

汇添富安心中国债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：2017 年 1 月 19 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|-------------|
| 基金简称 | 汇添富安心中国债券 | |
| 交易代码 | 000395 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013 年 11 月 22 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 173,886,355.36 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过重点投资于高信用等级债券，力争实现资产的稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的 80%，其中投资于高等级信用债券的投资比例不低于基金资产净值的 70%；持有的现金或到期日在一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 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富安心中国债券 A | 汇添富安心中国债券 C |

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 000395 | 000396 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 162,260,955.82 份 | 11,625,399.54 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2016年10月1日—2016年12月31日） | |
|-----------------|-----------------------------|---------------|
| | 汇添富安心中国债券 A | 汇添富安心中国债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 1,502,770.07 | 116,920.11 |
| 2. 本期利润 | -3,120,345.07 | -262,199.16 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0191 | -0.0193 |
| 4. 期末基金资产净值 | 185,717,607.14 | 13,250,102.79 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.145 | 1.140 |

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

3.2.1 本报告期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

汇添富安心中国债券 A

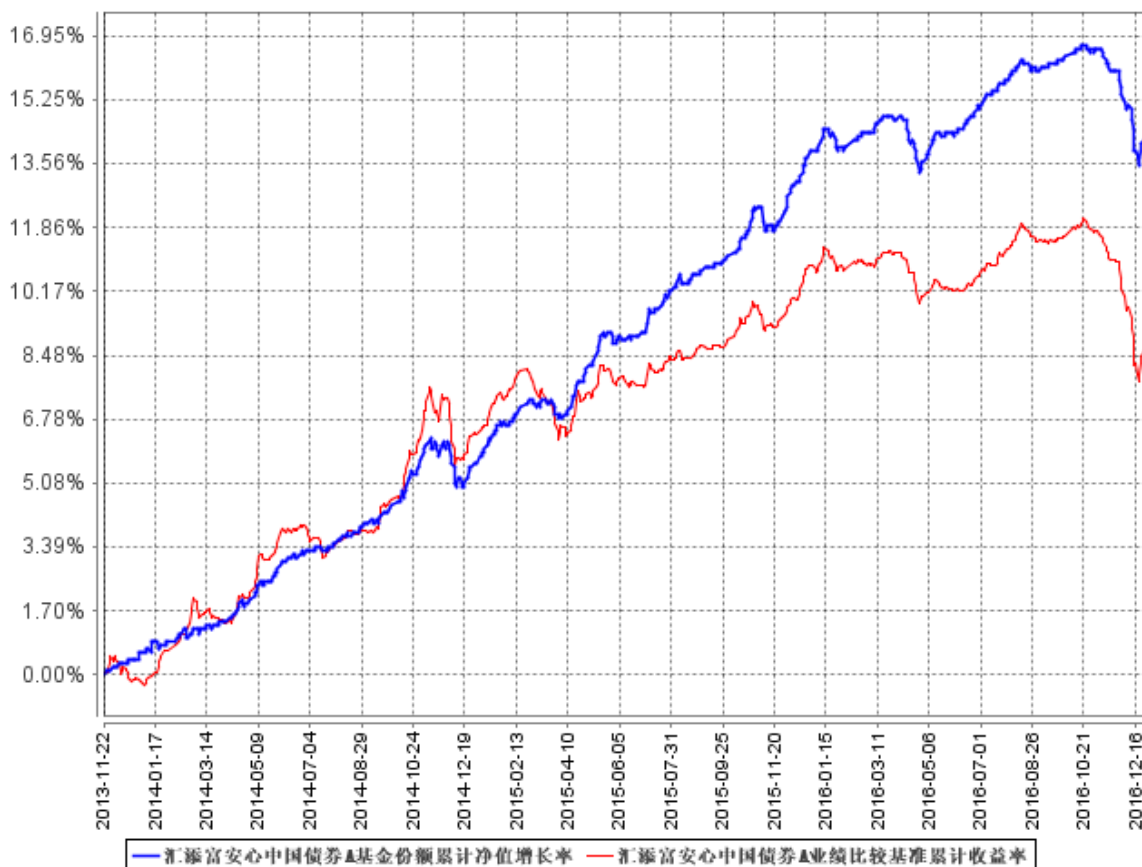
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -1.63% | 0.11% | -2.32% | 0.15% | 0.69% | -0.04% |

汇添富安心中国债券 C

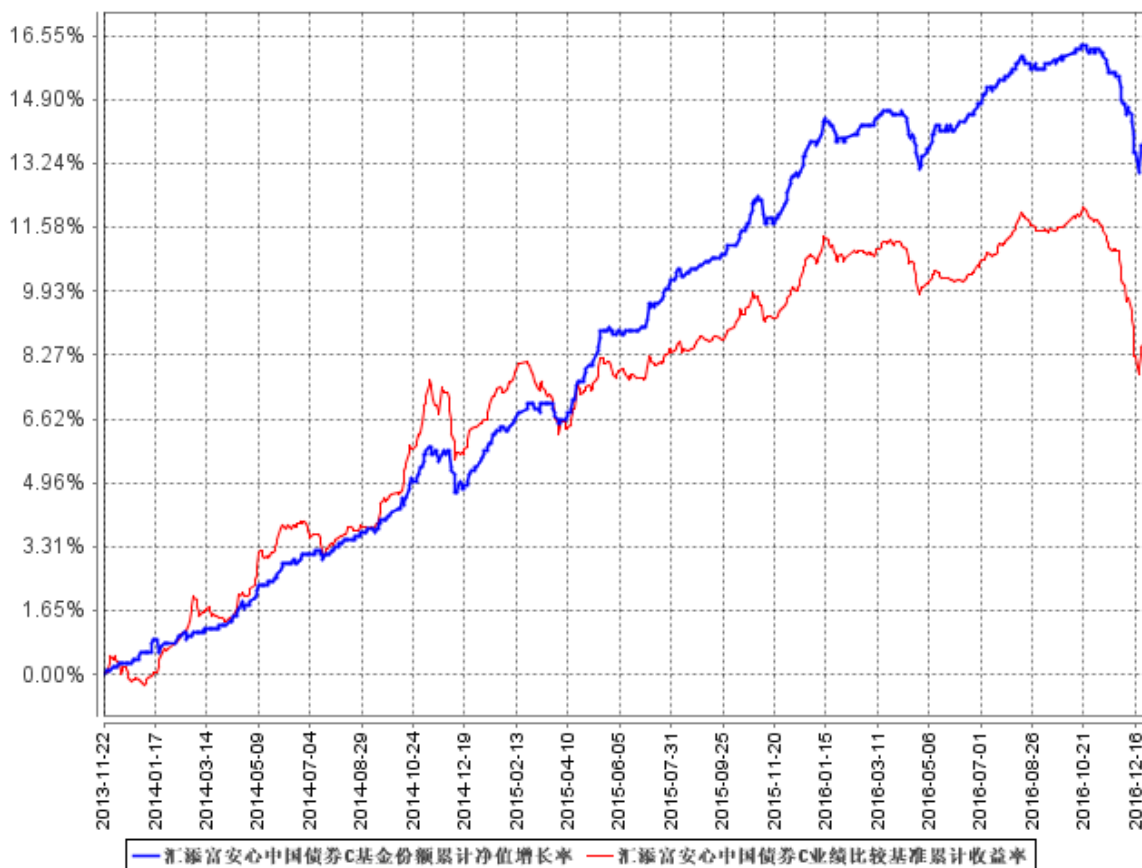
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -1.72% | 0.12% | -2.32% | 0.15% | 0.60% | -0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

汇添富安心中国债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富安心中国债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 22 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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 | 说明 |
|----|--------------------------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 何旻 | 汇添富安心中国债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫保本混合 | 2013年11月22日 | - | 18年 | 国籍：中国。学历：英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格：基金从业资格、特许金融分析师（CFA），财务风险经理（FRM）。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理，固定收益部负责人；金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年 |

| | | | | |
|--|-----------------|--|--|--|
| | <p>基金的基金经理。</p> | | | <p>10 月 28 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金龙债券基金的基金经理，2005 年 10 月 27 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金象保本基金的基金经理，2006 年 4 月 28 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007 年 8 月 15 日至 2010 年 12 月 29 日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理，2008 年 9 月 3 日至 2009 年 3 月 10 日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理，2009 年 3 月 29 日至 2010 年 12 月 29 日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011 年 1 月加入汇添富资产管理（香港）有限公司，2012 年 2 月 17 日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2013 年 11 月 22 日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理，2014 年 1 月 21 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金（原汇添富信用债债券基金）的基金经理，2016 年 3 月 11 日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理。</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合规守信情况的说明

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 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，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》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 8 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年第四季度，在国庆节之后，债券市场收益率依然不断下行，特别是信用债和国债之间的信用利差被压缩到历史低位，投资机构不断增加组合的杠杆以获取更高的投资回报。10 月下旬，随着银行理财产品将纳入广义信贷接受 MPA 考核的传言出现，脆弱的债券市场开始发生调整。直到 11 月底，在资金面收紧以及各种利空因素（比如物价指数上升、货币政策转紧、美联储开始加息等）不断打压下，债市开始快速地调整，各品种债券收益率上升 50-100 个基点不等。在 12 月 20 日前后，央行通过公开市场操作对各大商业银行和市场投资机构投放资金，债券市场下跌势头得以缓和。10-12 月，沪深 300 指数上涨幅度为 1.75%。股票市场在整个第四季度，基

本是 10、11 月上涨、12 月下跌的格局。同期中债综合指数下跌 1.49%，其中仅 10 月上涨，11、12 月开始下跌。

本基金在第四季度，10 月调减了中期票据的比例，调高组合的静态收益率；11、12 月主要是努力缩短组合久期，在市场下跌过程中尽力避免净值回调。在市场下跌初期，高等级信用债由于流动性较好而下跌幅度更大，本基金净值出现较大幅度回调。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 级净值增长率为-1.63%，C 级净值增长率为-1.72%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

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 | 188,941,300.00 | 94.70 |
| | 其中：债券 | 188,941,300.00 | 94.70 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 679,870.07 | 0.34 |
| 8 | 其他资产 | 9,888,142.21 | 4.96 |
| 9 | 合计 | 199,509,312.28 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 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。

5.4 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 | 300,000.00 | 0.15 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 29,989,000.00 | 15.07 |
| | 其中：政策性金融债 | 29,989,000.00 | 15.07 |
| 4 | 企业债券 | 37,042,300.00 | 18.62 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 121,610,000.00 | 61.12 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 188,941,300.00 | 94.96 |

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 | 101456009 | 14 北车 MTN002 | 100,000 | 10,471,000.00 | 5.26 |
| 2 | 101459034 | 14 中航集 MTN001 | 100,000 | 10,376,000.00 | 5.21 |
| 3 | 140303 | 14 进出 03 | 100,000 | 10,372,000.00 | 5.21 |
| 4 | 101456060 | 14 国开投 MTN002 | 100,000 | 10,352,000.00 | 5.20 |
| 5 | 101464018 | 14 湘高速 MTN001 | 100,000 | 10,266,000.00 | 5.16 |

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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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 | 942.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,001,798.33 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,885,401.11 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,888,142.21 |

5.10.4 报告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 报告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

单位：份

| 项目 | 汇添富安心中国债券 A | 汇添富安心中国债券 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 164,976,621.63 | 15,388,504.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 280,364.69 | 943,119.46 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,996,030.50 | 4,706,223.93 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 162,260,955.82 | 11,625,399.54 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富安心中国债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富安心中国债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富安心中国债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富安心中国债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

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

8.3 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 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
2017 年 1 月 19 日