

# 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人上海浦东发展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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15        |
| 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.....             | 17        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 18        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 19        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 19        |
| 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.....       | 19        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>20</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 20        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 20        |
| 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.....      | 20        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>21</b> |
| 6.1 审计报告的基本内容.....                           | 21        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>23</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 23        |
| 7.2 利润表.....                                 | 24        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 26        |
| 7.4 报表附注.....                                | 27        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>54</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 54        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 54        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 54        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 55        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 55        |
| 8.6 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.....      | 55        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 56        |
| 8.8 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贵金属投资明细.....   | 56        |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.9 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..... | 56        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....         | 56        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....         | 56        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                     | 57        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                | <b>59</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 59        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 59        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....  | 59        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>              | <b>60</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>61</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 61        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 61        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 63        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                    | 63        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 63        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 63        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 64        |
| 11.8 其他重大事件 .....                       | 65        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                  | <b>67</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 67        |
| 12.2 存放地点.....                          | 67        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 67        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金   |
| 基金简称       | 汇添富保鑫保本混合          |
| 基金主代码      | 003189             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2016 年 9 月 29 日    |
| 基金管理人      | 汇添富基金管理股份有限公司      |
| 基金托管人      | 上海浦东发展银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 1,140,603,548.14 份 |

### 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。安全资产主要包括国债、央行票据、银行存款等品种。风险资产主要包括股票、权证、股指期货等品种。 |
| 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             | 上海浦东发展银行股份有限公司     |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李鹏                        | 朱萍                 |
|         | 联系电话 | 021-28932888              | 021-61618888       |
|         | 电子邮箱 | service@99fund.com        | Zhup02@spdb.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-888-9918              | 95528              |
| 传真      |      | 021-28932998              | 021-63602540       |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室 | 上海市中山东一路 12 号      |
| 办公地址    |      | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层    | 上海市中山东一路 12 号      |
| 邮政编码    |      | 200120                    | 200120             |
| 法定代表人   |      | 李文                        | 吉晓辉                |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                                      |
|---------------------|--------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》               |
| 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 |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                             |
|--------|--------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层 |

|        |               |                                |
|--------|---------------|--------------------------------|
| 注册登记机构 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼<br>21 层      |
| 基金保证人  | 深圳市高新投集团有限公司  | 深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层 |

### § 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 9 月 29 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |
| 本期已实现收益       | 1,338,555.74                              |
| 本期利润          | -19,030,356.78                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0165                                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.66%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -1.70%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | -18,939,931.55                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0166                                   |
| 期末基金资产净值      | 1,121,663,616.59                          |
| 期末基金份额净值      | 0.983                                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2016 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | -1.70%                                    |

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2016 年 9 月 29 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2016 年 12 月 31 日数据，特此说明。

#### 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

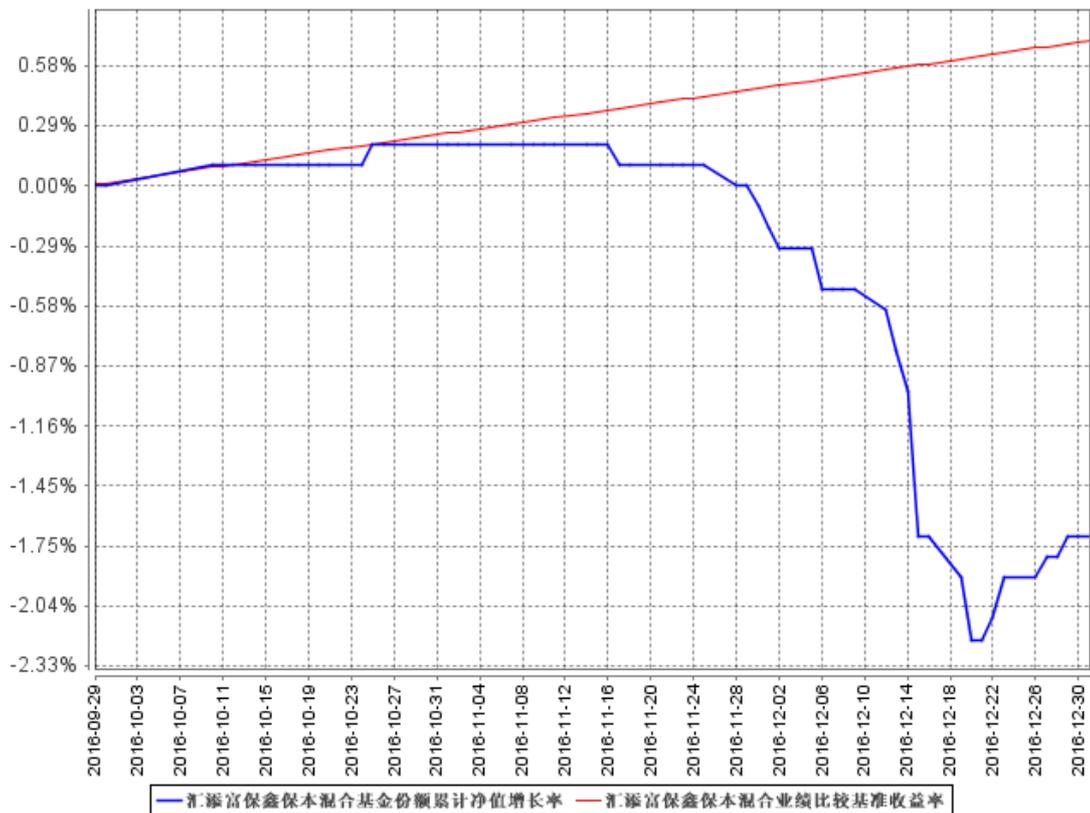
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|    |          |             |            |               |     |     |

|                     |        |       |       |       |        |       |
|---------------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月               | -1.70% | 0.12% | 0.69% | 0.01% | -2.39% | 0.11% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | -1.70% | 0.12% | 0.71% | 0.01% | -2.41% | 0.11% |

注：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）

### 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

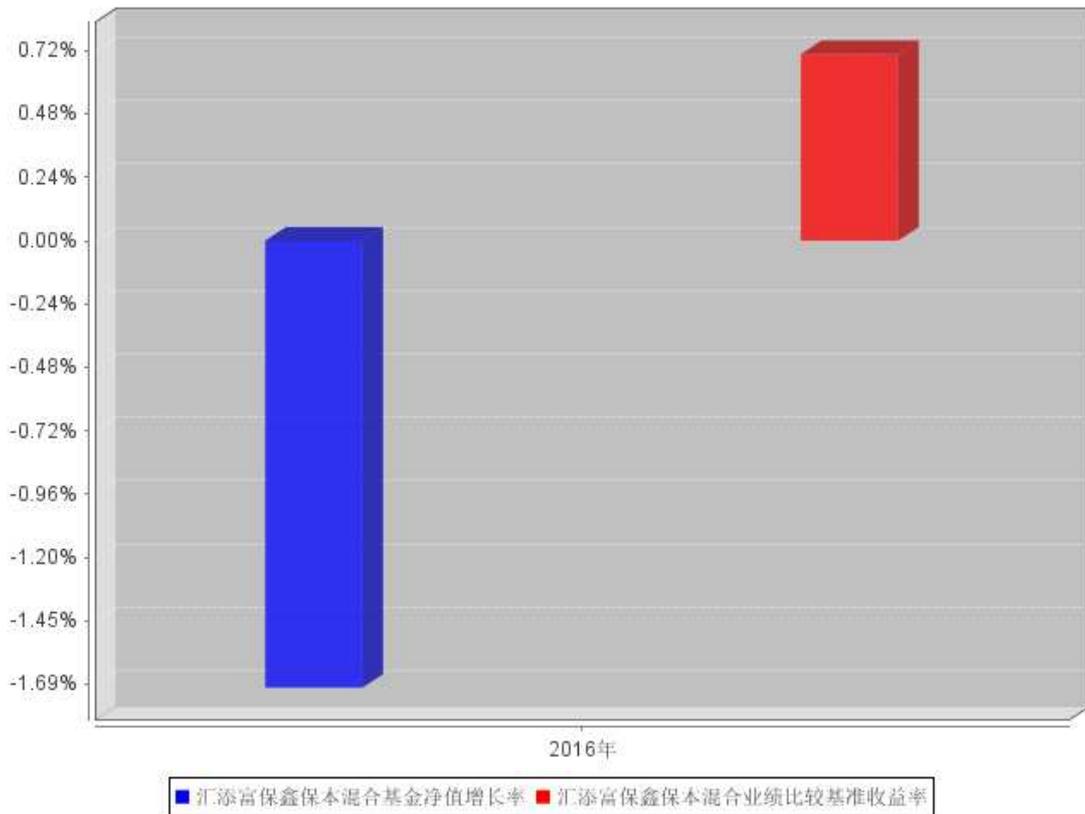
汇添富保鑫保本混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年9月29日）起6个月，截止至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

### 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

汇添富保鑫保本混合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对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2016 年 9 月 29 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，不按整个自然年度进行计算。

### 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，做中长期投资布局，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、汇添富全额宝获得“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，公司成功竞获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、现金宝的全新客服体系，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資顾问。

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”员工与贫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“河流·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泾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 | 2016 年 9 月      | -    | 15 年   | 国籍：中国。学历：中 |

|  |  |             |  |   |
|--|--|-------------|--|---|
|  | <p>元收益、可转换债券、实业债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、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的基金经</p> | <p>29 日</p> |  | <p>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</p> |
|--|--|-------------|--|---|

|  |                               |  |  |   |
|--|-------------------------------|--|--|---|
|  | <p>理，固定<br/>收益投资<br/>副总监。</p> |  |  | <p>转换债券的基金经理，<br/>2013 年 5 月 29 日至 2015<br/>年 3 月 31 日任汇添富理<br/>财 7 天的基金经理，2013<br/>年 6 月 14 日至今任汇添<br/>富实业债的基金经理，<br/>2013 年 9 月 12 至 2015<br/>年 3 月 31 日任汇添富现<br/>金宝货币的基金经理，<br/>2013 年 12 月 3 日至今任<br/>汇添富双利增强债券的<br/>基金经理，2015 年 11 月<br/>26 日至今任汇添富安鑫<br/>智选混合的基金经理，<br/>2016 年 2 月 17 日至今任<br/>汇添富 6 月红定期开放<br/>债券的基金经理，2016<br/>年 3 月 16 日至今任汇添<br/>富稳健添利定期开放债<br/>券的基金经理，2016 年<br/>4 月 19 日至今任汇添富<br/>盈安保本混合的基金经<br/>理，2016 年 8 月 3 日至<br/>今任汇添富盈稳保本混<br/>合的基金经理，2016 年<br/>9 月 29 日至今任汇添富<br/>保鑫保本混合的基金经<br/>理，2016 年 12 月 6 日至<br/>今任汇添富长添利定期<br/>开放债券的基金经理。</p> |
|--|-------------------------------|--|--|---|

|     |  |                 |   |     |  |
|-----|--|-----------------|---|-----|--|
| 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 9 月 29 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 日至今任汇添富保鑫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 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、投资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额赎回，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，低价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%。

建仓期内债券收益率低位运行，本组合采用相对保守的建仓策略，组合配置以存款和短融为主，12 月份债市调整过程中，本组合增持了 3 年以内高等级信用债。由于债券收益率调整幅度过大，组合净值跌破了面值。考虑到组合安全垫偏薄，报告期内低配股票和可转债。

##### 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-1.7%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

#### 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。

考虑到保本基金的组合特性，本组合主要配置同本期匹配的固定收益类资产，优先选择中高级别的债券，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 and 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积极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验，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，可以提议测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

注：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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富保鑫保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富保鑫保本混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、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）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告   |
|--------------|--|
| 审计报告收件人      | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人：   |
| 引言段          | <p>我们审计了后附的汇添富保鑫保本混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p>  |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p>  |
| 注册会计师的责任段    | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |

|                  |   |            |
|------------------|---|------------|
|                  |   |            |
| <p>审计意见段</p>     | <p>我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富保鑫保本混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 29 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。</p> |            |
| <p>注册会计师的姓名</p>  | <p>陈 露</p>  | <p>陈 军</p> |
| <p>会计师事务所的名称</p> | <p>安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)</p>   |            |
| <p>会计师事务所的地址</p> | <p>中国 北京</p>  |            |
| <p>审计报告日期</p>    | <p>2017 年 3 月 28 日</p>  |            |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富保鑫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              | 附注号        | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 50,533,859.58                   |
| 结算备付金           |            | 8,923,510.57                    |
| 存出保证金           |            | 24,803.30                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 1,219,300,891.25                |
| 其中：股票投资         |            | -                               |
| 基金投资            |            | -                               |
| 债券投资            |            | 1,219,300,891.25                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               |
| 贵金属投资           |            | -                               |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 4,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                               |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 13,403,402.89                   |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | 7,995.20                        |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 1,296,194,462.79                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |

|               |          |                  |
|---------------|----------|------------------|
| <b>负 债：</b>   |          |                  |
| 短期借款          |          | -                |
| 交易性金融负债       |          | -                |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3  | -                |
| 卖出回购金融资产款     |          | 154,000,000.00   |
| 应付证券清算款       |          | 19,136,148.09    |
| 应付赎回款         |          | 231,201.60       |
| 应付管理人报酬       |          | 766,320.00       |
| 应付托管费         |          | 95,790.00        |
| 应付销售服务费       |          | -                |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 5,124.40         |
| 应交税费          |          | -                |
| 应付利息          |          | 26,262.11        |
| 应付利润          |          | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 270,000.00       |
| 负债合计          |          | 174,530,846.20   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 1,140,603,548.14 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -18,939,931.55   |
| 所有者权益合计       |          | 1,121,663,616.59 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,296,194,462.79 |

注：(1)报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.983 元，基金份额总额 1,140,603,548.14 份。

(2) 本基金合同于 2016 年 9 月 29 日生效。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富保鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期   |
|------------------------|------------|--|
|                        |            | 2016 年 9 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日 |
| 一、收入                   |            | -15,488,937.39                               |
| 1. 利息收入                |            | 9,143,653.41                                 |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 4,050,610.25                                 |
| 债券利息收入                 |            | 4,840,021.63                                 |
| 资产支持证券利息收入             |            | -  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 253,021.53                                   |
| 其他利息收入                 |            | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -4,657,928.09                                |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -  |
| 基金投资收益                 |            | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -4,657,928.09                                |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.14   | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.15   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.16   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.17   | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -20,368,912.52                               |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19   | 394,249.81                                   |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 3,541,419.39                                 |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 2,338,355.29                                 |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 292,294.36                                   |
| 3. 销售服务费               |            | -  |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.20   | 6,112.74                                     |
| 5. 利息支出                |            | 624,743.16                                   |

|                            |          |                       |
|----------------------------|----------|-----------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 624,743.16            |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.21 | 279,913.84            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-19,030,356.78</b> |

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富保鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 29 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<br>2016 年 9 月 29 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）                        | 1,160,091,316.65                                 | -              | 1,160,091,316.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -19,030,356.78 | -19,030,356.78   |
| 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）      | -19,487,768.51                                   | 90,425.23      | -19,397,343.28   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 315,883.34                                       | -734.75        | 315,148.59       |
| 2. 基金赎回款                               | -19,803,651.85                                   | 91,159.98      | -19,712,491.87   |
| 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）                        | 1,140,603,548.14                                 | -18,939,931.55 | 1,121,663,616.59 |

财务报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |             |            |
|-----------|-------------|------------|
| <u>张晖</u> | <u>李骁</u>   | <u>韩从慧</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管基金会计工作负责人 | 基金会计机构负责人  |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

#### 7.4.1 基金基本情况

汇添富保鑫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]839 号文《关于准予汇添富保鑫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管理人于 2016 年 8 月 29 日至 2016 年 9 月 26 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\_B16 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 9 月 29 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 1,159,522,113.35 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 569,203.30 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,160,091,316.65 元，折合 1,160,091,316.65 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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。本基金业绩比较基准为：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 9 月 29 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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 9 月 29 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资等；

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合

同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%的年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提；

(3) 本基金在到期操作期间（除保本周期到期日）和过渡期内，基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 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 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增值税试点的通知》的规定，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，金融机构开展的质押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》的规定，自 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末              |
|----------------|------------------|
|                | 2016 年 12 月 31 日 |
| 活期存款           | 50,533,859.58    |
| 定期存款           | -                |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                |
| 其他存款           | -                |
| 合计：            | 50,533,859.58    |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末              |      |        |
|----|------------------|------|--------|
|    | 2016 年 12 月 31 日 |      |        |
|    | 成本               | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | -                | -    | -      |

|               |       |                  |                  |                |
|---------------|-------|------------------|------------------|----------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 787,462,104.78   | 774,123,891.25   | -13,338,213.53 |
|               | 银行间市场 | 452,207,698.99   | 445,177,000.00   | -7,030,698.99  |
|               | 合计    | 1,239,669,803.77 | 1,219,300,891.25 | -20,368,912.52 |
| 资产支持证券        |       | -                | -                | -              |
| 基金            |       | -                | -                | -              |
| 其他            |       | -                | -                | -              |
| 合计            |       | 1,239,669,803.77 | 1,219,300,891.25 | -20,368,912.52 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目     | 本期末          |           |
|--------|--------------|-----------|
|        | 2016年12月31日  |           |
|        | 账面余额         | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 4,000,000.00 | -         |
| 合计     | 4,000,000.00 | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末         |
|----------|-------------|
|          | 2016年12月31日 |
| 应收活期存款利息 | 7,139.30    |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收定期存款利息   | -             |
| 应收其他存款利息   | -             |
| 应收结算备付金利息  | 4,417.16      |
| 应收债券利息     | 13,380,736.13 |
| 应收买入返售证券利息 | 11,097.25     |
| 应收申购款利息    | 0.84          |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -             |
| 其他         | 12.21         |
| 合计         | 13,403,402.89 |

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,124.40           |
| 合计          | 5,124.40           |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付信息披露费     | 190,000.00         |
| 应付审计费       | 80,000.00          |
| 合计          | 270,000.00         |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额(份)                               | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 1,160,091,316.65                      | 1,160,091,316.65 |
| 本期申购          | 315,883.34                            | 315,883.34       |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -19,803,651.85                        | -19,803,651.85   |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -                |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -                |
| 本期申购          | -                                     | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -                |
| 本期末           | 1,140,603,548.14                      | 1,140,603,548.14 |

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于2016年9月29日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币1,159,522,113.35元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币569,203.30元，以上实收基金(本息)合计为人民币1,160,091,316.65元，折合1,160,091,316.65份基金份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日        | -            | -              | -              |
| 本期利润           | 1,338,555.74 | -20,368,912.52 | -19,030,356.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -67,489.19   | 157,914.42     | 90,425.23      |
| 其中：基金申购款       | 910.46       | -1,645.21      | -734.75        |
| 基金赎回款          | -68,399.65   | 159,559.63     | 91,159.98      |
| 本期已分配利润        | -            | -              | -              |

|     |              |                |                |
|-----|--------------|----------------|----------------|
| 本期末 | 1,271,066.55 | -20,210,998.10 | -18,939,931.55 |
|-----|--------------|----------------|----------------|

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 270,454.34                      |
| 定期存款利息收入  | 3,759,583.34                    |
| 其他存款利息收入  | -                               |
| 结算备付金利息收入 | 20,522.08                       |
| 其他        | 50.49                           |
| 合计        | 4,050,610.25                    |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                              |
|-------------------------|---------------------------------|
|                         | 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 147,107,971.09                  |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 149,372,475.61                  |
| 减：应收利息总额                | 2,393,423.57                    |
| 买卖债券差价收入                | -4,657,928.09                   |

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | -20,368,912.52                  |
| ——股票投资     | -                               |
| ——债券投资     | -20,368,912.52                  |
| ——资产支持证券投资 | -                               |
| ——贵金属投资    | -                               |
| ——其他       | -                               |
| 2. 衍生工具    | -                               |
| ——权证投资     | -                               |
| 3. 其他      | -                               |
| 合计         | -20,368,912.52                  |

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 394,249.81                      |
| 合计      | 394,249.81                      |

**7.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期   |
|-----------|--|
|           | 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,662.74                                   |
| 银行间市场交易费用 | 4,450.00                                   |
| 合计        | 6,112.74                                   |

**7.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

| 项目     | 本期   |
|--------|--|
|        | 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| 审计费用   | 80,000.00                                  |
| 信息披露费  | 190,000.00                                 |
| 银行划款费用 | 9,513.84                                   |
| 其他费用   | 400.00                                     |
| 合计     | 279,913.84                                 |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

| 关联方名称               | 与本基金的关系             |
|---------------------|---------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司       | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发” | 基金托管人、基金代销机构        |

|                    |                  |
|--------------------|------------------|
| 银行” )              |                  |
| 东方证券股份有限公司(“东方证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构  |
| 东航金控有限责任公司         | 基金管理人的股东         |
| 上海上报资产管理有限公司       | 基金管理人的股东         |
| 上海菁聚金投资管理合伙企业      | 基金管理人的股东         |
| 汇添富资产管理(香港)有限公司    | 基金管理人的子公司        |
| 汇添富资本管理有限公司        | 基金管理人施加重大影响的联营企业 |
| 上海汇添富公益基金会         | 与基金管理人同一批关键管理人员  |

注：经汇添富基金管理股份有限公司 2016 年第二次股东大会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准，汇添富基金管理股份有限公司的股东文汇新民联合报业集团已变更为上海上报资产管理有限公司。汇添富基金管理股份有限公司已于 2016 年 8 月 13 日就上述股东变更事项进行公告。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |                  |
|----------------|--|------------------|
|                | 成交金额   | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股<br>份有限公司 | 464,412,755.42                                   | 100.00%          |

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |                    |
|----------------|---------------------------------------|--------------------|
|                | 回购成交金额                                | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股<br>份有限公司 | 5,037,200,000.00                      | 100.00%            |

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                  | 本期<br>2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|---------------------|---------------------------------------|
|                     | 当期发生的基金应支付<br>的管理费                    |
| 其中：支付销售机构的客<br>户维护费 | 23,335.86                             |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

在保本周期内，本基金的保证费用或风险买断费用从基金管理人的管理费收入中列支。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期   |  |
|----------------|--|--|
|                | 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |  |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 292,294.36                                 |  |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称    | 本期   |            |
|----------|--|------------|
|          | 2016 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |            |
|          | 期末余额                                       | 当期利息收入     |
| 上海浦东发展银行 | 50,533,859.58                              | 270,454.34 |

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券

登记结算有限责任公司，自 2016 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日期间获得的利息收入为人民币 20,522.08 元，2016 年末结算备付金余额为人民币 8,923,510.57 元。

#### **7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### **7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

##### **7.4.12.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **7.4.12.1.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **7.4.12.1.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事上海证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 154,000,000.00 元，其中人民币 94,000,000.00 元于 2017 年 1 月 3 日到期，人民币 60,000,000.00 元于 2017 年 1 月 25 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架

构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| A-1    | 49,650,000.00           |
| A-1 以下 | -                       |
| 未评级    | 198,967,000.00          |
| 合计     | 248,617,000.00          |

注：未评级债券为超短期融资券、国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 558,250,338.20          |
| AAA 以下 | 412,433,553.05          |

|     |                |
|-----|----------------|
| 未评级 | -              |
| 合计  | 970,683,891.25 |

注：未评级债券为国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及部分应收申购款等；生息负债主要为卖出回购金融资产款。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

|                          |       |       |        |      |      |     |    |
|--------------------------|-------|-------|--------|------|------|-----|----|
| 本<br>期<br>末<br>201<br>6年 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|-------|-------|--------|------|------|-----|----|

|                                 |                   |                  |                    |                    |                   |   |                      |
|---------------------------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-------------------|---|----------------------|
| 12<br>月<br>31<br>日              |                   |                  |                    |                    |                   |   |                      |
| 资<br>产                          |                   |                  |                    |                    |                   |   |                      |
| 银<br>行<br>存<br>款                | 50,533,859.<br>58 | -                | -                  | -                  | -                 | - | 50,533,859.58        |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金           | 8,923,510.5<br>7  | -                | -                  | -                  | -                 | - | 8,923,510.57         |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金           | 24,803.30         | -                | -                  | -                  | -                 | - | 24,803.30            |
| 交<br>易<br>性<br>金<br>融<br>资<br>产 | 90,767,274.<br>85 | 4,232,800.<br>00 | 229,340,600<br>.00 | 828,258,216<br>.40 | 66,702,000<br>.00 | - | 1,219,300,891<br>.25 |
| 买<br>入<br>返                     | 4,000,000.0<br>0  | -                | -                  | -                  | -                 | - | 4,000,000.00         |

|                            |                |              |                |                |               |               |                  |
|----------------------------|----------------|--------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 售<br>金<br>融<br>资<br>产      |                |              |                |                |               |               |                  |
| 应<br>收<br>利<br>息           | -              | -            | -              | -              | -             | 13,403,402.89 | 13,403,402.89    |
| 应<br>收<br>申<br>购<br>款      | 7,995.20       | -            | -              | -              | -             | -             | 7,995.20         |
| 其<br>他<br>资<br>产           | -              | -            | -              | -              | -             | -             | 0.00             |
| 资<br>产<br>总<br>计           | 154,257,443.50 | 4,232,800.00 | 229,340,600.00 | 828,258,216.40 | 66,702,000.00 | 13,403,402.89 | 1,296,194,462.79 |
| 负<br>债                     |                |              |                |                |               |               |                  |
| 卖<br>出<br>回<br>购<br>金<br>融 | 154,000,000.00 | -            | -              | -              | -             | -             | -154,000,000.00  |

|                                 |   |   |   |   |   |               |               |
|---------------------------------|---|---|---|---|---|---------------|---------------|
| 资<br>产<br>款                     |   |   |   |   |   |               |               |
| 应<br>付<br>证<br>券<br>清<br>算<br>款 | - | - | - | - | - | 19,136,148.09 | 19,136,148.09 |
| 应<br>付<br>赎<br>回<br>款           | - | - | - | - | - | 231,201.60    | 231,201.60    |
| 应<br>付<br>管<br>理<br>人<br>报<br>酬 | - | - | - | - | - | 766,320.00    | 766,320.00    |
| 应<br>付<br>托<br>管<br>费           | - | - | - | - | - | 95,790.00     | 95,790.00     |
| 应<br>付<br>交                     | - | - | - | - | - | 5,124.40      | 5,124.40      |

|         |                |              |                |                |               |               |                  |
|---------|----------------|--------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 易费用     |                |              |                |                |               |               |                  |
| 应付利息    | -              | -            | -              | -              | -             | 26,262.11     | 26,262.11        |
| 其他负债    | -              | -            | -              | -              | -             | 270,000.00    | 270,000.00       |
| 负债总计    | 154,000,000.00 | -            | -              | -              | -             | 20,530,846.20 | 174,530,846.20   |
| 利率敏感度缺口 | 257,443.50     | 4,232,800.00 | 229,340,600.00 | 828,258,216.40 | 66,702,000.00 | -7,127,443.31 | 1,121,663,616.59 |

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

|    |  |
|----|--|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                       |
|    | 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； |
|    | 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                |

|    |  |                             |
|----|--|-----------------------------|
|    | 银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。 |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |  | 本期末（2016年12月31日）            |
|    | 基准利率增加 25 个基点  | -5,991,139.90               |
|    | 基准利率减少 25 个基点  | 6,048,915.50                |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余

期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 47,256,291.25 元，属于第二层次的余额为人民币 1,172,044,600.00 元，无划分为第三层次的余额。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -                |
|    | 其中：股票             | -                | -                |
| 2  | 固定收益投资            | 1,219,300,891.25 | 94.07            |
|    | 其中：债券             | 1,219,300,891.25 | 94.07            |
|    | 资产支持证券            | -                | -                |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -                |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -                |
| 5  | 买入返售金融资产          | 4,000,000.00     | 0.31             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -                |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 59,457,370.15    | 4.59             |
| 7  | 其他各项资产            | 13,436,201.39    | 1.04             |
| 8  | 合计                | 1,296,194,462.79 | 100.00           |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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投资

#### 8.2.2 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沪港通投资股票

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票投资

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 59,664,000.00    | 5.32         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | -                | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | 773,958,600.00   | 69.00        |
| 5  | 企业短期融资券   | 188,953,000.00   | 16.85        |
| 6  | 中期票据      | 149,469,000.00   | 13.33        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 47,256,291.25    | 4.21         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,219,300,891.25 | 108.70       |

## 8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

|   |           |                  |         |               |      |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| 1 | 011698789 | 16 河钢集<br>SCP005 | 600,000 | 59,694,000.00 | 5.32 |
| 2 | 020145    | 16 贴债 47         | 600,000 | 59,664,000.00 | 5.32 |
| 3 | 011698792 | 16 鲁黄金<br>SCP016 | 500,000 | 49,765,000.00 | 4.44 |
| 4 | 041654069 | 16 大秦铁路<br>CP002 | 500,000 | 49,650,000.00 | 4.43 |
| 5 | 127460    | 16 建湖项           | 500,000 | 48,940,000.00 | 4.36 |

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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、处罚的情形。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 24,803.30     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 13,403,402.89 |
| 5  | 应收申购款   | 7,995.20      |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 13,436,201.39 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 128010 | 顺昌转债 | 6,157,040.85 | 0.55         |
| 2  | 113009 | 广汽转债 | 6,032,434.00 | 0.54         |

|   |        |      |              |      |
|---|--------|------|--------------|------|
| 3 | 110032 | 三一转债 | 5,526,000.00 | 0.49 |
| 4 | 110034 | 九州转债 | 4,878,000.00 | 0.43 |
| 5 | 110033 | 国贸转债 | 4,354,800.00 | 0.39 |
| 6 | 128009 | 歌尔转债 | 2,419,200.00 | 0.22 |

### 8.12.5 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投资。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构          |            |                |            |
|--------------|---------------|----------------|------------|----------------|------------|
|              |               | 机构投资者          |            | 个人投资者          |            |
|              |               | 持有份额           | 占总份<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 3,652        | 312,322.99    | 900,547,500.00 | 78.95%     | 240,056,048.14 | 21.05%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 97,800.00 | 0.0086%  |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年9月29日）基金份额总额          | 1,160,091,316.65 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 315,883.34       |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 19,803,651.85    |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 1,140,603,548.14 |

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2016 年 1 月 14 日公告，陈晓翔先生不再担任汇添富价值精选混合型证券投资基金的基金经理，由劳杰男先生单独管理该基金。

2、《汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 1 月 21 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

3、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 11 日正式生效，何旻先生和李怀定先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人于 2016 年 3 月 12 日公告，增聘马翔先生担任汇添富民营活力混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。

5、《汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 16 日正式生效，曾刚先生和李怀定先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2016 年 4 月 2 日公告，陈灿辉先生不再担任副总经理。

7、基金管理人 2016 年 4 月 9 日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富消费行业混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。

8、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 19 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 3 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

11、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

12、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

13、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 30 天债券型证券投资

资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

14、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富添富货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

15、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

16、基金管理人 2016 年 7 月 14 日公告，赖中立不再担任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理，由倪健先生单独管理该基金。

17、《汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 27 日正式生效，顾耀强先生和赵鹏程先生任该基金的基金经理。

18、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金合同》于 2016 年 7 月 28 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

19、基金管理人于 2016 年 8 月 2 日公告，增聘余中强先生担任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生、赵鹏程先生共同管理该基金。

20、《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 3 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

21、基金管理人于 2016 年 8 月 9 日公告，增聘楚天舒女士担任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

22、基金管理人于 2016 年 8 月 25 日公告，增聘余中强先生担任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理，同时，韩贤旺先生、顾耀强先生和叶从飞先生不再担任该基金的基金经理。

23、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2016 年 9 月 18 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

24、《汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

25、基金管理人于 2016 年 11 月 2 日公告，刘闯先生不再担任汇添富医药保健混合型证券投资基金的基金经理，由周睿先生单独管理该基金。

26、《汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 6 日正式生效，曾刚先生和李怀定先生任该基金的基金经理。

27、《汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 21 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

28、《汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年

12 月 22 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

29、《汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

30、《汇添富鑫瑞债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 26 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。

31、《汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

32、《汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

33、自 2016 年 1 月起，本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期没有涉及基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2008 年 7 月 8 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币捌万元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，针对中国证监会出具的责令改正措施，以及对相关负责人的警示，本基金管理人高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、实施整改措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前本基金管理人已完成相关整改工作。

本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元<br>数量 | 股票交易 |                      | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|------------|------|----------------------|-----------|----------------|----|
|      |            | 成交金额 | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 东方证券 | 2          | -    | -                    | -         | -              | -  |

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |                      | 债券回购交易        |                            | 权证交易 |                      |
|------|----------------|----------------------|---------------|----------------------------|------|----------------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额          | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 东方证券 | 464,412,755.42 | 100%                 | 5,037,200,000 | 100%                       | -    | -                    |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审

批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。此 2 个交易单元与汇添富货币市场基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富和聚宝货币基金、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金共用。

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                     | 法定披露方式                | 法定披露日期          |
|----|--|-----------------------|-----------------|
| 1  | 汇添富保鑫保本基金托管协议                            | 公司网站,                 | 2016 年 8 月 19 日 |
| 2  | 汇添富保鑫保本基金基金合同                            | 公司网站,                 | 2016 年 8 月 19 日 |
| 3  | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金合同摘要                   | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 8 月 19 日 |
| 4  | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金份额发售公告                 | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 8 月 19 日 |
| 5  | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金招募说明书                    | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 8 月 19 日 |
| 6  | 关于汇添富保鑫保本混合型证券投资基金通过网上直销认购费率优惠的公告        | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 8 月 23 日 |
| 7  | 汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富保鑫保本混合型证券投资基金提前结束募集的公告 | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 9 月 26 日 |
| 8  | 关于汇添富保鑫保本混合型证券投资基金增加销售机构的公告              | 中证报, 上证报, 公司网站, 证券时报, | 2016 年 9 月 26 日 |
| 9  | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金合同生效公告                 | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 9 月 30 日 |

|    |  |                       |                  |
|----|--|-----------------------|------------------|
| 10 | 关于汇添富保鑫保本混合型证券投资基金参加部分代销机构定投基金、电子渠道申购基金费率优惠活动的公告 | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 10 月 28 日 |
| 11 | 关于汇添富保鑫保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告        | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 10 月 28 日 |
| 12 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加广源达信开展的申购、定投基金费率优惠活动的公告   | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 11 月 9 日  |
| 13 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加凯石财富开展的申购基金、定投基金费率优惠活动的公告 | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 11 月 12 日 |
| 14 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加新浪仓石开展的申购基金、定投基金费率优惠活动的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, | 2016 年 11 月 12 日 |
| 15 | 汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过国美基金申购、定投金额下限的公告        | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 12 月 3 日  |
| 16 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加蛋卷基金开展的申购、定投基金费率优惠活动的公告   | 中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 12 月 3 日  |
| 17 | 汇添富基金管理股份有限公司关于公司注册资本及股权变更的公告                    | 上证报, 中证报, 证券时报, 公司网站, | 2016 年 12 月 24 日 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富增强收益债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富保鑫保本混合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、报告期内汇添富保鑫保本混合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。

### 12.2 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

### 12.3 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](http://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 3 月 29 日