

广发金管家多添利集合资产管理计划

2016 年度资产管理报告

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 3 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) 合规管理与风险控制报告.....	4
四、 集合计划会计报表.....	5
(一) 资产负债表.....	5
(二) 利润表.....	6
(三) 份额变动表.....	7
五、 集合计划投资组合报告.....	7
(一) 资产组合情况.....	7
六、 重要事项提示.....	7
七、 备查文件目录.....	8
(一) 本集合计划备查文件目录.....	8
(二) 存放地点及查阅方式.....	8

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。

本年度报告的财务资料已经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）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1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 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1月1日—2016年12月31日
1	集合计划本期已实现收益（元）	4,536,085,181.44
2	本期利润（元）	4,536,085,181.44
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 3,162,935,118.00 元

三、 集合计划管理人报告

（一） 投资主办人简介

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

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。

（二） 报告期内业绩表现

2016 年末各期限报价：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

在经过两年的货币政策宽松后，面临美联储加息预期和人民币贬值压力，2016年央行的货币政策空间已较为有限，仅在2月份为应对外汇占款下降实施降准一次。债券市场全年走势波折，前三季度随着理财规模的持续扩张，期限利差、信用利差持续压缩，收益率曲线不断平坦化；但从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年期国债收益率最高上行约70bp。货币市场方面，2016年资金面较以往波动频率和幅度明显加剧，临近年底各期限资金利率大幅上升，银行间7天回购加权利率也从年初的上升2.3%到4.0%左右，货币基金出现大额赎回，市场流动性面临严峻挑战。本产品在三季度以后规模保持稳定，期限配置合理，经受住了流动性考验；在投资方面一贯坚持以流动性为主，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，一方面货币政策已转向稳健中性，流动性压力不减，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，货币政策仍强调防风险底线，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） 合规管理与风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其他法律法规的规定，管理和运用本集合计划资产，本着诚实信用、勤勉尽责的原则，在控制风险的基础上为集合计划持有人谋求最大利益，运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为。

2、内部监察报告

本集合计划管理人的内部监察工作由公司合规风控部负责。主要采用适时监控、业务流程测试、材料审阅、现场调查核实、人员访谈和统计分析等多种方法对集合计划的管理运作进行监察。

公司合规风控部负责对集合资产管理业务的重大事项进行风险评估和提供常规性合规咨询，每日由专人负责理财产品进行监控，重点检查集合计划管理人是否存在损害集合计划持有人利益的行为。同时对集合计划产品的推广和投资管理流程进行检查，对于业务活动中可能出现的风险和控制漏洞进行了揭示，并要求反馈和整改。

我们认为，本报告期内，集合计划管理人始终能按照有关法律法规、公司相关制度要求和集合资产管理计划合同的约定，对集合计划进行管理。

四、 集合计划会计报表

(一) 资产负债表

单位：元

资产	2016/12/31	2015/12/31	负债与所有者权益	2016/12/31	2015/12/31
资产：			负债：		
银行存款	28,901,744,620.83	14,187,190,649.06	短期借款	-	-
结算备付金	1,277,343,301.93	767,344,440.35	交易性金融负债	-	-
存出保证金	12,292,177.26	37,903,658.00	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	122,302,849,112.73	67,968,413,574.90	卖出回购金融资产款	33,121,912,419.16	15,527,412,445.25
其中：股票投资	9,999,994.23	97,522,864.00	应付证券清算款	-	1,566,759,356.23
债券投资	108,075,561,872.08	40,049,580,394.23	应付赎回款	-	-
基金投资	12,381,204,546.42	27,140,702,051.67	应付管理人报酬	32,648,927.84	46,176,462.07
资产支持证券投资	1,836,082,700.00	680,608,265.00	应付托管费	5,441,487.98	7,694,380.60
专项资产管理计划	-	-	应付销售服务费	-	-
银行理财产品	-	-	应付咨询服务费	-	-
信托投资	-	-	应付交易费用	1,549,886.17	3,994,125.04
私募基金投资	-	-	应交税费	-	-
衍生金融资产	-	-	应付利息	9,124,655.43	1,636,920.64
权证投资	-	-	应付利润	1,782,390,894.35	409,241,830.91
买入返售金融资产	2,399,963,918.41	99,647,995.65	其他负债	113,084,639.07	257,882,778.20
应收证券清算款	182,065,232.68	280,000,000.00	负债合计	35,066,152,910.00	17,820,798,298.94
应收利息	1,670,295,508.06	659,168,168.27	所有者权益：		

应收股利	2,556,796.10	4,999,413.71	实收基金	121,682,957,758.00	66,183,869,601.00
应收申购款	-	-	未分配利润	-	-
其他资产	-	-	所有者权益合计	121,682,957,758.00	66,183,869,601.00
资产总计	156,749,110,668.00	84,004,667,899.94	负债和所有者权益总计	156,749,110,668.00	84,004,667,899.94

(二) 利润表

单位：元

项目	2016 年度	2015 年度
一、收入	5,243,663,382.03	2,141,695,970.71
1. 利息收入	4,072,284,125.46	1,443,390,101.89
其中：存款利息收入	718,702,486.35	398,759,625.37
债券利息收入	3,253,613,560.33	1,020,855,758.58
资产支持证券利息收入	67,321,476.52	22,276,208.43
信托利息收入	-	-
银行理财产品利息收入	-	-
私募基金利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	32,646,602.26	1,498,509.51
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,170,829,256.57	696,330,040.32
其中：股票投资收益	10,019,273.24	236,460.11
基金投资收益	-17,637,230.30	239,181,098.12
债券投资收益	119,471,289.73	32,299,470.12
资产支持证券投资	-	-
信托投资收益	-	-
银行理财产品投资收益	-	3,278,356.16
私募基金投资收益	-	-
专项资产管理计划投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,058,975,923.90	421,334,655.81
基金红利收入	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-53,191.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	550,000.00	2,029,020.00
二、费用	707,578,200.59	588,983,286.38
1. 管理人报酬	167,367,473.16	400,350,954.49
2. 托管费	52,027,610.31	15,637,653.73
3. 销售服务费	-	-
4. 咨询服务费	-	-
5. 交易费用	8,530,038.37	9,778,774.83
6. 利息支出	479,510,209.43	163,107,800.55
其中：卖出回购金融资产支出	479,510,209.43	163,107,800.55

7、其他费用	142,869.32	108,102.78
三、利润总额	4,536,085,181.44	1,552,712,684.33
四、净利润	4,536,085,181.44	1,552,712,684.33

(三) 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
661,838,696.01	3,092,697,525.47	2,537,706,643.90	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	108,075,561,872.08	68.95%
基金	12,381,204,546.42	7.90%
资产支持证券	1,836,082,700.00	1.17%
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%
其它资产	1,685,144,481.42	1.08%
合计	156,749,110,668.00	100.00%

注1：“其它资产”包括“存出保证金”、“应收红利”、“应收利息”等项目。

2：上表中因四舍五入原因，各项目占总资产比例之和与合计可能存在尾差。

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3月