

广发金管家多添利集合资产管理计划

2016 年第四季度资产管理报告

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：广发银行股份有限公司

日期：2017 年 1 月



目录

重要提示.....	1
一、 集合计划简介.....	1
(一) 基本资料.....	1
(二) 管理人简介.....	1
(三) 托管人简介.....	2
(四) 会计师事务所简介.....	2
二、 主要财务指标和收益分配.....	3
(一) 主要财务指标.....	3
(二) 报告期内收益分配情况.....	3
三、 集合计划管理人报告.....	3
(一) 投资主办人简介.....	3
(二) 报告期内业绩表现.....	3
(三) 投资主办人工作报告.....	4
四、 集合计划会计报表.....	4
(一) 资产负债表.....	4
(二) 份额变动表.....	5
五、 集合计划投资组合报告.....	5
(一) 资产组合情况.....	5
(二) 报告期关联交易投资情况.....	6
六、 重要事项提示.....	6
七、 备查文件目录.....	6
(一) 本集合计划备查文件目录.....	6
(二) 存放地点及查阅方式.....	7

重要提示

本报告依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

托管人根据本集合计划合同规定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表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。

本报告未经审计。

本报告内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2016年10月1日—2016年12月31日

一、 集合计划简介

（一） 基本资料

名称：广发金管家多添利集合资产管理计划

成立规模（总份额）：1,130,442.23份

存续期间：无固定期限

报告期末计划总份额：1,216,829,577.58份

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：广发银行股份有限公司

（二） 管理人简介

名称：广发证券资产管理（广东）有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-285

办公地址：广东省广州市天河北路183-187号大都会广场36楼



法定代表人：张威

电话：（020）87555888

传真：（020）87553569

全国统一客服热线：95575

网址：www.gf.com.cn

（三） 托管人简介

名称：广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

办公住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

电话：（020）87310779

传真：（020）87310779

全国统一客服热线：95508

网址：www.cgbchina.com.cn

（四） 会计师事务所简介

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

法人代表：卢伯卿

电话：（020）83969228

传真：（020）38880119

经办会计师：王明静 洪锐明

二、 主要财务指标和收益分配

(一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	2016年10月1日—2016年12月31日
1	集合计划本期已实现收益(元)	1,280,729,174.03
2	本期利润(元)	1,280,729,174.03
3	期末集合计划资产净值(元)	121,682,957,758.00

(二) 报告期内收益分配情况

本报告期累积分配利润 943,422,820.00 元

三、 集合计划管理人报告

(一) 投资主办人简介

袁克非先生，曾任广发银行固定收益业务主管，从事专业债券投资业务超过 10 年，具备全面的货币市场、债券一、二级市场投资交易经验。经历过债券市场三轮以上完整的牛熊周期，擅长控制风险，把握市场转折。曾连续荣获 2003 年及 2004 年全国银行间市场优秀交易员称号及 2015 年“英华奖”三年期最佳固定收益投资主办称号。现担任广发金管家弘利债券集合资产管理计划、广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划、广发银享利 1 号集合资产管理计划、广发多添富等系列投资主办。

陈晓荣女士，硕士，曾就职于广发银行金融市场部，主管广发银行本币货币市场团队，主要投资范围为货币市场工具，熟悉同业存款、票据、债券一二级交易等资产运作，善于捕捉市场转向及跨市场交易机会，应对过 08-09 年罕见的流动性泛滥以及 2011 年罕见的流动性危机。因业绩表现突出，连续多年被评定为银行间市场优秀交易员。2012 年 6 月入职广发证券资产管理部。现任广发金管家多添利集合资产管理计划投资主办人。

(二) 报告期内业绩表现

2016 年四季度末各期限报价：7 天品种(879002)业绩比较标准：4.20%；14 天品种(879003)

业绩比较标准：4.20%；28天品种（879004）业绩比较标准：4.20%；56天品种（879005）业绩比较标准：3.70%；91天品种（879006）业绩比较标准：3.70%；182天品种（879007）业绩比较标准：3.90%；364天品种（879008）业绩比较标准：4.40%。

（三） 投资主办人工作报告

从2016年10月底开始，由于监管政策趋严、经济企稳和通胀预期提升，国内债券市场出现了较大幅度的连续调整，在两个月的时间里10年期国债最高上行约70bp左右。货币市场方面，年底资金面持续紧张，货币基金出现大额赎回，市场流动性面临严峻挑战，银行间7天回购加权利率也从2.5%上升到4.0%左右。四季度本产品在规模上保持稳定，经受住了流动性考验；在投资方面坚持以流动性为主，投资活期类存款资产始终在合理比例，保持了产品合理的流动性备付；同时为了兼顾收益性，适时择优配置可提前支取的定期存款，并择时配置收益率较高的短久期信用债。

展望2017年，一方面由于人民币贬值压力持续，货币政策难言放松，通胀预期犹在，债券收益率仍面临调整的压力，另一方面，经济复苏前景不明，货币政策强调防风险底线，在经过一定幅度调整后债券资产配置价值也将逐步显现，债券市场面临机遇与风险并存。2017年一季度，我们将继续保持稳健运作的策略，在保持流动性并严控信用风险的基础上，提高产品收益，以良好的业绩回馈广大投资者。

四、 集合计划会计报表

（一） 资产负债表

单位：元

资产	2016/12/31	2016/9/30	负债与所有者权益	2016/12/31	2016/9/30
资产：			负债：		
银行存款	28,901,744,620.83	21,281,422,531.66	短期借款	-	-
结算备付金	1,277,343,301.93	1,226,549,935.76	交易性金融负债	-	-
存出保证金	12,292,177.26	20,971,844.36	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	122,302,849,112.73	126,053,717,471.65	卖出回购金融资产款	33,121,912,419.16	16,721,585,307.10
其中：股票投资	9,999,994.23	9,999,994.23	应付证券清算款	-	11,252,454,197.90
债券投资	108,475,561,872.08	93,963,517,320.36	应付赎回款	-	-
基金投资	12,381,204,546.42	30,805,517,152.06	应付管理人报酬	32,648,927.84	85,755,539.93

资产支持证券投资	1,436,082,700.00	1,274,683,005.00	应付风险准备金	113,066,639.07	287,075,295.40
专项资产管理计划	-	-	应付托管费	5,441,487.98	14,292,589.98
银行理财产品	-	-	应付销售服务费	-	-
信托投资	-	-	应付咨询服务费	-	-
私募基金投资	-	-	应付交易费用	1,549,886.17	2,694,000.60
衍生金融资产	-	-	应交税费	-	-
权证投资	-	-	应付利息	9,124,655.43	4,071,334.24
买入返售金融资产	2,399,963,918.41	1,654,972,517.50	应付利润	1,782,390,894.35	1,445,084,540.32
应收证券清算款	182,065,232.68	-	其他负债	18,000.00	13,475.32
应收利息	1,670,295,508.06	1,611,880,603.21	负债合计	35,066,152,910.00	29,813,026,280.79
应收股利	2,556,796.10	17,452,508.65	所有者权益:		
应收申购款	-	-	实收基金	121,682,957,758.00	122,053,941,132.00
其他资产	-	-	未分配利润	-	-
	-	-	所有者权益合计	121,682,957,758.00	122,053,941,132.00
资产总计	156,749,110,668.00	151,866,967,412.79	负债和所有者权益总计	156,749,110,668.00	151,866,967,412.79

(二) 份额变动表

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
1,220,539,411.32	519,437,177.89	523,147,011.63	1,216,829,577.58

五、 集合计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

项目	期末市值(元)	占总资产比例
银行存款和结算备付金	30,179,087,922.76	19.25%
股票	9,999,994.23	0.01%
债券	108,475,561,872.08	69.20%
基金	12,381,204,546.42	7.90%
资产支持证券	1,436,082,700.00	0.92%
专项资产管理计划	-	-
银行理财产品	-	-
信托投资	-	-
私募基金投资	-	-
应收证券清算款	182,065,232.68	0.12%
应收申购款	-	-
买入返售金融资产	2,399,963,918.41	1.53%

其他资产	1,685,144,481.42	1.08%
合计	156,749,110,668.00	100.00%

注：“其他资产”包括“存出保证金”、“应收红利”、“应收利息”等项目。

（二） 报告期关联交易投资情况

本集合计划于2016年11月23日认购管理人全资控股股东—广发证券股份有限公司联合承销的梅州市康达公路建设有限公司2016年非公开发行公司债券（第二期）10000万元，详见《广发金管家多添利集合资产管理计划认购关联公司承销债券的公告》。

六、 重要事项提示

- （一） 本报告期内本集合计划管理人及托管人未发生任何涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。
- （二） 本报告期内本集合计划聘请的会计师事务所未发生变更。
- （三） 本报告期内集合计划的投资组合策略、投资决策程序未发生改变。
- （四） 本报告期内集合计划的投资主办人未发生变更。
- （五） 本报告期内本集合计划的管理人、托管人托管业务机构及其高级管理人员未受到监管部门任何处罚。

七、 备查文件目录

（一） 本集合计划备查文件目录

1. 《广发金管家多添利集合资产管理计划说明书》
2. 《广发金管家多添利集合资产管理计划资产管理合同》
3. 《广发金管家多添利集合资产管理计划资产托管协议》
4. 《广发金管家多添利集合资产管理计划风险揭示书》
5. 管理人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点及查阅方式

文件存放地点：广发证券资产管理（广东）有限公司

地址：广州市天河北路183号大都会广场36楼

网址：www.gf.com.cn

电话：（020）87555888

传真：（020）87553569

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人广发证券资产管理（广东）有限公司。

广发证券资产管理（广东）有限公司

2017年1月