汇添富盈安保本混合型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司
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。
基金托管人中国建设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4月19日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富盈安保本混合
基金主代码	002419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月19日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,279,046,304.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,利用组合保险技术,动态调整安全资产与风险资产的投资比例,以确保基金在保本周期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	田青
	联系电话	021-28932888	010-67595096
	电子邮箱	service@99fund.com	tianqing12h@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	010-67595096
传真		021-28932998	010-66275853

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

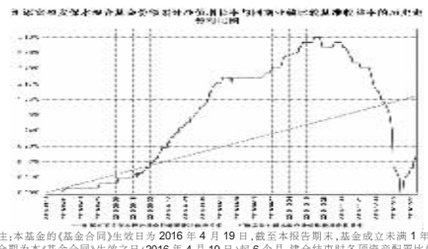
金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年4月19日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	80,047,726.68
本期利润	36,642,252.29
加权平均基金份额本期利润	0.0082
本期基金份额净值增长率	0.70%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0073
期末基金资产净值	4,310,250,940.72
期末基金份额净值	1.007

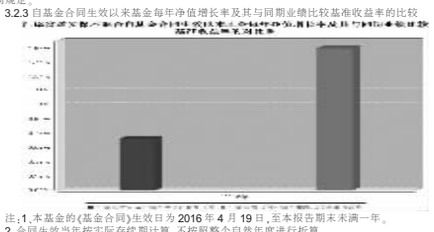
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.95%	0.12%	0.69%	0.01%	-2.64%	0.11%
过去六个月	0.10%	0.10%	1.38%	0.01%	-1.28%	0.09%
自基金合同生效日起至今	0.70%	0.09%	1.93%	0.01%	-1.23%	0.08%

注:本基金的《基金合同》生效日为2016年4月19日,至本报告期末满一年。
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:本基金的《基金合同》生效日为2016年4月19日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2016年4月19日)起6个月,建仓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2016年4月19日,至本报告期末未满一年。
2.合同生效当年按实际存续期计算,不按照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
注:本基金本报告期内未进行利润分配。

§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、汇添富金额宝获得"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,公司成功签约社保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、现金宝的金新客服体系,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"员工与扶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"阿斌·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沙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		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、汇添富交鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富益稳保本混合基金、汇添富保本混合基金、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。	2016年4月19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日至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日至今任汇添富盈安保本混合的基金经理,2016年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合的基金经理,2016年9月29日至今任汇添富鑫盈保本混合的基金经理。
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金的基金经理。	2016年4月19日	-	5年	国籍:中国,学历:厦门大学金融工程硕士。2011年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015年7月17日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2016年4月19日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理,2016年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理,2016年9月29日至今任汇添富鑫盈保本混合基金的基金经理。

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、投研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年债券市场一波三折,一季度信贷快速增长,房地产价格飙升,同时部分产能过剩行业信用债券违约风险频发引发债券基金的大幅赎回,债券市场持续调整。二、三季度在权威人士讲话、英国脱欧外部冲击、银行委外加杠杆等利好因素冲击下,债券市场大幅反弹,收益率一度创2008年以来新低。但随着全球央行货币政策适度转向,美元大幅走强、美债收益率大幅上升等外部因素和国内大宗商品价格持续暴涨、金融机构去杠杆等内部因素的共同作用下,四季度债券市场持续快速暴跌。股票市场年初熔断后,指数整体窄幅震荡,但结构上出现明显分化,低估值的价值股被市场认可,以创业板为代表的小盘股则持续调整。可转债全年估值去泡沫,四季度跟随债券市场大幅调整。
具体来看,中债综合财富指数2016年上涨1.3%,沪深300全年下跌11.3%,中证可转债指数下跌11.8%。
报告期内,本组合重点配置了同保本期匹配的债券,评级以中高等级为主,上半年久期和杠杆水平均高于下半年。四季度债券收益率快速上行,组合中持有至到期债券亏损严重,导致基金净值回撤较大。考虑到组合安全垫偏薄,报告期内股票和可转债配置比例较低。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
2016年本基金净值收益率为0.7%,同期业绩比较基准收益率为1.93%。
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,房地产销量下滑将在二季度开始逐渐对终端需求及宏观经济造成下行压力。在货币政策受到内外多重约束环境下,财政与准财政政策将进一步加大力度,预计全年经济与企业盈利增速前高后低。海外美国经济的周期性复苏和美联储加息预期还将继续推动美元走强,加大汇率和国内流动性的压力。大类资产配置上,货币政策保持中性偏紧,利率难有趋势性下行机会,去杠杆导致流动性波动是潜在风险。股票市场受益于经济和盈利的改善,但IPO发行提速及巨额再融资解禁,资金面不容乐观,股市中期仍难以摆脱震荡市格局。
考虑到保本基金的特性,本组合主要配置同保本期匹配的固定收益类资产,优先选择中高评级的债券,并保持组合的流动性。风险资产方面,待组合安全垫增厚后,对可转债和股票操作转为积极,核心配置以高分红低估值的价值股为主。本基金将在承担有价值的风险下,力争为持有人创造持续稳定的投资收益。
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有人利益为宗旨,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根据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及时、有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。
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
本基金本报告期内未进行利润分配。
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盈安保本混合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,汇添富盈安保本混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富盈安保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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。本报告期内,汇添富盈安保本混合型证券投资基金未进行利润分配。
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股份有限公司编制和披露的汇添富盈安保本混合型证券投资基金2016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、陈军于2017年3月28日签字出具了安永华明(2017)审字第60466941_B64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:汇添富盈安保本混合型证券投资基金
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
资产:	
银行存款	308,524,669.34
结算备付金	67,552,858.79
存出保证金	142,745.30
交易性金融资产	4,565,393,346.94
其中:股票投资	72,539,043.72
基金投资	-
债券投资	4,492,854,303.22
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	414,889,503.88
应收证券清算款	-
应收利息	65,949,613.23
应收股利	-
应收申购款	1,980.98
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	5,422,454,718.46
负债和所有者权益	本期末 2016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	1,103,679,500.03
应付证券清算款	1,757,885.31
应付赎回款	732,240.38
应付管理人报酬	4,432,393.93
应付托管费	738,732.32
应付销售服务费	-
应付交易费用	300,639.64
应交税费	-
应付利息	272,344.83
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	290,041.30
负债合计	1,112,203,777.74
所有者权益:	
实收基金	4,279,046,304.57
未分配利润	31,204,636.15
所有者权益合计	4,310,250,940.72
负债和所有者权益总计	5,422,454,718.46

1.(1)报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.007元,基金份额总额4,279,046,304.57份。
(2)本基金合同于2016年4月19日生效。
7.2 利润表
会计主体:汇添富盈安保本混合型证券投资基金
本报告期:2016年4月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年4月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	93,671,916.14
1.利息收入	110,773,901.43
其中:存款利息收入	19,861,548.04
债券利息收入	89,891,645.13
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,020,708.26
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	19,579,050.26
其中:股票投资收益	5,294,193.22
基金投资收益	-
债券投资收益	14,011,529.24
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	273,327.80
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-43,405,474.39
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,724,438.84
减:二、费用	57,029,663.85
1.管理人报酬	38,148,660.64
2.托管费	6,358,110.15
3.销售服务费	-
4.交易费用	1,080,885.45
5.利息支出	11,099,020.26
其中:卖出回购金融资产支出	11,099,020.26
6.其他费用	342,987.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	36,642,252.29

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:汇添富盈安保本混合型证券投资基金
本报告期:2016年4月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年4月19日(基金合同生效日)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)	4,570,074,199.91	-	4,570,074,199.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	36,642,252.29	36,642,252.29
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)	-291,027,895.34	-5,437,616.14	-296,465,511.48
其中:1.基金申购款	38,968,527.36	787,904.76	39,756,432.12
2.基金赎回款	-329,996,422.70	-6,225,520.90	-336,221,943.60
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,279,046,304.57	31,204,636.15	4,310,250,940.72

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
汇添富盈安保本混合型证券投资基金(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[2016]202号文《关于准予汇添富盈安保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司作为基金管理人于2016年3月21日至2016年4月15日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60466941_B07号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年4月19日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币4,567,773,347.51元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币2,300,852.40元,以上实收基金(本息)合计为人民币4,570,074,199.91元,折合4,570,074,199.91份基金份额。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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)等),资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款),货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金参与融资业务,本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款收益率(税后)。
7.4.2 会计报表的编制基础
本财务报表系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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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日的财务状况以及2016年4月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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
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。
7.4.5 差错更正的说明
本基金本期无重大会计差错的内容和更正金额。
7.4.6 税项
7.4.6.1 印花税
经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;
经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整出出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。
根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。
7.4.6.2 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,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券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税纳税人;
根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定,2017年7月1日(含)以后,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税纳税人,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。
7.4.6.3 企业所得税
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,继续免征企业所得税;
根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;
根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
7.4.6.4 个人所得税
根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;
根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;
根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额;
根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知