汇添富多元收益债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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:2018年3月28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2018年3月26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2017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	383,681,827.05份	
基金合同存续期	不定期	
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	360,919,939.59份	22,761,887.46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,追求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21-23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	2017年		2016年		2015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	-15,804,899.61	-3,250,331.87	57,479,250.28	11,494,813.96	72,553,468.53	40,786,769.44
本期利润	5,094,028.31	1,293,060.63	17,712,843.18	-908,692.70	79,939,455.75	37,401,763.33
加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0189	0.0142	-0.0033	0.1450	0.1084
本期基金份额净值增长率	4.29%	3.91%	1.46%	1.06%	14.19%	13.61%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0069	-0.0027	0.0420		0.0869	0.0706
期末基金资产净值	425,782,406.27	26,606,023.05	1,253,453,504.02	111,713,213.87	915,596,158.05	537,078,843.98
期末基金份额净值	1.180	1.169	1.147	1.125	1.219	1.202

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。

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

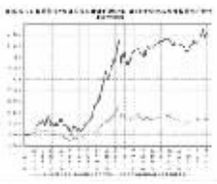
汇添富多元收益债券A

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	2.67%	0.35%	-0.53%	0.09%	3.20%	0.26%
过去六个月	5.21%	0.30%	-0.18%	0.08%	5.39%	0.22%
过去一年	4.29%	0.24%	-0.87%	0.09%	5.16%	0.15%
过去三年	20.83%	0.41%	0.53%	0.19%	20.30%	0.22%
过去五年	56.95%	0.45%	7.36%	0.18%	49.59%	0.27%
自基金合同生效日起至今	62.13%	0.44%	9.33%	0.18%	52.80%	0.26%

汇添富多元收益债券C

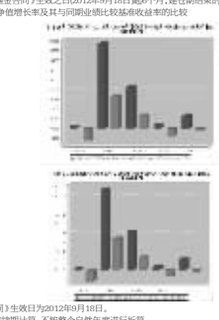
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.54%	0.37%	-0.53%	0.09%	3.07%	0.28%
过去六个月	5.03%	0.31%	-0.18%	0.08%	5.21%	0.23%
过去一年	3.91%	0.24%	-0.87%	0.09%	4.78%	0.15%
过去三年	19.30%	0.41%	0.53%	0.19%	18.77%	0.22%
过去五年	53.73%	0.45%	7.36%	0.18%	46.37%	0.27%
自基金合同生效日起至今	58.50%	0.44%	9.33%	0.18%	49.17%	0.26%

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 过去五年基金每年净值增长率及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。

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
2017	0.160	5,303,348.30	334,256.96	5,637,605.26	
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	
合计	2.460	185,081,142.01	13,990,805.15	199,071,947.16	

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
2017	-	-	-	-	
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	
合计	2.300	69,134,397.36	4,639,693.28	73,774,090.64	

§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

汇添富基金成立于2005年2月,是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务辐照齐全,拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、ROFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金日成立以来,始终将投资业绩放在首位,形成了独树一帜的品牌优势,被冠为"选股专家",并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务,赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

目前,汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模庞的的大型基金公司,截至2017年12月31日,汇添富资产管理总规模超过5600亿元,其中公募资产管理规模(剔除货基)已经11892亿元,位居行业第7;服务客户超过6000万人。根据银河证券基金研究中心数据,汇添富旗下股票基金最近3年,5年的股票投资主动管理平均收益率分别达到89.86%、184.98%,在公募规模(不含货基)前十大基金公司中均排名第一。优秀的业绩赢得了行业与市场的高度认可,2017年,汇添富基金荣获"金基金TOP公司奖"、"三年持续回报明星基金公司"、"优秀资产管理机构"等奖项,汇添富价值精选、汇添富民营活力荣获"五年期开放式混合型持续优胜金牛基金",汇添富上海同企ETF荣获"上海金融创新成果奖"、"添富智投"荣登"2017中国智能投顾新锐榜"。

2017年,汇添富基金新发行22只公募基金,包括11只混合型基金,5只债券基金,3只债券基金以及3只QDII基金。其中,上证上海改革发展主题ETF为助力国企改革的创新产品,汇添富全球移动互联混合基金和汇添富全球医疗保健混合基金在境海外市场,进一步丰富了公司的国际产品线。全年,公司管理公募基金产品达到97只,涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、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。

2017年,汇添富基金大力发展自有平台建设,不断引领行业创新。全年推出多款树立行业标杆的产品特点:添富智投、添富养老、汇闪付、工资宝、理财日历、在线客服机器人等。规模稳定在千亿级别,服务客户数量超5000万,处于行业领先水平。与此同时,互联网金融对外合作业务取得重大突破。截至年底,对外合作伙伴数量已超80家,成为业内对外合作最多的公司之一。

2017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2900亿元;获得全国社保基金及基本养老保险基金投资管理人资格,社保基金和基本养老保险基金业务规模快速增长,受托管理组合能力取益持续增加。

2017年,公司顺应并满足渠道销售和特别工作,专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升了汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动,营销销训活动机展到银行机构直的网点,营业部。

2017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早会建设,搭建了囊括投顾式服务、基金理财、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。同时,持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设,丰富服务渠道,提高客服输。

2017年,香港子公司在加强母公司投研一体化基础上,深入发掘港股价值洼地,港股投资及海外债券投资业绩持续优异,汇添富中港策略基金获颁最星三年五星评级,在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一;汇添富港市债券基金获得最星三年四星评级,在同类型基金中持续名列第一。社保海外组合业绩在所有社保管理人中排名第一。

2017年,公司公募业务始发展,公益活动精彩纷呈,公益品牌效果上一个台阶。一是依托公司旗下上海汇添富公益基金会的专业平台,连续第十年开展"同流?孩子"公益助学计划,并成立"同流?孩子"公益助学联盟,将项目的平台化建设推向新高度。二是将公益事业与公司党建结合,催生出新活力和亮点,公司党委下属的八个党支部分别与各地"添富小学"建立结对关系,党员们通过实地探访,了解学校实际困难和发展需求,积极寻求社会公益资源给予帮助。三是持续开展"同流?孩子"相关品牌活动,延续爱心传递温暖。持续开展"同流?孩子"公益助学计划,组织100名添富小学乡村一线教师分赴上海苏州参加专业教师培训;继续组织西部助学公益活动,邀请公司员工、客户和合作伙伴前往贵州参加"添富小学"参加公益服务;继续举办海外留学思者支教,帮助山区孩子打开的视野。其余员工公益活动持续精彩纷呈,向公司员工发售尊款台历、参加护士知名的群众性公益活动——一个鸡蛋的暖走寒款4万多元,作为"添富小学"多媒体教室建设费用等。

2018年,资产管理行业面临重大行业变革期:最业竞争格局下严格执法从严监管;资管业务回归本源,短期业务去去快速扩张的土壤;互联网与金融的融合与规模将面临现有行业发展格局;港股通、沪伦通的发展,带动了A股国际化也进一步带来新的机遇与挑战。汇添富基金将始终坚信长期的力量,开拓进取、奋勇前行,为资产管理行业的发展贡献力量,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		
管刚	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、汇添富盈安保本混合基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈稳保本混合基金、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、汇添富年年益定开混合基金、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6月红定期开放债券基金、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富年年益定开混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富安鑫智选混合基金的基金经理,固定收益投资部总监。	2012年9月18日	-	16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11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天基金的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理,2012年10月18日至2016年3月17日任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至2016年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2013年5月29日至今任汇添富可转换债券A基金的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富实业债基金的基金经理,2013年9月12至2016年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理,2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理,2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理,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日至今任汇添富稳健保本混合基金的基金经理,2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2017年5月15日至今任添富年年益定开混合的基金经理。
郑慧莲	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券、汇添富多元收益债券、添富年年益定开混合的基金经理助理。	2017年12月26日	-	7年	国籍:中国。学历:复旦大学会计学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。中国注册会计师。从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业研究员、高级研究员。2017年5月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定开混合基金和汇添富6月红定开债基金的基金经理助理,2017年5月18日至2017年12月26日任汇添富年年益定开混合基金的基金经理助理。2017年12月12日至今任汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券的基金经理,2017年12月26日至今担任汇添富多元收益债券、添富年年益定开混合的基金经理。
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添惠通货币基金、添利通货币基金、实业债债券基金、选远回报混合基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添惠鑫定定开债券基金的基金经理,汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2014年4月8日	-	11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(原理财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、添惠通货币基金、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,2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理,2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理,2017年6月23日至今任添富鑫汇定开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聘任日期和解聘日期;

2.非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别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颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.本基金的基金经理助理需义务女士于2017年8月21日起履行职责,无法正常履行职务,依据法律法规及公司制度规定,本公司研究决定,将文玲女士休假期间,管刚先生继续负责本基金的投资管理工作。本基金管理人已于2017年8月18日就上述事项进行公告。

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,始终秉承"诚信为基、责任为本"的理念,严格遵守《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 公平交易制度和执行方法

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,公司内部研究成果对所有基金经理和投资决策委员会成员公开,通过投研团队例会,投资研究聚焦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获取投研成果。(2)在投资决策环节,公司对证券池、投资决策委员会、基金经理权限、投资组合指令下达等投资决策流程进行了全面规范,确保投资决策程序合规、有序、有效。(3)在交易执行环节,公司建立了统一的交易室集中交易管理平台,实现交易指令的集中下达、执行、监控、反馈的闭环管理,并通过系统设置对投资组合指令实施风控控制,以保证各投资组合交易决策的独立性和独立性。(4)在交易环节,公司对交易对手的选择、管理、评估等环节实施了严格的管理,并通过系统设置对交易对手的交易额度、交易方式等进行控制,以保证各投资组合交易决策的独立性。(5)在交易环节,公司建立了交易公平性分析系统,根据交易日内证券价格走势、交易量、交易方式等因素,对投资组合的交易行为进行模拟、模拟的结果作为交易员交易参考。投资交易系统设置交易方式、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,严格控制场外交易比例。(6)在交易执行环节,公司建立了交易异常监控系统,对交易过程中的价格、数量进行分配,确保交易的公平性。(7)在交易结果环节,公司通过日常监控分析、投资交易控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对违规行为进行纠正、处罚。(8)在投资决策环节,公司建立了投资决策委员会制度,投资交易系统设置投资决策委员会成员可以共同决策、投资决策、交易价格、交易数量、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负责完成。投资交易系统设置交易方式、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负责完成。严格控制场外交易比例。(9)在投资决策环节,公司建立了投资决策委员会制度,投资决策委员会成员均为公司内部人员,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。基金经理作为公司投资委员会的成员,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幅度,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。

4.3.2 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基金资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数为准。基金合同生效不满三个月,收益可不分配。

本基金A级分别于2017年9月4日和2017年12月26日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.06元和0.10元人民币;C级本报告期未进行利润分配。

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地复核,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、陈军于2018年3月27日签字出具了安永华明(2018)审字第60466941_B26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:2017年12月31日

单位:人民币元

资 产:	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产:		
银行存款	1,196,925.23	6,233,595.99
结算备付金	2,041,962.73	8,859,218.67
存出保证金	88,690.23	192,986.76
交易性金融资产	489,233,141.43	1,479,434,474.12
其中:股票投资	86,459,336.13	135,468,615.24
基金投资	-	-
债券投资	399,211,805.30	1,324,091,858.88
资产支持证券投资	3,562,000.00	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
应收利息	7,090,619.67	18,402,197.48
应收股利	-	-
应收申购款	104,583.11	264,698.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	499,755,922.40	1,515,819,811.42
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 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	45,900,000.00	143,500,000.00
应付证券清算款	678,484.80	4,539,861.40
应付赎回款	27,512.51	217,824.81
应付管理人报酬	269,938.07	1,106,458.98
应付托管费	77,125.17	316,131.13
应付销售服务费	9,350.49	76,797.45
应付交易费用	44,686.99	489,773.40
应交税费	-	-
应付利息	-19,621.20	6,109.39
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	380,016.25	400,136.97
负债合计	47,367,493.08	150,653,093.53
所有者权益:		
实收基金	383,681,827.05	1,192,414,883.66
未分配利润	68,706,602.27	172,751,834.23
所有者权益合计	452,388,429.32	1,365,166,717.89
负债和所有者权益总计	499,755,922.40	1,515,819,811.42

注:1.报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.179元,基金份额总额383,681,827.05份,其中下属A类基金份额资本净值1.180元,份额总额360,919,939.59份;下属C类基金份额资本净值1.169元,份额总额22,761,887.46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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入	18,949,224.05	42,880,378.65
1.利息收入	30,008,371.72	69,575,433.54
其中:存款利息收入	187,904.80	523,390.59
债券利息收入	29,043,636.26	68,970,034.10
资产支持证券利息收入	765,110.07	66,969.86
买入返售金融资产收入	11,720.59	15,038.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-36,649,896.41	25,045,125.54
其中:股票投资收益	-8,892,386.12	17,965,916.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-29,568,084.80	6,107,625.84
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	1,810,574.51	981,583.64
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	25,442,320.42	-62,169,913.76
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	148,428.32	429,733.33
减:二、费用	12,562,135.11	26,076,228.17
1、管理人报酬	4,980,306.94	12,834,350.63
2、托管费	1,422,944.64	3,666,957.32
3、销售服务费	309,751.43	1,325,580.97
4、交易费用	1,486,702.22	3,106,671.21
5、利息支出	3,920,153.39	4,655,140.98
其中:卖出回购金融资产支出	3,920,153.39	4,655,140.98
6、其他费用	442,277.49	487,627.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,387,088.94	16,804,150.48

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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	1,192,414,883.66	172,751,834.23	1,365,166,717.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	6,387,088.94	6,387,088.94
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)	-808,733,056.61	-104,794,715.64	-913,527,772.25
其中:1.基金申购款	97,150,306.98	14,802,115.00	111,952,421.98
2.基金赎回款	-905,883,363.59	-119,596,830.64	-1,025,480,194.23
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)	-	-5,637,605.26	-5,637,605.26
五、期末所有者权益(基金净值)	383,681,827.05	68,706,602.27	452,388,429.32

项目	上年度可比期间 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数(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数(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

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

张辉 李晓 雷青松

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

汇添富多元收益债券型证券投资基金(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[2012]428号文《关于核准汇添富多元收益债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理有限公司(现汇添富基金管理股份有限公司)向社会公开募集。基金合同于2012年09月18日正式生效,首次设立募集规模为1,980,207,696.22份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、可转换债、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款及协议存款)以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金可投资于一般市场板块申购、持有可转换转股所得股票以及因转股、因所持股票派发的权证以及因配股、因所持股票派发的零股所产生的股票,也可直接从二级市场上买入股票和权证。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数*90%+沪深300指数*10%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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(以下统称"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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金信息披露的指导意见》(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2017年12月31日的财务状况以及2017年度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、会计估计和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、会计估计和最近一期年度报告相一致

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告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,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳的印花税,受让方不再按收,税率不变。

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 增值税

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征增值税试点的通知》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]140号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的票据贴现、买断式买入返售金融商品业务及持有政策性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]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,资管产品管理人按管理费收入扣除支付给境内其他资管产品管理人的管理费后的余额为增值税销售额;

根据财政部、国家税务