

# 汇添富双利债券型证券投资基金 2016 年年 度报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金名称            | 汇添富双利债券型证券投资基金  |                 |
| 基金简称            | 汇添富双利债券         |                 |
| 基金主代码           | 470018          |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |                 |
| 基金合同生效日         | 2014 年 1 月 28 日 |                 |
| 基金管理人           | 汇添富基金管理股份有限公司   |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司    |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 82,596,092.15 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期             |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 双利债券 A          | 双利债券 C          |
| 下属分级基金的交易代码:    | 470018          | 000692          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 71,449,690.67 份 | 11,146,401.48 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，在严格管理投资风险，保持资产的流动性的基础上，为基金份额持有人追求资产的长期稳定增值。                                 |
| 投资策略   | 本基金根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、债券的信用研究、债券的利差水平研究，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数。   |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金，属于基金中的较低预期风险较低预期收益的品种，其预期风险收益水平高于货币市场基金、低于股票型基金及混合型基金。                            |

## 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             | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李鹏                        | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-28932888              | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | service@99fund.com        | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-888-9918              | 95588               |
| 传真      |      | 021-28932998              | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址    |      | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层    | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 200120                    | 100140              |
| 法定代表人   |      | 李文                        | 易会满                 |

## 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 | www.99fund.com         |

|            |                                  |
|------------|----------------------------------|
| 址          |                                  |
| 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21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        |               | 2015 年        |              | 2014 年 1 月 28 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日 |        |
|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------|---|--------|
|               | 双利债券 A        | 双利债券 C        | 双利债券 A        | 双利债券 C       | 双利债券 A                                    | 双利债券 C |
| 本期已实现收益       | 11,643,269.99 | 2,835,349.08  | 16,024,679.38 | 1,698,655.47 | -   | -      |
| 本期利润          | -1,394,610.75 | -1,448,474.50 | 17,209,002.29 | 466,831.17   | -   | -      |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0165       | -0.0861       | 0.1751        | 0.0280       | -   | -      |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.12%        | -6.46%        | 12.55%        | 2.13%        | -   | -      |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.88%        | -1.26%        | 14.31%        | 13.77%       | -   | -      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末       |               | 2015 年末       |              | 2014 年末                                   |        |
| 期末可供分配利润      | 32,234,583.24 | 3,672,591.88  | 31,236,402.02 | 9,456,191.03 | -   | -      |
| 期末可供          | 0.4512        | 0.3295        | 0.3189        | 0.2145       | -   | -      |

|                     |                |               |                |               |         |   |
|---------------------|----------------|---------------|----------------|---------------|---------|---|
| 分配基金<br>份额利润        |                |               |                |               |         |   |
| 期末基金<br>资产净值        | 104,656,457.81 | 14,826,109.65 | 144,729,263.52 | 59,386,880.44 | -       | - |
| 期末基金<br>份额净值        | 1.465          | 1.330         | 1.478          | 1.347         | -       | - |
| 3.1.3<br>累计期末<br>指标 | 2016 年末        |               | 2015 年末        |               | 2014 年末 |   |
| 基金份额<br>累计净值<br>增长率 | 37.95%         | 33.00%        | 39.17%         | 34.70%        | -       | - |

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、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、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、汇添富双利债券型证券投资基金自 2014 年 6 月 18 日起增加 C 类收费模式，该类收费模式不收取申购费，而是从基金资产中计提销售服务费。

### 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

双利债券 A

| 阶段    | 份额净值增<br>长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准<br>差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -2.20%       | 0.22%               | -2.32%             | 0.15%                 | 0.12% | 0.07% |
| 过去六个月 | 0.55%        | 0.20%               | -1.42%             | 0.11%                 | 1.97% | 0.09% |
| 过去一年  | -0.88%       | 0.32%               | -1.63%             | 0.09%                 | 0.75% | 0.23% |

|                     |        |       |       |       |        |       |
|---------------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三年                | 0.00%  | 0.00% | 0.00% | 0.00% | 0.00%  | 0.00% |
| 过去五年                | 0.00%  | 0.00% | 0.00% | 0.00% | 0.00%  | 0.00% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 37.95% | 0.60% | 8.34% | 0.10% | 29.61% | 0.50% |

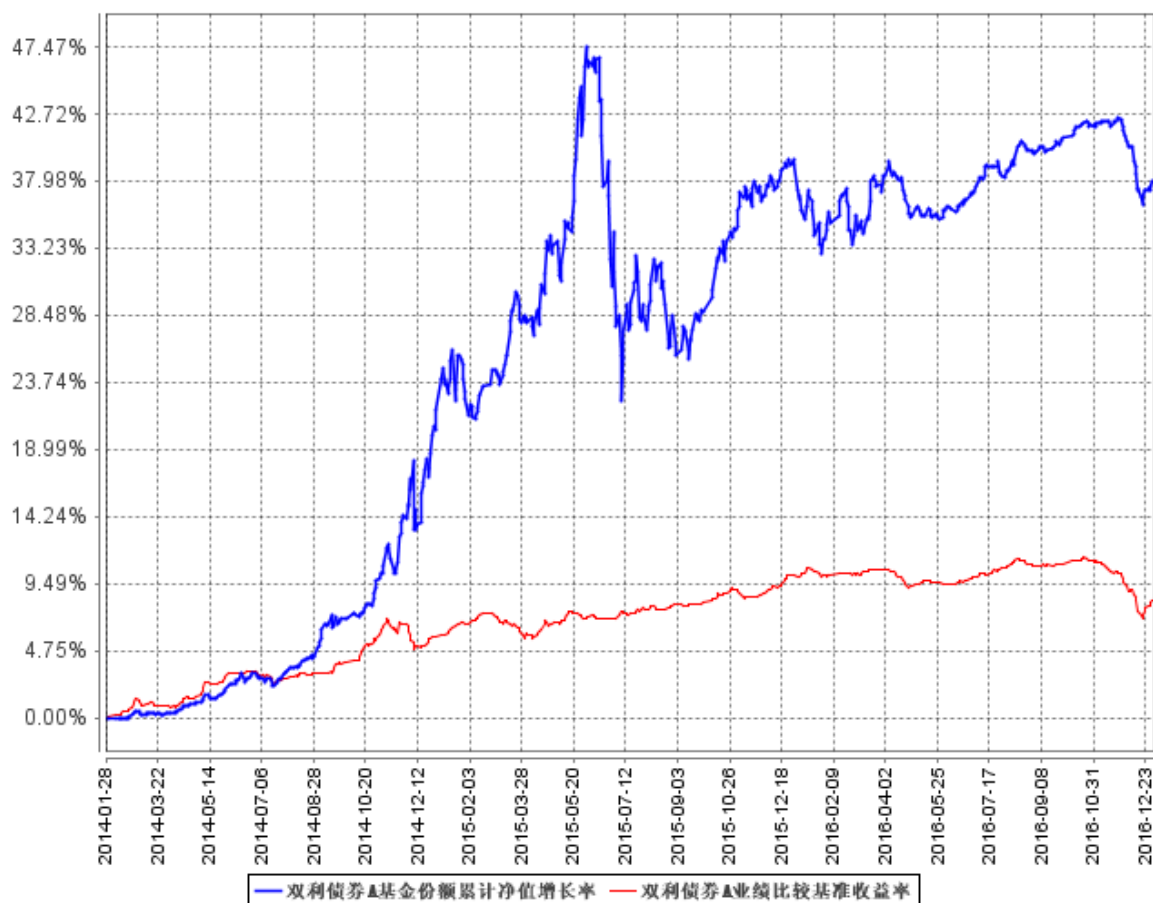
双利债券 C

| 阶段                  | 份额净值增<br>长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月               | -2.28%       | 0.23%               | -2.32%             | 0.15%                 | 0.04%  | 0.08% |
| 过去六个月               | 0.38%        | 0.21%               | -1.42%             | 0.11%                 | 1.80%  | 0.10% |
| 过去一年                | -1.26%       | 0.32%               | -1.63%             | 0.09%                 | 0.37%  | 0.23% |
| 过去三年                | 0.00%        | 0.00%               | 0.00%              | 0.00%                 | 0.00%  | 0.00% |
| 过去五年                | 0.00%        | 0.00%               | 0.00%              | 0.00%                 | 0.00%  | 0.00% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 33.00%       | 0.64%               | 4.98%              | 0.10%                 | 28.02% | 0.54% |

注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 1 月 28 日，至本报告期末未满三年。

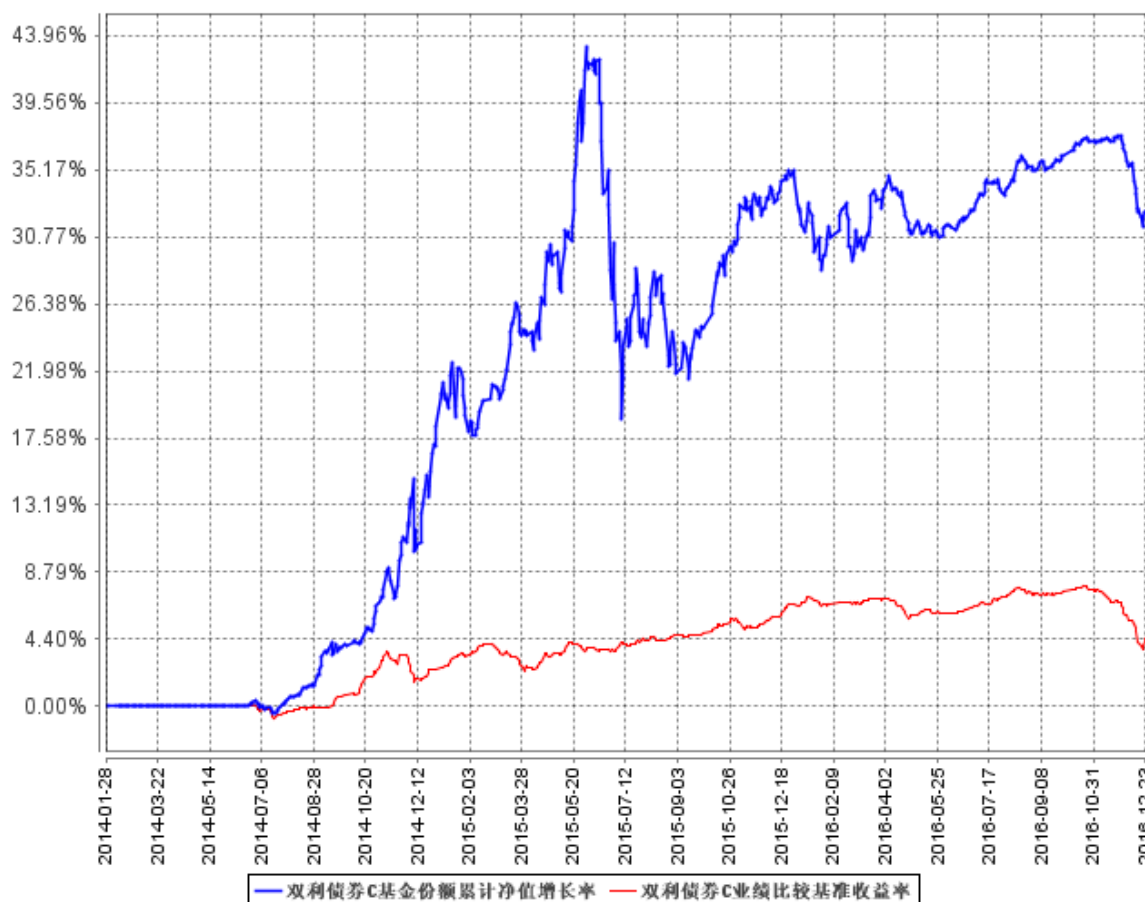
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

双利债券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





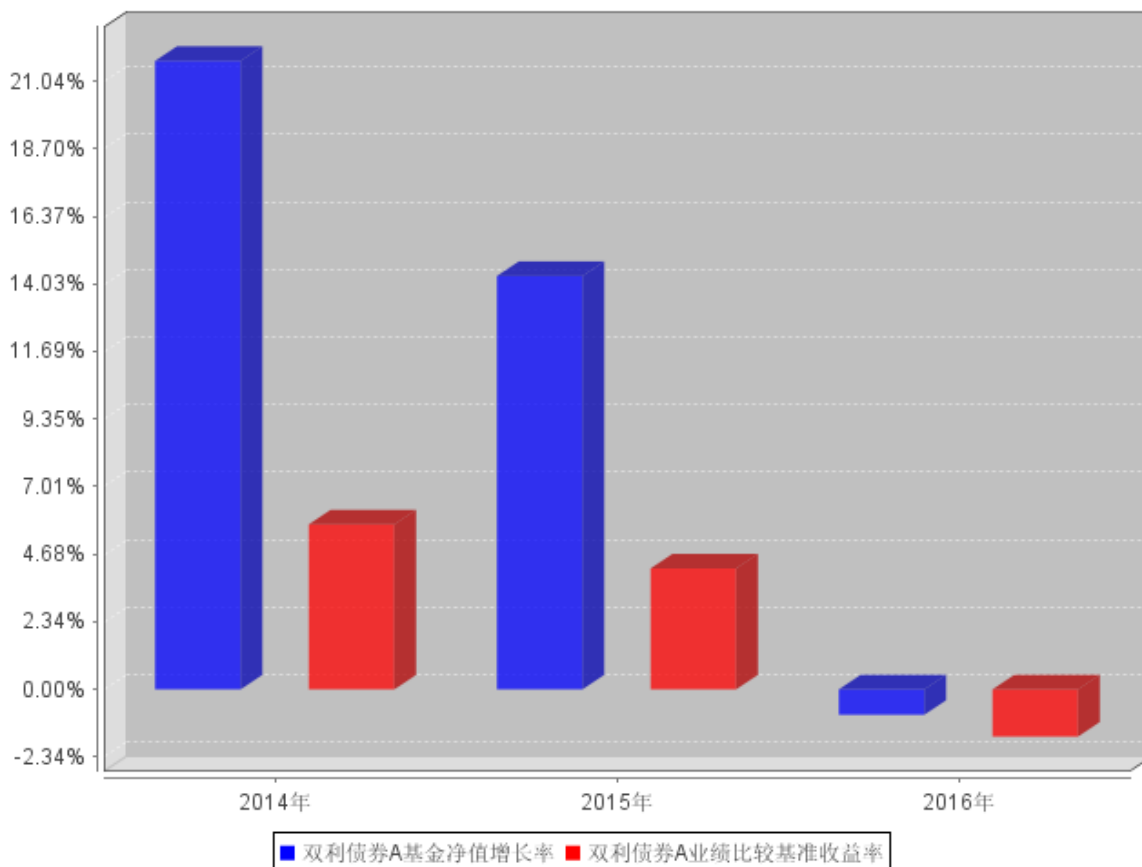
双利债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



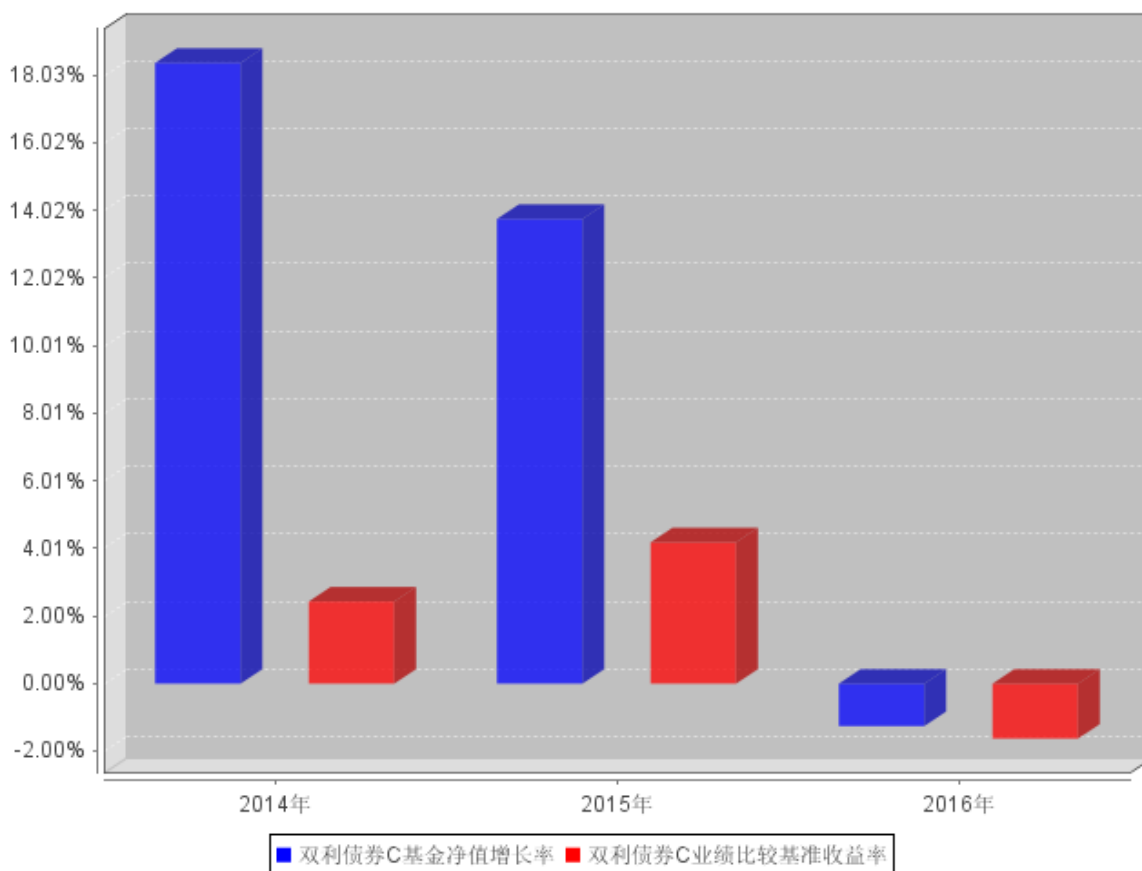
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2014年1月28日)起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

### 3.2.3 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

双利债券A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



双利债券C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 2014 年 1 月 28 日，至本报告期末未满三年。

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折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金成立于 2011 年 1 月 26 日，2011 年度、2012 年度、2013 年度、2014 年度、2015 年度和 2016 年度均未进行利润分配。

## § 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资顾问。

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 |        |           |
| 陈加荣 | 汇添富双 | 2013 年 2 月 7    | -    | 15 年   | 国籍：中国。学历： |

|  |   |          |  |   |
|--|---|----------|--|---|
|  | <p>利债券基金、汇添富高息债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。</p> | <p>日</p> |  | <p>天津大学管理工程硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在中国平安集团任债券研究员、交易员及本外币投资经理，国联安基金公司任基金经理助理、债券组合经理，农银汇理基金公司任固定收益投资负责人。2008 年 12 月 23 日到 2011 年 3 月 2 日任农银汇理恒久增利债券基金的基金经理，2009 年 4 月 2 日到 2010 年 5 月 9 日任农银汇理平衡双利混合基金的基金经理。2012 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部高级经理、基金经理助理。2012 年 12 月 21 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富收益快线货币基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富双利债券基金的基金经</p> |
|--|---|----------|--|---|

|    |   |                 |   |     |   |
|----|---|-----------------|---|-----|---|
|    |   |                 |   |     | <p>理，2013 年 2 月 7 日至 2015 年 8 月 28 日任汇添富信用债债券基金的基金经理，2013 年 6 月 27 日至今任汇添富高息债债券基金的基金经理，2013 年 9 月 6 日至今任汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。</p>  |
| 李威 | <p>汇添富国企创新股票基金的基金经理、汇添富外延增长股票基金的基金经理，汇添富可转换债券基金、汇添富双利债券基金、汇添富双利增强债券基金的基金经理助理。</p> | 2015 年 5 月 25 日 | - | 7 年 | <p>国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。<br/>                     相关业务资格：证券投资基金从业资格。<br/>                     从业经历：2008 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司任行业分析师，2015 年 1 月 29 日至今任汇添富外延增长股票基金的基金经理。2015 年 5 月 25 日至今任汇添富可转换债券基金、汇添富双利债券基金、汇添富双利增强债券基金的基金经理助理，2015 年 7 月 10 日至今任汇添富国企创新股票基金的基金</p> |

|  |  |  |  |  |     |
|--|--|--|--|--|-----|
|  |  |  |  |  | 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 年证券市场波澜壮阔、跌宕起伏, 债市前期大部震荡, 年末以“债灾”2.0 收尾, 股市则以熔断开局, 后逐步震荡企稳。债券市场 3 月底 4 月初, 受市场流动性边际收紧、“营改增”、经济数据暂现“小阳春”、商品价格暴涨触发通胀预期回升, 以及城投债提前赎回事件、信用违约事件集中释放、大型金融机构风险偏好下降收缩杠杆等因素的冲击, 7 年、3 年评级 AA+ 的城投债分别上行 80、30bp; 10 月底, 在央行 8 月份重启逆回购基础上, 受央行可能将表外理财纳入 MPA 考核、去杠杆更坚决的影响, “债灾”再现, 全年下来, 10 年国开上行 55bp, 到 3.68%, 7

年评级 AA+的城投债上行 49bp 到 4.57%，3 年评级 AA+城投债上行 87bp 到 5.25%；类权益方面，在经济向下弱于预期、PPI 快速上升，国企改革力度加强，叠加股市去杠杆以及维稳力量的综合作用，上证综指下跌 13.13%，创业板指数下跌 29.41%，中证转债指数下跌 12.17%。

本基金在年初首日开盘即果断大幅减持股票，有效规避了熔断的影响，但转债由于多方原因减持不大成功，年末债灾 2.0 之前，我们也较早预判到巨大的市场风险，已经较多减持债券，可惜对债券基金赎回引发的一般债券的流动性危机对转债的冲击重视不够。本基金成立已近三年（2014 年 1 月 28 日成立），经历了一轮完整的股、债涨跌周期，总体来看，我们敏锐把握住了大类资产的转换，近三年的收益在 wind 统计的同类基金中遥遥领先。今后我们将继续勤勉尽责，努力为投资者服务。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年本基金 A 级净值收益率为-0.88%，C 级净值收益率为-1.26%，同期业绩比较基准收益率为-1.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在经济弱复苏、通胀略有反弹的背景下，金融去杠杆，对于整个市场杠杆仍然较高的债市而言，是影响市场发展的关键驱动因素，考虑到目前的债券收益率已经较高，具有一定的配置价值，预计未来债市处于震荡筑底的过程中，机会值得期待。股市更多呈结构性，经过去年的大跌，性价比相对更高点。

#### 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**

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次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 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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，本基金托管人在对汇添富双利债券型证券投资基金（原汇添富保本混合型证券投资基金）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，汇添富双利债券型证券投资基金（原汇添富保本混合型证券投资基金）的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富双利债券型证券投资基金（原汇添富保本混合型证券投资基金）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富双利债券型证券投资基金（原汇添富保本混合型证券投资基金）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的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富双利债券型证券投资基金（原汇添富保本混合型证券投资基金）2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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、蔺育化于 2017 年 3 月 28 日签字出具了安永华明（2017）审字第 60466941\_B14 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：汇添富双利债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                 |                                  |
| 银行存款            | 1,580,059.89                    | 9,051,588.82                     |
| 结算备付金           | 911,327.14                      | 4,658,128.96                     |
| 存出保证金           | 10,793.79                       | 31,090.34                        |
| 交易性金融资产         | 146,091,004.36                  | 250,981,815.65                   |
| 其中：股票投资         | 4,682,954.28                    | 24,014,892.00                    |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | 141,408,050.08                  | 226,966,923.65                   |
| 资产支持证券投资        | -                               | -                                |
| 贵金属投资           | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 10,000,000.00                   | -                                |
| 应收证券清算款         | 2,499,252.04                    | -                                |
| 应收利息            | 2,988,043.37                    | 5,408,999.25                     |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | 3,246.01                        | 1,567,275.30                     |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 164,083,726.60                  | 271,698,898.32                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 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        | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款     | 42,000,000.00  | 63,000,000.00  |
| 应付证券清算款       | 2,008,444.45   | 3,401,163.12   |
| 应付赎回款         | 90,265.94      | 613,476.22     |
| 应付管理人报酬       | 74,721.93      | 114,823.90     |
| 应付托管费         | 21,349.10      | 32,806.81      |
| 应付销售服务费       | 5,508.92       | 17,947.47      |
| 应付交易费用        | 7,754.88       | 12,474.94      |
| 应交税费          | -              | -              |
| 应付利息          | 3,106.73       | -              |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 390,007.19     | 390,061.90     |
| 负债合计          | 44,601,159.14  | 67,582,754.36  |
| <b>所有者权益：</b> |                |                |
| 实收基金          | 82,596,092.15  | 142,013,369.45 |
| 未分配利润         | 36,886,475.31  | 62,102,774.51  |
| 所有者权益合计       | 119,482,567.46 | 204,116,143.96 |
| 负债和所有者权益总计    | 164,083,726.60 | 271,698,898.32 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.447 元，基金份额总额 82,596,092.15 份，其中下属 A 类基金份额参考净值 1.465 元，基金份额总额 71,449,690.67 份；下属 C 类基金份额参考净值 1.330 元，基金份额总额 11,146,401.48 份。



## 7.2 利润表

会计主体：汇添富双利债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|-----------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                       | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年<br>12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12<br>月 31 日 |
| <b>一、收入</b>           | 104,671.37                          | 22,128,610.40                       |
| 1.利息收入                | 8,072,125.07                        | 11,079,010.48                       |
| 其中：存款利息收入             | 83,127.94                           | 177,339.30                          |
| 债券利息收入                | 7,976,243.55                        | 10,883,245.32                       |
| 资产支持证券利息收入            | -                                   | -                                   |
| 买入返售金融资产收入            | 12,753.58                           | 18,425.86                           |
| 其他利息收入                | -                                   | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 9,328,228.47                        | 11,021,247.61                       |
| 其中：股票投资收益             | 8,331,863.35                        | 1,781,100.24                        |
| 基金投资收益                | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                | 968,117.52                          | 8,981,236.23                        |
| 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                  | 28,247.60                           | 258,911.14                          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -17,321,704.32                      | -47,501.39                          |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                   | -                                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 26,022.15                           | 75,853.70                           |
| <b>减：二、费用</b>         | 2,947,756.62                        | 4,452,776.94                        |

|                     |                  |                  |
|---------------------|------------------|------------------|
| 1. 管理人报酬            | 1, 028, 789. 96  | 1, 106, 846. 67  |
| 2. 托管费              | 293, 939. 84     | 316, 241. 88     |
| 3. 销售服务费            | 88, 333. 03      | 83, 643. 64      |
| 4. 交易费用             | 115, 789. 13     | 194, 576. 69     |
| 5. 利息支出             | 990, 271. 89     | 2, 313, 740. 92  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | 990, 271. 89     | 2, 313, 740. 92  |
| 6. 其他费用             | 428, 612. 00     | 436, 692. 00     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -2, 843, 085. 25 | 17, 675, 833. 46 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富双利债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>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）                   | 142, 013, 369. 45                      | 62, 102, 774. 51  | 204, 116, 143. 96  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                      | -2, 843, 085. 25  | -2, 843, 085. 25   |
| 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） | -59, 417, 277. 30                      | -22, 373, 213. 95 | -81, 790, 491. 25  |
| 其中：1. 基金申购款                       | 63, 167, 934. 95                       | 27, 136, 043. 63  | 90, 303, 978. 58   |
| 2. 基金赎回款                          | -122, 585, 212. 25                     | -49, 509, 257. 58 | -172, 094, 469. 83 |

|  |                       |                 |                 |
|--|-----------------------|-----------------|-----------------|
| 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）                        | 82,596,092.15         | 36,886,475.31   | 119,482,567.46  |
| 项目                                     | 上年度可比期间               |                 |                 |
|  | 2015年1月1日至2015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）                        | 122,963,840.50        | 35,902,097.70   | 158,865,938.20  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                     | 17,675,833.46   | 17,675,833.46   |
| 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）      | 19,049,528.95         | 8,524,843.35    | 27,574,372.30   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 325,541,036.59        | 124,660,692.63  | 450,201,729.22  |
| 2. 基金赎回款                               | -306,491,507.64       | -116,135,849.28 | -422,627,356.92 |
| 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）                        | 142,013,369.45        | 62,102,774.51   | 204,116,143.96  |

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

汇添富双利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由汇添富保本混合型证券投资基金(以下简称“汇添富保本基金”)转型而来,按照原《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,汇添富保本基金自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止为基金保本周期(如保本周期届满的最后一日为非工作日,则保本周期到期日顺延至下一个工作日),保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续,否则,本基金变更为非保本的债券型基金,基金名称相应变更为“汇添富双利债券型证券投资基金”。自 2014 年 1 月 28 日起,《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》正式生效,基金合同生效日的规模为 951,062,487.01 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原汇添富保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[2010]1875 号文《关于核准汇添富保本混合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)向社会公开发行募集,基金合同于 2011 年 1 月 26 日正式生效,首次设立募集规模为 2,506,696,469.30 份基金份额。

自 2014 年 6 月 18 日起对本基金增设 C 类基金份额类别。增设基金份额后,本基金将分设为 A 类基金份额和 C 类基金份额。其中,在投资者申购时收取申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离债券、债券回购、短期融资券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。本基金 80%以上的基金资产投资于固定收益类金融工具,其中本基金持有的公司债、企业债、可转换债券、金融债、资产支持证券、短期融资券等非国家信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 30%;本基金还可投资于一级

市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但上述非固定收益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

#### **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《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〉》及其他中国证监会、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。**

##### **7.4.4.1 会计政策变更的说明**

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

##### **7.4.4.2 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 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

### 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。

### 2. 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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，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]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。

### 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[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。

### 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 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 |
| 中国工商银行股份有限公司        | 基金托管人、基金代销机构        |
| 东方证券股份有限公司          | 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            |
| 上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙） | 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            |
| 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：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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期                               |                      | 上年度可比期间                          |                      |
|----------------|----------------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                      | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                      |
|                | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 |
| 东方证券股份有<br>限公司 | 68,049,740.97                    | 100.00%              | 107,706,534.16                   | 100.00%              |



### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                      |
|----------------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|                | 成交金额                        | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 |
| 东方证券股份有<br>限公司 | 185,201,554.95              | 100.00%              | 223,632,626.03                   | 100.00%              |

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                            |
|----------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
|                | 回购成交金额                      | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                           | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 |
| 东方证券股份有<br>限公司 | 8,821,900,000.00            | 100.00%                    | 17,544,100,000.00                | 100.00%                    |

### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                |          |                      |
|-------|-----------------------------|----------------|----------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                    | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付<br>佣金总额的<br>比例 |

|                |                                  |                |           |                      |
|----------------|----------------------------------|----------------|-----------|----------------------|
| 东方证券股份有<br>限公司 | 62,350.42                        | 100.00%        | 7,404.88  | 100.00%              |
| 关联方名称          | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                |           |                      |
|                | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付<br>佣金总额的<br>比例 |
| 东方证券股份有<br>限公司 | 97,798.46                        | 100.00%        | 10,714.89 | 100.00%              |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,028,789.96          | 1,106,846.67          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 335,318.76            | 413,828.38            |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 293,939.84                       | 316,241.88                       |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                               |           |           |
|----------------|----------------------------------|-----------|-----------|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |           |           |
|                | 双利债券 A                           | 双利债券 C    | 合计        |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -                                | 88,333.03 | 88,333.03 |
| 合计             | -                                | 88,333.03 | 88,333.03 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |           |           |
|                | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |           |           |
|                | 双利债券 A                           | 双利债券 C    | 合计        |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -                                | 83,643.64 | 83,643.64 |

|     |   |           |           |
|-----|---|-----------|-----------|
| 限公司 |   |           |           |
| 合计  | - | 83,643.64 | 83,643.64 |

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中划出，分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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                               |           | 上年度可比期间                          |           |
|--------------|----------------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
|              | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |           | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |           |
|              | 期末余额                             | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 1,580,059.89                     | 17,219.74 | 9,051,588.82                     | 47,255.85 |

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，2016 年度获得的利息收入为人民币 63,839.29 元(2015 年度：人民币 124,982.02 元)，2016 年末结算备付金余额为人民币 911,327.14 元(2015 年末：人民币 4,658,128.96 元)。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

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

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘价 | 数量(股)  | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------|-------|--------|--------------|--------------|----|
| 113008 | 电气转债 | 2016年8月31日 | 重大事项停牌 | 114.43 | -    | -     | 15,010 | 1,982,789.90 | 1,717,594.30 | -  |

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 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。

###### 7.4.9.3.2 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 36,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 6 日到期；从事深圳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 6,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 6 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

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

#### 7.4.10.1.1 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。

#### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 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 31,782,750.36 元，属于第二层次的余额为人民币 114,308,254.00 元，无划分为第三层次余额（于 2015 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 59,894,390.19 元，属于第二层次的余额为人民币 191,087,425.46 元，无划分为第三层次余额）。

##### 7.4.10.1.2.2 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。

##### 7.4.10.1.2.3 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。

#### 7.4.10.2 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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 4,682,954.28   | 2.85          |
|    | 其中：股票             | 4,682,954.28   | 2.85          |
| 2  | 固定收益投资            | 141,408,050.08 | 86.18         |
|    | 其中：债券             | 141,408,050.08 | 86.18         |
|    | 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          | 10,000,000.00  | 6.09          |
|    | 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      | 2,491,387.03   | 1.52          |
| 7  | 其他各项资产            | 5,501,335.21   | 3.35          |
| 8  | 合计                | 164,083,726.60 | 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别           | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业       | -            | -             |
| B  | 采矿业            | -            | -             |
| C  | 制造业            | 2,598,614.28 | 2.17          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供 | -            | -             |

|   |                 |              |      |
|---|-----------------|--------------|------|
|   | 应业              |              |      |
| E | 建筑业             |              | -    |
| F | 批发和零售业          |              | -    |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     |              | -    |
| H | 住宿和餐饮业          |              | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 242,420.00   | 0.20 |
| J | 金融业             | 1,688,120.00 | 1.41 |
| K | 房地产业            | 153,800.00   | 0.13 |
| L | 租赁和商务服务业        |              | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      |              | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   |              | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   |              | -    |
| P | 教育              |              | -    |
| Q | 卫生和社会工作         |              | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业       |              | -    |
| S | 综合              |              | -    |
|   | 合计              | 4,682,954.28 | 3.92 |

### 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：本基金本报告期内未持有沪港通股票投资。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 10 名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 3,600  | 1,202,940.00 | 1.01         |
| 2  | 601377 | 兴业证券 | 90,000 | 688,500.00   | 0.58         |



|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 3  | 600030 | 中信证券 | 35,000 | 562,100.00 | 0.47 |
| 4  | 300003 | 乐普医疗 | 30,196 | 541,414.28 | 0.45 |
| 5  | 000920 | 南方汇通 | 30,000 | 434,100.00 | 0.36 |
| 6  | 002142 | 宁波银行 | 22,000 | 366,080.00 | 0.31 |
| 7  | 300031 | 宝通科技 | 11,500 | 242,420.00 | 0.20 |
| 8  | 600172 | 黄河旋风 | 10,000 | 178,800.00 | 0.15 |
| 9  | 002133 | 广宇集团 | 20,000 | 153,800.00 | 0.13 |
| 10 | 600741 | 华域汽车 | 6,000  | 95,700.00  | 0.08 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票细节，应阅读登载于本公司网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 的年度报告正文。

## 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 300285 | 国瓷材料 | 3,949,762.00 | 1.94           |
| 2  | 300003 | 乐普医疗 | 3,553,336.14 | 1.74           |
| 3  | 002133 | 广宇集团 | 3,015,574.00 | 1.48           |
| 4  | 600741 | 华域汽车 | 2,399,380.00 | 1.18           |
| 5  | 600172 | 黄河旋风 | 1,833,298.00 | 0.90           |
| 6  | 002466 | 天齐锂业 | 1,826,534.00 | 0.89           |
| 7  | 002141 | 蓉胜超微 | 1,606,380.00 | 0.79           |
| 8  | 601377 | 兴业证券 | 1,443,300.00 | 0.71           |
| 9  | 002142 | 宁波银行 | 1,165,800.00 | 0.57           |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 1,102,800.00 | 0.54           |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 1,012,200.00 | 0.50           |
| 12 | 300031 | 宝通科技 | 705,325.00   | 0.35           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 13 | 300296 | 利亚德  | 159,500.00 | 0.08 |
| 14 | 601688 | 华泰证券 | 73,300.00  | 0.04 |

注：本项“买入金额”按成交金额填列，不考虑相关费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 300285 | 国瓷材料 | 8,092,967.97 | 3.96           |
| 2  | 002466 | 天齐锂业 | 7,722,093.48 | 3.78           |
| 3  | 002153 | 石基信息 | 3,509,172.07 | 1.72           |
| 4  | 300003 | 乐普医疗 | 3,114,562.21 | 1.53           |
| 5  | 600661 | 新南洋  | 3,067,105.30 | 1.50           |
| 6  | 002133 | 广宇集团 | 3,056,990.00 | 1.50           |
| 7  | 000967 | 盈峰环境 | 2,875,721.04 | 1.41           |
| 8  | 600741 | 华域汽车 | 2,296,706.00 | 1.13           |
| 9  | 600172 | 黄河旋风 | 1,909,966.00 | 0.94           |
| 10 | 300050 | 世纪鼎利 | 1,618,268.00 | 0.79           |
| 11 | 000858 | 五粮液  | 1,607,304.76 | 0.79           |
| 12 | 002141 | 睿胜超微 | 1,502,797.00 | 0.74           |
| 13 | 002142 | 宁波银行 | 820,767.00   | 0.40           |
| 14 | 000920 | 南方汇通 | 796,500.00   | 0.39           |
| 15 | 601377 | 兴业证券 | 722,400.00   | 0.35           |
| 16 | 600129 | 太极集团 | 536,360.00   | 0.26           |
| 17 | 300031 | 宝通科技 | 430,771.00   | 0.21           |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 419,300.00   | 0.21           |
| 19 | 300296 | 利亚德  | 103,500.00   | 0.05           |

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 23,846,489.14 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 44,203,251.83 |

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

**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      | 6,791,160.00   | 5.68         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,324,000.00  | 17.01        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,324,000.00  | 17.01        |
| 4  | 企业债券      | 75,500,499.70  | 63.19        |
| 5  | 企业短期融资券   | 9,975,000.00   | 8.35         |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 28,817,390.38  | 24.12        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 141,408,050.08 | 118.35       |

**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  | 124601 | 14 唐城债   | 100,010 | 10,554,055.30 | 8.83         |
| 2  | 112208 | 14 华邦 01 | 100,000 | 10,518,000.00 | 8.80         |
| 3  | 124853 | 14 淄城运   | 99,990  | 10,512,948.60 | 8.80         |

|   |        |        |         |               |      |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 4 | 124555 | 14 余城建 | 100,000 | 10,511,000.00 | 8.80 |
| 5 | 124505 | 14 嘉市镇 | 100,000 | 10,504,000.00 | 8.79 |

### 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。

### 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国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1

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。

#### 8.11.2

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。

#### 8.11.3 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   | 10,793.79    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,499,252.04 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,988,043.37 |
| 5  | 应收申购款   | 3,246.01     |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 5,501,335.21 |

#### 8.11.4 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  | 128009 | 歌尔转债 | 3,749,760.00 | 3.14         |
| 2  | 110031 | 航信转债 | 3,583,140.00 | 3.00         |
| 3  | 110030 | 格力转债 | 3,414,600.00 | 2.86         |
| 4  | 110032 | 三一转债 | 2,486,700.00 | 2.08         |
| 5  | 113008 | 电气转债 | 1,717,594.30 | 1.44         |
| 6  | 110034 | 九州转债 | 1,574,374.50 | 1.32         |
| 7  | 110033 | 国贸转债 | 1,312,170.00 | 1.10         |
| 8  | 128010 | 顺昌转债 | 983,324.88   | 0.82         |
| 9  | 113010 | 江南转债 | 980,400.00   | 0.82         |
| 10 | 113009 | 广汽转债 | 941,733.20   | 0.79         |
| 11 | 128012 | 辉丰转债 | 539,200.00   | 0.45         |
| 12 | 110035 | 白云转债 | 373,680.00   | 0.31         |
| 13 | 123001 | 蓝标转债 | 15,219.40    | 0.01         |

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

## § 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

| 份额<br>级别   | 持有人<br>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      | 占总份额比<br>例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 双利<br>债券 A | 3,203            | 22,307.12     | 59,409.24 | 0.08%      | 71,390,281.43 | 99.92%     |
| 双利<br>债券 C | 618              | 18,036.25     | 0.00      | 0.00%      | 11,146,401.48 | 100.00%    |
| 合计         | 3,821            | 21,616.35     | 59,409.24 | 0.07%      | 82,536,682.91 | 99.93%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别      | 持有份额总数（份） | 占基金总份额<br>比例 |
|----------------------|-----------|-----------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 双利债券<br>A | 0.00      | 0.00%        |
|                      | 双利债券<br>C | 1,308.01  | 0.01%        |
|                      | 合计        | 1,308.01  | 0.01%        |

### 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                          | 份额级别   | 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<br>投资和研究部门负责人持 | 双利债券 A | 0                 |
|                             | 双利债券 C | 0                 |

|                     |        |   |
|---------------------|--------|---|
| 有本开放式基金             | 合计     | 0 |
| 本基金基金经理持有本开<br>放式基金 | 双利债券 A | 0 |
|                     | 双利债券 C | 0 |
|                     | 合计     | 0 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 双利债券 A        | 双利债券 C        |
|--------------------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日（2014 年 1 月 28 日）基金份额总额 | -             | -             |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 97,938,393.86 | 44,074,975.59 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 43,686,980.69 | 19,480,954.26 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                  | 70,175,683.88 | 52,409,528.37 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -             | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 71,449,690.67 | 11,146,401.48 |

注：其中“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



## § 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、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 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（2011 年 1 月 26 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柒万元整。

### 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。

本报告期内托管人及其高级管理人员无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          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东方证券  | 2      | 68,049,740.97 | 100.00%      | 62,350.42 | 100.00%    | -  |
| 海通证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 财富里昂  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中国中投  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 民生证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 爱建证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 太平洋证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中金公司  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 信达证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 德邦证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华龙证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|
| 万联证券 | 1 | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

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           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券  | 185,201,554.95 | 100.00%      | 8,821,900,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 海通证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 财富里昂  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国泰君安  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 银河证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中国中投  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 民生证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国信证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 爱建证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 光大证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 太平洋证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 广发证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中金公司  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 信达证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 天风证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华创证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 招商证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 德邦证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 华龙证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 36 个交易单元与汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健混合型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金共用。本报告期新增 4 个交易单元，其中新增天风证券 2 个交易单元（1 个上交所交易单元、1 个深交所交易单元），新增太平洋证券 2 个交易单元（1 个上交所交易单元、1 个深交所交易单元）。

汇添富基金管理股份有限公司

2017 年 3 月 29 日