# 汇添富多元收益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 | 汇添富多元收益债券 | |
| 基金主代码 | 470010 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年9月18日 | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,192,414,883.66份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 汇添富多元收益债券A | 汇添富多元收益债券C |
| 下属分级基金的交易代码: | 470010 | 470011 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,093,122,792.29份 | 99,292,091.37份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券类固定收益品种,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,适度参与权益类资产投资,力争实现资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 基金的投资组合比例为:本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数*90%+沪深300指数*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。 |

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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李鹏 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-28932888 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | service@99fund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-9918 | 95566 |
| 传真 | | 021-28932998 | 010-66594942 |

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层 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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 汇添富多元收益债券A | 汇添富多元收益债券C | 汇添富多元收益债券A | 汇添富多元收益债券C | 汇添富多元收益债券A | 汇添富多元收益债券C |
| 本期已实现收益 | 57,479,250.28 | 11,494,813.96 | 72,553,468.53 | 40,786,769.44 | 30,406,314.16 | 10,162,321.67 |
| 本期利润 | 17,712,843.18 | -908,692.70 | 79,939,455.75 | 37,401,763.33 | 92,466,011.91 | 15,200,678.16 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0142 | -0.0033 | 0.1450 | 0.1084 | 0.2074 | 0.2916 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.46% | 1.06% | 14.19% | 13.61% | 28.99% | 28.46% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | | 2015年末 | | 2014年末 | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0420 | 0.0203 | 0.0869 | 0.0706 | 0.0857 | 0.0762 |
| 期末基金资产净值 | 1,253,453,504.02 | 111,713,213.87 | 915,596,158.05 | 537,078,843.98 | 319,101,903.57 | 89,793,281.13 |
| 期末基金份额净值 | 1.147 | 1.125 | 1.219 | 1.202 | 1.193 | 1.184 |

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.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9月18日,至本报告期末未满五年,因此主要会计数据和财务指标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 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富多元收益债券A

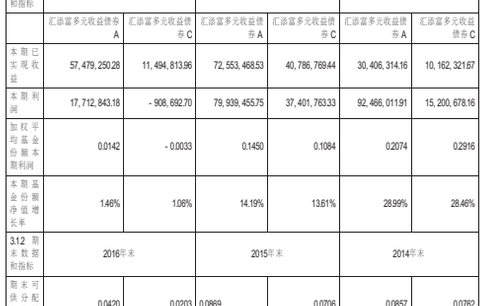
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.65% | 0.15% | -1.91% | 0.17% | 0.26% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.17% | 0.14% | -0.78% | 0.14% | 0.61% | 0.00% |
| 过去一年 | 1.46% | 0.29% | -2.59% | 0.17% | 4.05% | 0.12% |
| 过去三年 | 49.45% | 0.48% | 12.48% | 0.20% | 36.97% | 0.28% |
| 自基金合同生效日起至今 | 55.46% | 0.47% | 9.35% | 0.19% | 46.11% | 0.28% |

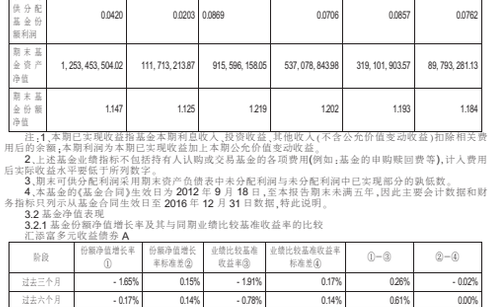
汇添富多元收益债券C

| 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 | -1.76% | 0.15% | -1.91% | 0.17% | 0.15% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.35% | 0.14% | -0.78% | 0.14% | 0.43% | 0.00% |
| 过去一年 | 1.06% | 0.29% | -2.59% | 0.17% | 3.65% | 0.12% |
| 过去三年 | 47.49% | 0.48% | 12.48% | 0.20% | 35.01% | 0.28% |
| 自基金合同生效日起至今 | 52.53% | 0.47% | 9.35% | 0.19% | 43.18% | 0.28% |

注:本基金的(基金合同)生效日为2012年9月18日,至本报告期末未满五年。

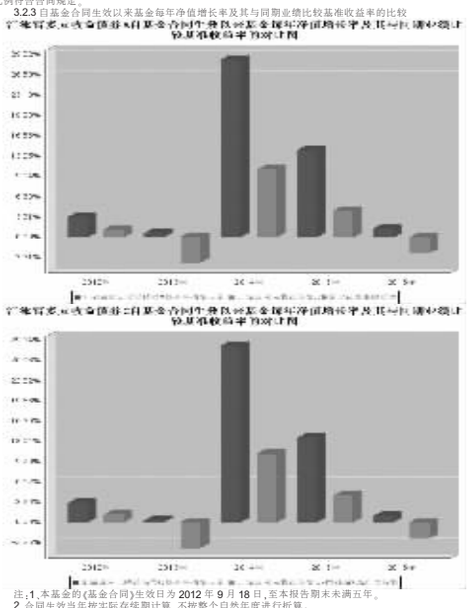
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2012年9月18日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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9月18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

汇添富多元收益债券A

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2016 | 0.900 | 92,710,982.96 | 8,700,591.38 | 101,411,574.34 | |
| 2015 | 1.400 | 87,066,810.75 | 4,955,956.81 | 92,022,767.56 | |
| 2014 | 0.980 | 26,053,442.02 | 2,092,748.90 | 28,146,190.92 | |
| 合计 | 3.280 | 205,831,235.73 | 15,749,297.09 | 221,580,532.82 | |

汇添富多元收益债券C

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2016 | 0.900 | 13,988,290.83 | 1,740,086.17 | 15,728,377.00 | |
| 2015 | 1.400 | 55,146,106.53 | 2,899,607.11 | 58,045,713.64 | |
| 2014 | 0.950 | 4,903,052.69 | 1,024,445.76 | 5,927,498.45 | |
| 合计 | 3.250 | 74,037,450.05 | 5,664,139.04 | 79,701,589.09 | |

## §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,做中长期投资市场,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认高到低的各类产品,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,陆续完成交金中心体系、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,公司成功签获基本养老保险基金管理人资格,未来将为做好被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,搭建了裴胥投顾式服务、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,成为其四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。9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,财富管理行业走混业竞争、互联网金融、跨地域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、奋勇担搏、砥砺前行,为实现中国梦追砖加瓦,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 | | |
| 曾刚 | 汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富1年期开放债券基金、汇添富安保本混合基金、汇添富稳健保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,固定收益投资副总监。 | 2012年9月18日 | - | 15年 | 国籍:中国。学历:中国科技大学学士,清华大学MBA。业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月15日至2010年2月5日任华富货币基金的基金经理,2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金,现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天的基金经理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益的基金经理,2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天的基金经理,2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券的基金经理,2013年5月29日至2015年3月31日任汇添富理财7天的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富实业债的基金经理,2013年9月12至2015年3月31日任汇添富现金宝货币的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券的基金经理,2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合的基金经理,2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放债券的基金经理,2016年4月19日至今任汇添富安保本混合的基金经理,2016年8月3日至今任汇添富富稳保本混合的基金经理,2016年9月29日至今任汇添富保鑫保本混合的基金经理,2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券的基金经理。 |
| 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。 | 2014年4月8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、理财期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。 |

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、证监会规定的本基金合同的约定,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;贯穿了投权、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、投研研究联席会议等投研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、海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,所有外汇交易执行由集中交易室处理,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,对组织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%,同向交易方向比较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

从年初的宏观预期来看,2016年一开始就充满各种担忧,,但后续政策频出,房地产和基建再次发力;三季度开始经济显著企稳,宏体企业盈利、民间投资、信贷等多项经济指标出现好转,16年行政性去产能改变了预期,基础工业材料等价格飞涨,PPI快速转正,对CPI也有拉升;外部则多起政治黑天鹅事件带来冲击,反而有利于国内,人民币贬值后回稳,压力减缓,汇总到经济上看,完成6.5%基本没有问题。但在货币政策方面,G20前后,全球的货币政策引向一个共识,需要逐步收紧,从08年危机后的量化宽松逐步正常化,各国国债收益率经历了一个上升的过程,曾经负利率的十多个国家企都转正;国内,出于防风险和促进降杠杆的考虑,央行在三季度开始实施"锚短债长",债市经历了最后两个月的暴跌,全年债券指数收益所剩无几。

而国内股票市场,在1月主句的熔断冲击之后,信心难以恢复,基本面在年初几个月都是偏弱的,对增量资金的吸引力不大,热点集中在有限的主题和板块;全年看,食品饮料、家电等蓝筹板块表现抢眼,银行、超大盘个股也有稳定表现,而中小创资金净流出,尤其是下半年走势疲弱。

上半年受股市影响,可转债缺乏系统性机会,持续处于挤压估值的阶段,至年中,可转债逐步上行,但在年末纯债暴跌,规模冲击之际,可转债出现过度下跌,全年中证转债负债幅在10%左右。

2016年,本组合净值上涨1.46%,纯债部分中性配置,注重流动性,一定程度上规避了风险,获得了较稳健的收益;而可转债部分逐步积极,有一定贡献,权益部分整体中性略偏高的配置比例,前三个季度好于基准,最后两个月跌幅较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本年度本基金A级净值收益率为1.46%,C级净值收益率为1.06%,同期业绩比较基准收益率为-2.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在当前时点:2017年,我们认为今年经济增速的压力不大,补库存可能维持到二季度末甚至部分行业再延后,特别要上任后对中美贸易战的担忧逐步消化,出口不会好但也不会差得离谱;我们对经济的担忧是放在下半年,积极财政政策面临杠杆率过高的牵制,资金支持可能不够充分,同时补库存达到一定水平后,需要新的实体增长动力来整固和加强,但2017年内外部的风险因素都有一些,节奏上可能和16年正好相反,在乐观中出发,但后续压力会较大。

此外,监管层面对降低金融杠杆的硬指标,上半年货币政策都很审放松,叠加当前对降低金融风险的重视,我们认为上半年纯债都需要强调防御意识,而可转债的性价比在再融资新规出来后明显下降,同时将发行转债的总量不少,也会影响转债的估值;权益部分相对乐观,但新增资金规模的大小决定了后续行情的高度,当前只能说边走着,相对乐观。

本基金将努力在相对较低风险的前提下,做好大类资产配置,从中期把握转换时机,精选投资品种,保持组合稳健性、合理地采担有价值的风险,力争为持有的投资者创造持续稳定优良的投资业绩。

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发刊、专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从员,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:在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多12次,最少2次;每次基金收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的40%,基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算,可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月,收益可不分配。

本基金于2016年7月29日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.5元人民币。

本基金于2016年12月27日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.4元人民币。

4.10 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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在汇添富多元收益债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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_B27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:汇添富多元收益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 | 6,233,595.99 | 57,346,381.81 |
| 结算备付金 | 8,859,218.67 | 6,243,139.70 |
| 存出保证金 | 192,986.76 | 205,849.26 |
| 交易性金融资产 | 1,479,434,474.12 | 1,699,772,121.03 |
| 其中:股票投资 | 135,468,615.24 | 130,220,924.60 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 1,324,091,858.88 | 1,569,551,196.43 |
| 资产支持证券投资 | 19,874,000.00 | - |
| 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 | 2,432,640.00 | 419,691.70 |
| 应收利息 | 18,402,197.48 | 23,990,188.20 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 264,698.40 | 704,011.48 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,515,819,811.42 | 1,788,681,383.18 |
| 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 | 143,500,000.00 | 329,499,048.00 |
| 应付证券清算款 | 4,539,861.40 | 3,852,513.24 |
| 应付赎回款 | 217,824.81 | 615,604.13 |
| 应付管理人报酬 | 1,106,458.98 | 856,270.18 |
| 应付托管费 | 316,131.13 | 244,648.62 |
| 应付销售服务费 | 76,797.45 | 175,273.13 |
| 应付交易费用 | 489,773.40 | 311,676.28 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 6,109.39 | 50,430.28 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 400,136.97 | 400,917.29 |
| 负债合计 | 150,653,093.53 | 336,006,381.15 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,192,414,883.66 | 1,198,101,202.62 |
| 未分配利润 | 172,751,834.23 | 254,573,799.41 |
| 所有者权益合计 | 1,365,166,717.89 | 1,452,675,002.03 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,515,819,811.42 | 1,788,681,383.18 |

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.145元,基金份额总额1,192,414,883.66份,其中下属A类基金份额参考净值1.147元,份额总额1,093,122,792.29份;下属C类基金份额参考净值1.125元,份额总额99,292,091.37份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富多元收益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 | 42,880,378.65 | 135,923,484.55 |
| 1.利息收入 | 69,575,433.54 | 49,902,964.97 |
| 其中:存款利息收入 | 523,390.59 | 388,525.09 |
| 债券利息收入 | 68,970,034.10 | 48,782,166.02 |
| 资产支持证券利息收入 | 66,969.86 | 626,875.59 |
| 买入返售金融资产收入 | 15,038.99 | 105,398.27 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 25,045,125.54 | 81,638,692.99 |
| 其中:股票投资收益 | 17,955,916.06 | 57,591,828.33 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 6,107,625.84 | 22,905,067.83 |
| 资产支持证券投资收益 | - | 6,000.00 |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 981,583.64 | 1,135,796.83 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -52,169,913.76 | 4,000,981.11 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 429,733.33 | 380,845.48 |
| 减:二、费用 | 26,076,228.17 | 18,582,265.47 |
| 1.管理人报酬 | 12,834,350.63 | 7,774,519.12 |
| 2.托管费 | 3,666,957.32 | 2,221,291.24 |
| 3.销售服务费 | 1,325,580.97 | 1,685,753.62 |
| 4.交易费用 | 3,106,671.21 | 1,935,810.18 |
| 5.利息支出 | 4,655,140.98 | 4,471,803.76 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 4,655,140.98 | 4,471,803.76 |
| 6.其他费用 | 487,527.06 | 493,087.55 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 16,804,150.48 | 117,341,219.08 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富多元收益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) | 1,198,101,202.62 | 254,573,799.41 | 1,452,675,002.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期净利润) | - | 16,804,150.48 | 16,804,150.48 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | -5,686,318.96 | 18,513,835.68 | 12,827,516.72 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,065,723,350.63 | 423,479,907.93 | 2,489,203,258.56 |
| 2.基金赎回款 | -2,071,409,669.59 | -404,966,072.25 | -2,476,375,741.84 |
| 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) | - | -117,139,951.34 | -117,139,951.34 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,192,414,883.66 | 172,751,834.23 | 1,365,166,717.89 |

| 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) | 343,271,136.23 | 65,624,048.47 | 408,895,184.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期净利润) | - | 117,341,219.08 | 117,341,219.08 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | 854,830,066.39 | 221,677,013.06 | 1,076,507,079.45 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,851,446,141.71 | 719,372,160.02 | 3,570,818,301.73 |
| 2.基金赎回款 | -1,996,616,075.32 | -497,695,146.96 | -2,494,311,222.28 |
| 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) | - | -150,068,481.20 | -150,068,481.20 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,198,101,202.62 | 254,573,799.41 | 1,452,