汇添富盈安保本混合型证券投资基金2016年第4季度报告

2016年12月31日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017年1月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富盈安保本混合
交易代码	002419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 19 日
报告期末基金份额总额	4,279,046,304.57 份
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。
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。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2016 年 10 月 1 日 － 2016 年 12 月 31 日 ）
1.本期已实现收益	22,309,297.62
2.本期利润	-83,319,112.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0190
4.期末基金资产净值	4,310,250,940.72
5.期末基金份额净值	1.007

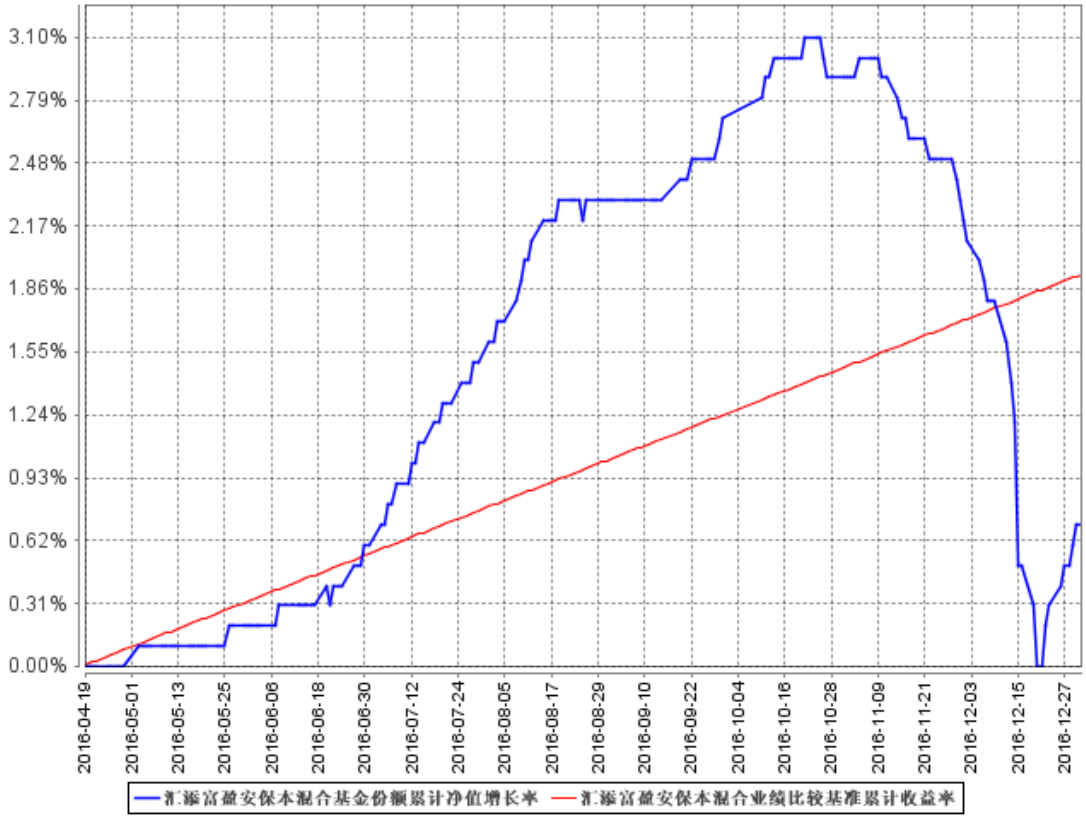
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.95%	0.12%	0.69%	0.01%	-2.64%	0.11%

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

汇添富盈安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：本基金的《基金合同》生效日为 2016 年 4 月 19 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016 年 4 月 19 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾刚	汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定	2016 年 4 月 19 日	-	15 年	国籍：中国。学历：中国科技大学学士，清华大学 MBA。业务资格：基金从业资格。2011 年 11 月加入汇添富基金，现任固定收益投资副总监。2012

	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理，固定收益投资副总监。				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 日至今任汇添富可转换债券的基金经理，2013 年 5 月 29 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 7 天的基金经理，2013 年 6 月 14 日至今任汇添富实业债的基金经理，2013 年 9 月 12 至 2015 年 3 月 31 日任汇添富现金宝货币的基金经理，2013 年 12 月 3 日至今任汇添富双利增强债券的基金经理，2015 年 11 月 26 日至今任汇添富安鑫智选混合的基金经理，2016 年 2 月 17 日至今任汇添富 6 月红定开债的基金经理，2016 年 3 月 16 日至今任汇添富稳健添利定开债的基金经理，

					2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安保本混合的基金经理，2016 年 8 月 3 日至今任汇添富盈稳保本混合的基金经理，2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫保本混合的基金经理，2016 年 12 月 6 日至今任汇添富长添利定开债的基金经理。
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 4 月 19 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 9 月 29 日至今任汇添富保鑫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。

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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在

严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

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

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 8 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度固定资产投资保持弱势，工业产出相对平稳。随着房地产调控效果显现，主要城市商品房销售回落，房地产投资也有所放缓，房地产在经历短期冲高后回落。四季度央行货币政策保持中性偏紧，仅通过公开市场操作和 MLF 来控制短期资金利率。年末资金偏紧以及流动性收紧预期下引发金融去杠杆，造成债券市场 2016 年最后一个月出现剧烈调整，调整幅度堪比 2013 年钱荒，市场一度形成恐慌，收益率曲线整体尤其是利率债曲线创年内新高。股票市场并未脱落震荡格局，低估值的蓝筹股相比中小板股票具有明显的超额收益。流动性冲击和机构赎回导致可转债被大幅抛售，可转债在年内最后一个月也大幅调整，溢价率大幅被压缩，绝对价格开始受债底支撑。报告期内，中债综合财富指数下跌 1.9%，沪深 300 指数上涨 1.7%，可转债指数下跌 3.8%。

四季度债券市场大幅调整，本组合降低了久期和杠杆水平，总体符合保本基金的投资风格。由于债券调整导致安全垫降低，报告期内也减持了权益资产。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内本组合净值收益率为-1.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	72,539,043.72	1.34
	其中：股票	72,539,043.72	1.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,492,854,303.22	82.86
	其中：债券	4,492,854,303.22	82.86
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	414,889,503.88	7.65
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	376,077,528.13	6.94
8	其他资产	66,094,339.51	1.22
9	合计	5,422,454,718.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,964,000.00	0.05
C	制造业	53,533,936.63	1.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	10,263,000.00	0.24
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	6,817.20	0.00

	业		
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	-	-
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	6,611,000.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	72,539,043.72	1.68

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600268	国电南自	1,000,000	9,020,000.00	0.21
2	600572	康恩贝	1,000,000	7,310,000.00	0.17
3	000963	华东医药	100,000	7,207,000.00	0.17
4	600686	金龙汽车	500,000	7,105,000.00	0.16
5	600867	通化东宝	299,981	6,578,583.33	0.15
6	002343	慈文传媒	100,000	4,517,000.00	0.10
7	000915	山大华特	99,940	4,210,472.20	0.10
8	002236	大华股份	299,950	4,103,316.00	0.10
9	002007	华兰生物	99,934	3,572,640.50	0.08
10	600110	诺德股份	300,000	3,198,000.00	0.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	248,575,000.00	5.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	66,479,000.00	1.54
	其中：政策性金融债	66,479,000.00	1.54
4	企业债券	2,399,421,773.00	55.67
5	企业短期融资券	1,166,753,000.00	27.07
6	中期票据	576,399,000.00	13.37
7	可转债（可交换债）	35,226,530.22	0.82

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,492,854,303.22	104.24

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	020146	16 贴债 48	2,500,000	248,575,000.00	5.77
2	041655028	16 康美 CP001	800,000	79,512,000.00	1.84
3	122366	14 武钢债	700,000	70,700,000.00	1.64
4	011698362	16 香雪制药 SCP001	700,000	69,776,000.00	1.62
5	160213	16 国开 13	700,000	66,479,000.00	1.54

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	142,745.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,949,613.23
5	应收申购款	1,980.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,094,339.51

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	10,152,230.00	0.24
2	113009	广汽转债	6,967,200.00	0.16
3	110034	九州转债	4,878,000.00	0.11
4	127003	海印转债	1,005,255.60	0.02

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,447,721,161.96
报告期期间基金总申购份额	9,697,507.66
减:报告期期间基金总赎回份额	178,372,365.05
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	4,279,046,304.57

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富盈安保本混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富盈安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、报告期内汇添富盈安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。

8.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2017 年 1 月 19 日