汇添富多元收益债券型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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：中国银行股份有限公司
送出日期：２０１４年３月２６日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013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

基金简称	汇添富多元收益债券	
基金主代码	470010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月18日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	775,260,705.54份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
下属分级基金的交易代码：	470010	470011
报告期末下属分级基金的份额总额	711,072,360.19份	64,188,345.35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，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上，适度参与权益类资产投资，力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	中债综合指数＊90%＋沪深300指数＊10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	唐州徽
	联系电话	021-28932888	95566
	电子邮箱	service@99fund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95566
传真		021-28932998	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§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	2013年		2012年9月18日（基金合同生效日）-2012年12月31日	
	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
本期已实现收益	52,550,532.42	10,719,884.28	5,151,621.12	4,711,116.64
本期利润	4,137,504.24	8,344,478.45	12,304,971.26	12,300,157.47
加权平均基金份额本期利润	0.0050	0.0482	0.0226	0.0206
本期基金份额净值增长率	0.70%	0.31%	3.30%	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0059	-0.0003	0.0096	0.0077
期末基金资产净值	715,267,288.23	64,171,961.66	243,380,189.28	290,099,734.63
期末基金份额净值	1.006	1.000	1.033	1.031

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2012年9月18日，至本报告期末未满三年，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2013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

汇添富多元收益债券A

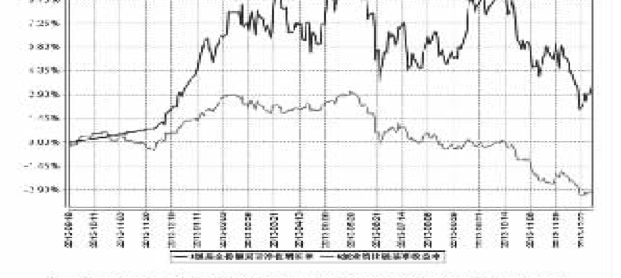
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.40%	0.45%	-2.74%	0.15%	-1.66%	0.30%
过去六个月	-1.87%	0.44%	-3.50%	0.15%	1.63%	0.29%
过去一年	0.70%	0.52%	-4.14%	0.17%	4.84%	0.35%
自基金合同生效日起至今	4.02%	0.46%	-2.96%	0.16%	6.98%	0.30%

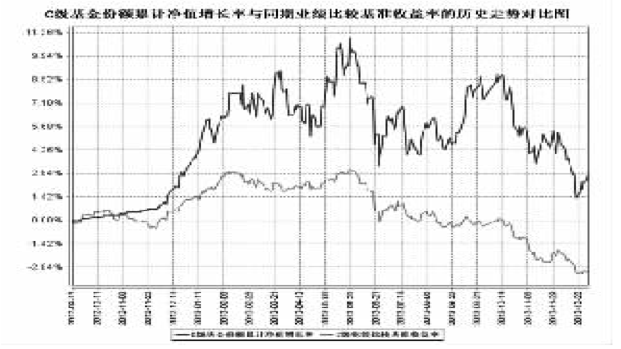
汇添富多元收益债券C

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	-4.43%	0.45%	-2.74%	0.15%	-1.69%	0.30%
过去六个月	-2.06%	0.43%	-3.50%	0.15%	1.44%	0.28%
过去一年	0.31%	0.52%	-4.14%	0.17%	4.45%	0.35%
自基金合同生效日起至今	3.42%	0.46%	-2.96%	0.16%	6.38%	0.30%

注：本基金的《基金合同》生效日为2012年9月18日，至本报告期末未满三年。

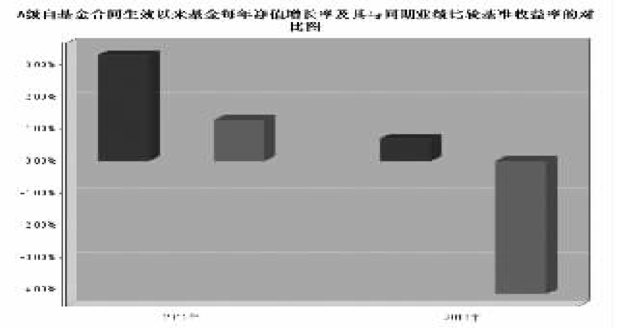
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

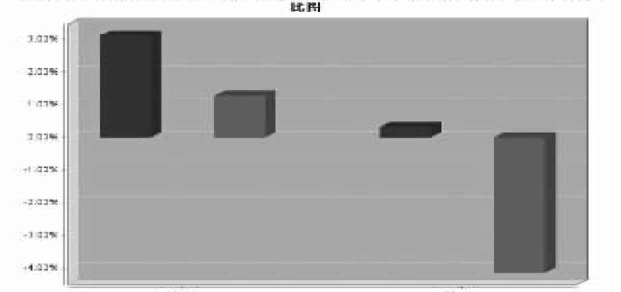




注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2012年9月18日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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





注：1、本基金的《基金合同》生效日为2012年9月18日，至本报告期末未满五年。

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

单位：人民币元

汇添富多元收益债券A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.350	25,893,907.51	1,212,027.03	27,105,934.54	
2012	-	-	-	-	
合计	0.350	25,893,907.51	1,212,027.03	27,105,934.54	

单位：人民币元

汇添富多元收益债券C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.350	2,923,172.97	471,689.93	3,394,862.90	
2012	-	-	-	-	
合计	0.350	2,923,172.97	471,689.93	3,394,862.90	

§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、南方两个分公司，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）与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。在投资管理领域，汇添富已形成公募、专户、国际、养老金四大块业务以及股票、固定收益、被动投资、海外投资、另类投资五大块投资领域协同发展的格局。

截止2013年末，汇添富共管理45只证券投资基金，涵盖股票、指数、QDII、债券、货币市场基金等不同风险收益特征的产品。报告期内，汇添富共发行18只基金产品，包括汇添富理财21天、7天债券基金，汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽30股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富新收益债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场基金。

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有效地贯彻和执行。2013年，汇添富取得了良好的整体投资业绩，在市场震荡起伏的背景下，公司旗下主动型基金基本上都获得正收益，切实为投资者赢得财富增长。

2013年，汇添富专户业务快速发展，在传统专户产品稳健扩容的基础上，还积极创新，不仅开发出基本面对冲、量化对冲等新型专户产品，并且实现了对冲策略的多元化。在2013年结构分化的复杂市场行情下，汇添富对冲系列专户产品依然为客户赢得了较好的正收益。

2013年，汇添富国际业务取得突破进展。2013年2月，汇添富与全球著名指数公司STOXX签署合作协议，宣布在中国发行的汇添富基金ETF产品获得了欧洲蓝筹股指数——欧洲STOXX 50指数（EURO STOXX 50 Index）的独家授权。2013年7月，在第二只RQFII产品——添富共享沪深300指数ETF成功上市之际，汇添富资产管理（香港）有限公司还同步推出了其ETF系列产品的品牌——C-Shares。

2013年，汇添富电子商务业务实现跨越式发展。公司成立了电子金融总部，电商客户及资产保有量节节上升。汇添富在2013年不仅升华优化了已为投资者所熟悉的现金宝账户的收益及功能，更连续推出两只互联网客户专属的纯电商货币基金产品——汇添富“现金宝”和“全额宝”货币基金，并以开创基金电商直销新纪录和持续优异的投资业绩，成为互联网金融新时代一道耀眼夺目的亮丽风景线。

2013年，汇添富持续开展贴心的投资者服务与教育工作。公司围绕向“现代财富管理机构”转型的思路，从不同类型客户的切身需求出发，大力建设投顾式客户服务体系；同时，公司进一步着力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2013年，汇添富社会责任事业进一步深入开展。“河流·孩子”助学计划启动第六季活动，公司公益基金会捐资在湖北省恩施州利川市忠路镇建设“添富小学”；为优秀乡村教师赴提供国内外知名教育机构的师资培训；在北京和上海举行“添富乐跑，爱的力量”系列公益跑活动，为添富小学贫困学生筹款捐赠冬日保暖套装。同时，汇添富还着力开展医疗救助、结对帮扶、国防拥军等社会公益活动。凭借慈善公益事业上的长期坚持和突出贡献，2013年11月，汇添富基金“河流·孩子”公益助学计划荣获“2013温暖金融 陆家嘴年度金融公益榜——年度温暖奖”。

展望2014年，行业转型发展的大变革将进一步深化，整个财富管理行业进入大混业竞争时代，互联网金融的崛起既是机遇更是挑战。汇添富基金将始终保持积极的心态，大力创新、锐意进取，积极把握机会，切实以“客户至上，做好优质服务”为己任，推动各项业务战略布局有效落实，为中国基金业的繁荣发展做出积极贡献。

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	汇添富理财14天的基金经理助理，汇添富理财30天、理财60天、理财28天、理财21天、理财7天、汇添富多元收益、可转换债券、实业债券、现金宝货币、双利增强债券的基金经理，固定收益投资副总监。	2012年9月18日	-	12年	国籍：中国。学历：中国科技大学学士，清华大学MBA。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：曾在红塔证券、汉唐证券、华宝兴业基金负责宏观经济和债券的研究、上海电气集团财务公司资产管理部任经理助理，2008年5月15日至2010年2月5日任华富基金公司华富货币基金的基金经理，2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强债券基金的基金经理，2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报债券基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金任金融工程部高级经理，现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至今任汇添富理财30天基金的基金经理，2012年6月12日至今任汇添富理财60天基金的基金经理，2012年7月10日至今任汇添富理财14天基金的基金经理助理，2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理，2012年10月18日至今任汇添富理财28天基金的基金经理，2013年1月24日至今任汇添富理财21天基金的基金经理，2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2013年5月29日至今任汇添富理财7天基金的基金经理，2013年6月14日至今任汇添富实业债基金的基金经理，2013年9月12至今任汇添富现金宝货币基金的基金经理，2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理。

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 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、投资交易监控周报、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。当发生风格相似或同一投资经理管理的投资组合之间业绩表现差异超过5%等情形时，将进行专项分析。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。公司投资交易行为监控体系由集中交易室、投资研究部、稽核监察部和金融工程部组成，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监控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他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，对其进行了95%的置信区间，假设差价率为0的分布检验以及差价率均值的分析。分析结果表明，不同时间窗口下，公司各组合间买卖价差不显著，差价率均值小于1%。

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成交量5%的交易次数共14次，其中因指数基金建仓及成份股调整发生8次、因专户到期清盘发生4次、因基金流动性需要发生1次、因专户现金分红需要发生1次，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

2013年中国经济开局偏弱，中期企稳略为好转。6月份李总理表示要守住就业和通胀这两条底线，市场理解为政府对GDP的容忍度大大提高，将着手开展更加深入的改革，而以往过于宽松的货币环境也积累了一些问题，新一届政府转变经济增长方式的担子更显重要和艰巨。从国内的数据看，消费增速和进出口略有下滑，投资增速保持在20%的较高水平，国际资本净流入，通胀最终处于年初预期的偏低位置，6月份资金偏紧和央行引导调控非标相关联，在短期利率大幅上升的情况下，实体经济所受的冲击不大。13年中国所处的外部环境整体上优于12年，欧洲终于在2季度实现了正增长，美国在新能源革命的支持下制造业回流，新技术继续保持领先，失业率显著好转，拉开了逐步退出QE的序幕，日本继续强势推行宽松政策，而新兴市场国家中风险凸显，可能会触发金融动荡，经济增速多数回调，政策上保持谨慎。

全年债券市场以6月份为分界点，上半年经济略弱，通胀低于预期，资金面宽松，银行理财产品大举买债，助涨债市，以至于二季度的一些政策转向和市场因素都未能引起足够重视，信用债涨幅远大于利率债，与资金面相关度较高的AAA短融收益率一直保持在4.0%上下，6月份资金利率暴涨，融资难度较大，央行政策引导意图被市场所理解，此后资金面一直是时紧时松的紧平衡状态，而利率市场化的实质性推动、银行和保险追逐高收益的非标产品，6月份开始的信用风险压力均对下半年债市收益率的平坦化上移有很大的推动，代表性的5年政策性金融债从二季度的3.9%大幅攀升至5.8%，5年AA企业债从5.5%升至7.6%，下半年债券一级市场供应量较高，各类机构新增需求减少，供需失衡进一步加剧了跌势。

股票市场表现为小盘成长股大涨而大盘股疲弱下跌的结构性分化行情，传媒、TMT等板块涨幅巨大；与之关联的可转债部分，大盘转债一季度略涨，随后持续走弱，有基本面支持的小盘转债出现了两拨小行情。

本基金13年初快速增持可转债，获得了较好的收益，但二季度未及时兑现，净值有所回落，三季度末适度增持了部分信用债，四季度受交易所估值与可转债下跌的影响，净值大幅回落，全年收益率0.7%，表现不佳，净值波动较大，需要认真反思，应加强投资管理的主动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本年度本基金A级净值收益率为0.70%，B级净值收益率为0.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年预计全球经济进一步复苏，美国的经济增长更为确定，新兴市场国家中应对QE退出的能力有差异，金融动荡在小范围内演变；而对于国内，我们判断货币政策继续沿用13年的方式，通过紧平衡来逐步化解风险，在放开管制的思路下，实体经济进一步趋稳回升的基础更加坚实；我们看淡GDP增速的影响力，我们对CPI的预期偏中性，全年的运行区间大体在3%上下，改革的主题更为突出，预期会有较多的政策出台，给市场注入活力；对经济的有限乐观判断下，债市的整体风险不大，但货币政策可能在信用风险演化之后只有2-3次降准的预期，目前的债市已处于中性区间，机会同样有限。2013年即将还本的信用债及信托总量都达到新的高点，信用风险事件可能接近暴露的边缘，信用利差扩大的趋势明确，有必要重视并早作安排。

14年权益市场延续13年结构性行情的概率较大，我们考虑基于成长和中线波段来运作，提高灵活性；可转债部分年初的小盘股行情后，大盘的机会在于下半年债券平价和股市提振的双重支持。

我们将综合分析本基金的份额变动，提前做好债券与存款之间的配置计划。本基金的组合流动性管理特征不同于普通货币基金，在总结前期经验教训的基础上，我们将更加明确地注重流动性，做好份额变动的分析和预测，合理搭配协存、短融、浮息债等品种，力争提高组合收益。

4.6 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历，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。

4.7 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，基金收益分配每年至多12次、最少2次；每次基金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40%。基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。

本基金于2013年1月23日实施利润分配，每10份基金份额派发红利0.05元人民币。

本基金于2013年11月6日实施利润分配，每10份基金份额派发红利0.3元人民币。

本基金于2014年1月20日实施利润分配，每10份A类基金份额派发红利0.03元人民币。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对汇添富多元收益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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）、投资组合报告等数据真实、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、方侃于2014年3月24日签字出具了安永华明（2014）审字第60466941_B26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：汇添富多元收益债券型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：		
银行存款	32,777,910.48	149,754.79
结算备付金	37,593,064.21	2,028,060.53
存出保证金	202,657.73	250,000.00
交易性金融资产	1,170,255,334.87	715,462,156.38
其中：股票投资	93,308,933.80	53,123,419.58
基金投资	-	-
债券投资	1,073,496,401.07	628,283,736.80
资产支持证券投资	3,450,000.00	34,055,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	3,456,197.81
应收利息	14,884,604.77	5,193,450.76
应收股利	-	-
应收申购款	15,464.23	525,326.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,255,729,036.29	727,064,946.30
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债：		
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	454,804,184.79	190,021,706.86
应付证券清算款	20,284,192.83	-
应付赎回款	210,973.57	2,462,919.01
应付管理人报酬	472,129.88	375,142.01
应付托管费	134,894.25	107,183.44
应付销售服务费	22,384.17	110,170.01
应付交易费用	10,578.71	68,976.66
应交税费	-	-
应付利息	150,320.56	67,878.47
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,127.64	371,045.93
负债合计	476,289,786.40	193,585,022.39
所有者权益：		
实收基金	775,260,705.54	516,901,625.26
未分配利润	4,178,544.35	16,578,298.65
所有者权益合计	779,439,249.89	533,479,923.91
负债和所有者权益总计	1,255,729,036.29	727,064,946.30

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.005元，基金份额总额775,260,705.54份，其中下属A类基金份额参考净值1.006元，份额总额711,072,360.19份；下属C类基金份额参考净值1.000元，份额总额64,188,345.35份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富多元收益债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日
一、收入	39,876,978.48	29,147,686.05
1.利息收入	46,279,234.29	13,887,710.96
其中：存款利息收入	658,284.91	7,556,213.43
债券利息收入	44,713,343.47	4,625,601.65
资产支持证券利息收入	856,040.97	381,883.53
买入返售金融资产收入	51,564.94	1,324,012.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	43,781,016.07	317,373.83
其中：股票投资收益	19,967,404.47	228,118.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	21,751,266.28	89,255.41
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	2,062,345.32	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-50,788,434.01	14,742,390.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	605,162.13	200,210.29
减：二、费用	27,394,995.79	4,542,557.32
1.管理人报酬	7,512,432.41	2,362,250.94
2.托管费	2,146,409.26	674,928.83
3.销售服务费	758,725.12	705,403.76
4.交易费用	1,411,107.86	89,424.32
5.利息支出	15,064,968.37	488,402.51
其中：卖出回购金融资产支出	15,064,968.37	488,402.51
6.其他费用	501,352.77	222,146.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	12,481,982.69	24,605,128.73

注：本基金合同于2012年9月18日生效，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2012年12月31日数据，特此说明。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富多元收益债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	516,901,625.26	16,578,298.65	533,479,923.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,481,982.69	12,481,982.69
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）	258,359,080.28	5,619,060.45	263,978,140.73
其中：1.基金申购款	3,057,781,394.48	205,346,771.55	3,263,128,166.03
2.基金赎回款	-2,799,422,314.20	-199,727,711.10	-2,999,150,025.30
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）	-	-30,500,797.44	-30,500,797.44
五、期末所有者权益（基金净值）	775,260,705.54	4,178,544.35	779,439,249.89
项目	上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012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）	1,988,397,695.23	-	1,988,397,695.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,605,128.73	24,605,128.73
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）	-1,471,496,069.97	-8,026,830.08	-1,479,522,900.05
其中：1.基金申购款	98,110,047.01	1,040,234.23	99,150,281.24
2.基金赎回款	-1,569,606,116.98	-9,067,064.31	-1,578,673,181.29
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）	516,901,625.26	16,578,298.65	533,479,923.91

注：本基金合同于2012年9月18日生效，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2012年12月31日数据，特此说明。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

林利军　　　　陈灿辉　　　　王小练
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

汇添富多元收益债券型证券投资基金（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［2012］428号文《关于核准汇添富多元收益债券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）作为发起人于2012年8月13日至2012年9月14日向社会公开募集，基金合同于2012年9月18日正式生效。首次设立募集规模为1,988,397,695.23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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款），以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，也可直接从二级市场上买入股票和权证。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数×90%＋沪深300指数×10%。

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2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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》、《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2013年12月31日的财务状况以及2013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、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［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，继续免征营业税和企业所得税；

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。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［2002］128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

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。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	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
东航金戎控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	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的关键管理人员

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券股份有限公司	858,964,367.47	100.00%	73,136,490.34	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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券股份有限公司	1,278,290,677.27	100.00%	294,026,682.22	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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	73,268,859,000.00	100.00%	6,965,832,000.00	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 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	1,167,436.20	100.00%	6,366.07	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	65,872.19	100.00%	64,357.43	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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,512,432.41	2,362,250.94
其中：支付销售机构的客户维护费	1,533,358.17	662,276.34

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.70%÷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

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,146,409.26	674,928.83

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%÷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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C	合计
东方证券股份有限公司	-	15,516.35	15,516.35
汇添富基金管理股份有限公司	-	60,552.79	60,552.79
中国银行股份有限公司	-	258,013.45	258,013.45
合计	-	334,082.59	334,082.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C	合计
东方证券股份有限公司	-	37,517.59	37,517.59
汇添富基金管理有限公司	-	48,641.56	48,641.56
中国银行股份有限公司	-	353,294.09	353,294.09
合计	-	439,453.24	439,453.24

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×0.40%÷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类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	30,101,970.41	10,380,665.48	-	-	66,500,000.00	71,648.22

注：本基金上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月18日（基金合同生效日）至2012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
中国银行股份有限公司	32,777,910.48	162,580.83	149,754.79	240,172.82

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，2013年度获得的利息收入为人民币460,771.93元（2012年度：人民币39,980.02元），2013年末结算备付金余额为人民币37,593,064.21元（2012年末：人民币2,028,060.53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。

7.4.9 期末（2013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：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

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2013年12月31日止，本基金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108,804,316.79元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1280313	12农房债	2014年1月3日	97.17	137,000	13,312,290.00
1380031	13清河投资债	2014年1月3日	97.11	300,000	29,133,000.00
1380039	13南平高速债	2014年1月3日	96.44	300,000	28,932,000.00
1280308	12兴城投	2014年1月2日	97.21	11,000	1,069,310.00
1280312	12沪嘉开债	2014年1月2日	97.96	100,000	9,796,000.00
1280496	12宜城投债	2014年1月7日	95.55	300,000	28,665,000.00
合计				1,148,000	110,907,600.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013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证券款余额296,000,000.00元，于2014年1月2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证券款余额49,999,868.00元，于2014年1月2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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	93,308,933.80	7.43
	其中：股票	93,308,933.80	7.43
2	固定收益投资	1,076,946,401.07	85.76
	其中：债券	1,073,496,401.07	85.49
	资产支持证券	3,450,000.00	0.27
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	70,370,974.69	5.60
7	其他各项资产	15,102,726.73	1.20
8	合计	1,255,729,036.29	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	61,158,933.80	7.85
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	3,746,000.00	0.48
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,936,000.00	3.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,468,000.00	0.44
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	93,308,933.80	11.97

8.3 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

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	002344	海宁皮城	1,200,000	24,936,000.00	3.20
2	601989	中国重工	3,868,580	21,702,733.80	2.78
3	600085	同仁堂	850,000	18,190,000.00	2.33
4	600422	昆明制药	550,000	12,974,500.00	1.66
5	000915	山大华特	270,000	8,291,700.00	1.06
6	600697	欧亚集团	200,000	3,746,000.00	0.48
7	002672	东江环保	100,000	3,468,000.00	0.44

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站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	600886	国投电力	172,676,253.10	32.37
2	601989	中国重工	38,854,206.43	7.28
3	600422	昆明制药	36,830,681.56	6.90
4	002344	海宁皮城	36,195,534.74	6.78
5	600085	同仁堂	35,255,908.02	6.61
6	600028	中国石化	34,769,684.23	6.52
7	300124	汇川技术	33,568,142.26	6.29
8	000937	冀中能源	28,403,997.84	5.32
9	002007	华兰生物	22,086,217.60	4.14
10	000425	徐工机械	19,951,159.00	3.74
11	300039	上海凯宝	14,054,294.46	2.63
12	601888	中国国旅	13,339,845.08	2.50
13	002033	丽江旅游	9,646,632.38	1.81
14	002004	华邦颖泰	9,491,026.64	1.78
15	002672	东江环保	9,036,248.48	1.69
16	600697	欧亚集团	8,749,976.84	1.64
17	600062	华润双鹤	6,354,583.39	1.19
18	000915	山大华特	3,548,142.10	0.67
19	002299	圣农发展	2,988,505.82	0.56
20	000888	峨眉山A	2,613,277.88	0.49

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	600886	国投电力	172,928,592.40	32.42
2	300124	汇川技术	42,277,657.75	7.92
3	600028	中国石化	40,449,478.65	7.58
4	600422	昆明制药	29,260,342.48	5.48
5	000937	冀中能源	22,690,591.23	4.25
6	002007	华兰生物	21,836,942.26	4.09
7	000425	徐工机械	20,927,930.80	3.92
8	600085	同仁堂	20,593,528.60	3.86
9	002344	海宁皮城	19,145,082.11	3.59
10	300039	上海凯宝	15,562,061.40	2.92
11	600016	民生银行	15,475,854.41	2.90
12	601888	中国国旅	14,250,656.68	2.67
13	600036	招商银行	13,456,754.23	2.52
14	601989	中国重工	12,664,042.30	2.37
15	601318	中国平安	8,980,316.00	1.68
16	002004	华邦颖泰	8,891,168.03	1.67
17	002033	丽江旅游	8,719,500.41	1.63
18	000888	峨眉山A	8,674,329.85	1.63
19	600697	欧亚集团	6,068,266.80	1.14
20	002672	东江环保	5,890,408.90	1.10

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	545,041,552.43
卖出股票收入（成交）总额	525,453,274.57

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	599,059.80	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,722,000.00	5.10
	其中：政策性金融债	39,722,000.00	5.10
4	企业债券	672,532,000.00	86.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	360,643,341.27	46.27
8	其他	-	-
9	合计	1,073,496,401.07	137.73

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	110018	国电转债	830,060	85,620,689.00	10.98
2	110023	民生转债	800,000	77,224,000.00	9.91
3	127001	海直转债	367,400	45,914,712.80	5.89
4	122564	12椒江债	400,000	41,600,000.00	5.34
5	110015	石化转债	400,000	38,144,000.00	4.89

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	061202001	12通元1A	500,000	3,450,000.00	0.44

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证券。

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

8.10.1 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。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

8.10.3 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。

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	202,657.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,884,604.77
5	应收申购款	15,464.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,102,726.73

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	110018	国电转债	85,620,689.00	10.98
2	110023	民生转债	77,224,000.00	9.91
3	127001	海直转债	45,914,712.80	5.89
4	110015	石化转债	38,144,000.00	4.89
5	113003	重工转债	31,985,154.40	4.10
6	128001	泰尔转债	17,225,235.07	2.21
7	110012	海运转债	11,991,050.00	1.54
8	110022	同仁转债	11,244,600.00	1.44

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中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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富多元收益债券A	2,129	333,993.59	458,704,455.46	64.51%	252,367,904.73	35.49%
汇添富多元收益债券C	1,062	60,441.00	4,712,636.01	7.34%	59,475,709.34	92.66%
合计	3,191	242,952.27	463,417,091.47	59.78%	311,843,614.07	40.22%

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）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富多元收益债券A	685,144.14	0.10%
	汇添富多元收益债券C	815,780.57	1.27%
	合计	1,500,924.71	0.19%

注：1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

2）该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为50万份至100万份（含）。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
基金合同生效日（2012年9月18日）基金份额总额	942,985,511.66	1,045,412,183.57
本报告期期初基金份额总额	235,584,927.14	281,316,698.12
本报告期基金总申购份额	2,622,482,342.08	435,299,052.40
减：本报告期基金总赎回份额	2,146,994,909.03	652,427,405.17
本报告期期末基金份额总额	711,072,360.19	64,188,345.35

注：表内“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

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

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、《汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》于2013年1月24日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
2、基金管理人2013年2月8日公告，增聘曾刚先生担任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理，王珏池先生不再担任该基金的基金经理。
3、基金管理人2013年2月8日公告，增聘陈加荣先生担任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理，陆文磊先生不再担任该基金的基金经理。
4、基金管理人2013年2月8日公告，增聘陈加荣先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，王珏池先生不再担任该基金的基金经理。
5、基金管理人2013年3月30日公告，增聘梁珂先生担任汇添富可转换债券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。
6、《汇添富消费行业股票型证券投资基金基金合同》于2013年5月3日正式生效，朱晓亮先生任该基金的基金经理。
7、基金管理人2013年5月11日公告，王栩先生不再担任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理，由周睿先生单独管理该基金。
8、基金管理人2013年5月11日公告，苏竞先生不再担任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理，由王栩先生单独管理该基金。
9、《汇添富理财7天债券型证券投资基金基金合同》于2013年5月29日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
10、《汇添富实业债债券型证券投资基金基金合同》于2013年6月14日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
11、《汇添富美丽30股票型证券投资基金基金合同》于2013年6月25日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理。
12、《汇添富高息债债券型证券投资基金基金合同》于2013年6月27日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
13、基金管理人2013年8月1日公告，增聘汤丛珊女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，王珏池先生不再担任该基金的基金经理。
14、《中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
15、《中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
16、《中证能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
17、《中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
18、《汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年9月6日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
19、《汇添富现金宝货币市场基金基金合同》于2013年9月12日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
20、基金管理人2013年9月16日公告，增聘汪洋先生担任中证主要消费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。
21、基金管理人2013年9月16日公告，增聘汪洋先生担任中证医药卫生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2013年9月16日公告，增聘汪洋先生担任中证能源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。
23、基金管理人2013年9月16日公告，增聘汪洋先生担任中证金融地产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。
24、《汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》于2013年11月6日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
25、《汇添富互利分级债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月6日正式生效，陆文磊先生任该基金的基金经理。
26、基金管理人2013年11月11日公告，增聘汪洋先生担任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，吴振翔先生不再担任该基金的基金经理。
27、基金管理人2013年11月11日公告，增聘汪洋先生担任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，吴振翔先生不再担任该基金的基金经理。
28、《汇添富安心中国债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月22日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。
29、基金管理人2013年11月23日公告，增聘朱晓亮先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生、叶从飞先生共同管理该基金，苏竞先生不再担任该基金的基金经理。
30、基金管理人2013年11月23日公告，增聘叶从飞先生担任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，苏竞先生不再担任该基金的基金经理。
31、《汇添富双利增强债券型证券投资基金基金合同》于2013年12月3日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
32、《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》于2013年12月10日正式生效，梁珂先生任该基金的基金经理。
33、《汇添富全额宝货币市场基金基金合同》于2013年12月13日正式生效，陆文磊先生、汤丛珊女士任该基金的基金经理。
34、2013年3月17日中国银行股份有限公司公告，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。2013年6月1日中国银行股份有限公司公告，自2013年5月31日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

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、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（2012年9月18日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应支付当期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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	858,964,367.47	100.00%	772,361.50	100.00%	-

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	1,278,290,677.27	100.00%	73,268,859,000.00	100.00%	-	-

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、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

汇添富基金管理股份有限公司
2014年3月26日