现异常情况。

综合而言,本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

#### 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 4 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

四季度社融增速创新高,在信贷和基建的共同发力下,以汽车为代表的制造业见底回升,工业生产继续回暖,消费持续改善并恢复正增长,出口延续高增长态势,整体而言经济基本面仍然处于复苏过程之中。货币政策相应表现为中性偏稳健,10 月份开始投放力度明显减少,银行类金融机构受制于结构性存款压降任务和超储率偏低,缺乏稳定负债来源,对同业存单发行较为依赖,1 年期同业存单最高上行至 3.4%,远高于 MLF 利率,债市收益率相应走高,尤其是在 11 月中旬受到永煤事件冲击之后快速飙升,10 年国债最高触碰 3.35%。11 月底央行意外增加 MLF 投放 2000 亿,并在 12 月份进行持续公开市场操作投放资金,银行间资金面转松,与 11 月份高点相比,1 年同业存单下行 50BP 至 2.9%,3 年期金融债下行 40BP 至 3%,10 年期金融债则下行 20BP 至 3.55%。

本组合为原汇添富理财 7 天转型而来,投资范围转换为利率债,考虑到组合尚在建仓期,久期处于中性偏低水平,后续会视市场变化和收益率水平做进一步调整。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 1.06%。同期业绩比较基准收益率为 0.82%。

#### 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（转型后）

## 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	3,342,342,000.00	64.41
	其中：债券	3,342,342,000.00	64.41
	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	1,440,000,000.00	27.75
	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	40,084,165.77	0.77
8	其他资产	367,116,549.34	7.07
9	合计	5,189,542,715.11	100.00

## 5.2 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。

## 5.3 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	49,480,000.00	0.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,292,862,000.00	63.47
	其中：政策性金融债	3,292,862,000.00	63.47
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	3,342,342,000.00	64.42

#### 5.4 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	190202	19 国开 02	5,200,000	522,392,000.00	10.07
2	200312	20 进出 12	4,600,000	460,828,000.00	8.88
3	200207	20 国开 07	4,000,000	400,440,000.00	7.72
4	200302	20 进出 02	3,200,000	317,184,000.00	6.11
5	200201	20 国开 01	2,800,000	280,028,000.00	5.40

#### 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。

#### 5.6 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。

### 5.7 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资股指期货。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1

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。

#### 5.10.2

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。

#### 5.10.3 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	308,416,076.06
3	应收股利	-
4	应收利息	58,700,473.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	367,116,549.34

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 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。

## § 5 投资组合报告（转型前）

## 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	2,042,050,000.00	42.03
	其中：债券	2,042,050,000.00	42.03
	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	1,690,000,000.00	34.79
	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	1,111,055,374.81	22.87
8	其他资产	15,084,975.98	0.31
9	合计	4,858,190,350.79	100.00

## 5.2 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。

## 5.3 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	973,959,000.00	22.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	239,586,000.00	5.63
	其中：政策性金融债	239,586,000.00	5.63
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	828,505,000.00	19.46
9	其他	-	-
10	合计	2,042,050,000.00	47.96

#### 5.4 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	209946	20 贴现国债 46	5,000,000	497,300,000.00	11.68
2	209951	20 贴现国债 51	4,100,000	407,335,000.00	9.57
3	112010041	20 兴业银行 CD041	3,500,000	339,815,000.00	7.98
4	112017271	20 光大银行 CD271	2,000,000	195,260,000.00	4.59
5	112008277	20 中信银行 CD277	2,000,000	195,260,000.00	4.59

#### 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。

#### 5.6 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。

#### 5.7 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资股指期货。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1

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。

#### 5.10.2

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。

#### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	28,125.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,056,850.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,084,975.98

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 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（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2020 年 10 月 30 日）基金份额总额	4,244,852,247.3
本报告期基金总申购份额	894,791,838.7
减：本报告期基金总赎回份额	5,925,531.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,133,718,554.11

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。

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	汇添富理财 7 天债券 A	汇添富理财 7 天债券 B
本报告期期初基金份额总额	53,392,669.1	-
本报告期基金总申购份额	-	4,195,082,215.57
减：本报告期基金总赎回份额	3,618,407.42	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,774,261.68	4,195,082,215.57

注：1、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。2、本基金的基金份额转换基准日（折算基准日）为 2020 年 10 月 29 日。基金管理人在份额转换基准日进行转换，最终将理财 7 天 A 与恒理财 7 天 B 份额转换为汇添富利率债债券型证券投资基金的份额，转换后的汇添富利率债基金份额为：4,244,852,247.30 份。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

注：本基金的基金管理人本报告期末未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	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	期初	申购份额	赎回	持有份额

类别		份额比例达到或者超过 20%的时间区间	份额		份额		(%)
机构	1	2020 年 10 月 16 日至 2020 年 12 月 17 日	-	997,506,234.41	-	997,506,234.41	19.43
	2	2020 年 10 月 16 日至 2020 年 12 月 17 日	-	997,506,234.41	-	997,506,234.41	19.43
	3	2020 年 10 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日	-	1,495,513,459.62	-	1,495,513,459.62	29.13

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

注：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 7 天债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富理财 7 天债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富理财 7 天债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富利率债债券型证券投资基金基金合同》；
- 5、《汇添富利率债债券型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富利率债债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件；
- 9、报告期内汇添富理财 7 天债券型证券投资基金和汇添富利率债债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 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 01 月 22 日