

民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金

基金管理人:民生加银基金管理有限公司
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30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当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期2016年1月1日起至2016年12月31日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|-----------------|-------------------|
| 基金简称 | 民生加银平稳添利债券 |
| 场内简称 | 民生添利 |
| 基金主代码 | 160694 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年8月12日 |
| 基金管理人 | 民生加银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期基金份额总额 | 2,608,285,046.94份 |
| 基金合同存续期 | 不长期 |
| 基金的上市场所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2013年10月29日 |
| 下属分级基金的基金简称: | 民生加银平稳添利债券A |
| 报告期下属分级基金的份额总额: | 2,547,188,910.30份 |
| 报告期下属分级基金的份额总额: | 51,096,129.64份 |

2.2 基金产品说明

投资目标 在控制基金资产风险、适度保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金采取自下而上的投资策略,基金管理人对宏观经济、政策导向、资金面、微观数据信息进行综合分析,同时为合理把握基金开放期的流动风险,并满足首次及定期开放期流动性需求,本基金在每个开放期的头尾各设置5%的流动性受限资产,并将基金资产所投资产的平均剩余期限在基金开放期的头尾各设置5%的流动性受限资产,微调投资策略。

业绩比较基准 三年定期存款利率(税后)+0.2%

风险收益特征 本基金属于中低风险收益特征的证券投资基金,风险收益特征低于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

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 | 民生加银基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 姓名 | 林海 | 田青 |
| 信息披露负责人 | 0755-23996888 | 010-67056006 |
| 联系电话 | linhai@myfund.com.cn | tianqing@ccb.com |
| 电子邮箱 | linhai@myfund.com.cn | 010-67056006 |
| 客户服务电话 | 400-888-3388 | 010-67056006 |
| 传真 | 0755-23996800 | 010-66275863 |

2.4 信息披露方式

| | |
|-------------------|-----------------------|
| 基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.myfund.com |
| 基金管理人和基金托管人的住所 | |

§ 3 主要财务指标、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

| 期间 | 2016年 | | 2015年 | | 2014年 | |
|--------|------------------|-------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|
| | 期初基金 | 期末基金 | 期初基金 | 期末基金 | 期初基金 | 期末基金 |
| 本期 | 169,926,604.00 | 6,798,171,378.00 | 9,627,192,920.00 | 121,398,369.04 | 7,077,982.44 | 508,000.00 |
| 本期利润 | 97,373.45 | 4,056,249,374.00 | 14,512,250.00 | 236,870.00 | 13,714,688.47 | 908.56 |
| 加权平均基金 | 6.08% | 4.02% | 14.90% | 14.35% | 14.85% | 14.35% |
| 本期 | 0.0409 | 0.0577 | 0.1519 | 0.1472 | 0.1437 | 0.1391 |
| 本期 | 0.0370 | 0.0350 | 0.0330 | 0.0305 | 0.0476 | 0.0442 |
| 本期 | 2,767,796,604.00 | 65,207,186,931.00 | 1,861,922,412.13 | 110,926,919.00 | 1,765,080,026.00 | 106,631,588.14 |
| 本期 | 1,083 | 1,080 | 1,128 | 1,125 | 1,075 | 1,072 |

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

民生加银平稳添利债券A

| 阶段 | 份额净值增长 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准 | 收益率差 | ①-③ | ②-④ |
|--------------|--------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|
| 过去三个月 | -0.57% | 0.10% | -2.42% | 0.15% | 1.85% | - | -0.05% |
| 过去六个月 | 2.93% | 0.09% | -1.80% | 0.10% | 4.73% | - | -0.01% |
| 过去一年 | 6.08% | 0.09% | -0.07% | 0.08% | 5.65% | 0.01% | 0.08% |
| 过去三年 | 38.66% | 0.13% | 6.85% | 0.05% | 31.81% | 0.08% | 0.08% |
| 自基金合同生效之日起至今 | 36.44% | 0.13% | 8.62% | 0.04% | 27.82% | 0.09% | 0.09% |

民生加银平稳添利债券C

| 阶段 | 份额净值增长 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准 | 收益率差 | ①-③ | ②-④ |
|--------------|--------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|
| 过去三个月 | -0.75% | 0.10% | -2.42% | 0.15% | 1.67% | - | -0.06% |
| 过去六个月 | 2.65% | 0.08% | -1.80% | 0.10% | 4.46% | - | -0.02% |
| 过去一年 | 4.62% | 0.09% | -0.07% | 0.08% | 5.19% | 0.01% | 0.01% |
| 过去三年 | 36.84% | 0.13% | 6.85% | 0.05% | 30.99% | 0.08% | 0.08% |
| 自基金合同生效之日起至今 | 34.51% | 0.13% | 8.62% | 0.04% | 25.89% | 0.09% | 0.09% |

注:业绩比较基准=中国债券综合指数收益率

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:本基金合同于2013年8月12日生效,本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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:本基金合同于2013年8月12日生效,基金合同每年净值增长率率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2013年8月12日生效,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

注:本基金合同于2013年8月12日生效,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。

信息披露 Disclosure

2016年度报告摘要

结束之日次日起(包括该日)一年的期间,财务数据不受影响,因此转前后续连续计算,不分开列示。

7.2 利润表

会计主体:民生加银平稳添利定期开放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 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|---------|----------------|----------------|
| 一、收入 | | 140,857,679.98 | 318,194,466.02 |
| 1.利息收入 | | 179,413,378.11 | 201,360,397.62 |
| 其中:存款利息收入 | 747,111 | 464,590.07 | 1,123,895.12 |
| 债券利息收入 | | 170,210,512.00 | 200,722,594.48 |
| 贵金属租赁收入 | | - | - |
| 贵金属买卖收入 | | 738,276.16 | 104,793.02 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”号填列) | | 28,915,668.98 | 33,573,796.01 |
| 其中:股票投资收益 | 747,12 | - | - |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 747,13 | 25,915,668.98 | 33,573,796.01 |
| 贵金属买卖收入 | | - | - |
| 贵金属买卖损失(减:收入以“-”号填列) | | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | -64,691,636.96 | 82,669,731.40 |
| 其中:股票投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 4.其他收入(减:损失以“-”号填列) | | 747,14 | 272,666 |
| 减:费用 | | 30,608,036.18 | 64,308,034.04 |
| 1.管理人报酬 | 749,21 | 15,904,624.10 | 13,342,838.94 |
| 2.托管费 | 749,22 | 4,544,162.07 | 3,812,230.69 |
| 3.销售收入 | 749,23 | 366,736.17 | 4,300,996.61 |
| 4.交易费用 | 747,15 | - | - |
| 5.利息支出 | 747,16 | - | - |
| 6.利润支出 | 747,17 | 17,265,797.59 | 36,163,476.76 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 17,265,797.59 | 36,163,476.76 |
| 7.其他费用 | 747,20 | 496,769.30 | 560,308.30 |
| 三、利润总额(| | | |