

汇添富双利增强债券型证券投资基金

[2015]第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

基金管理人的董事会有权根据所载资料不适当做出裁决,误导或误导他人或重大遗漏,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。

基金合同生效日:2013年12月3日

报告期末基金份额总额:266,916,171.79份

投资目标:本基金主要投资于债券资产,通过精选信用债券,并适度参与股票市场,力争在控制风险的前提下,保持资产流动性。

投资策略:本基金的固定收益类资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于信用债券的比例不低于基金资产的60%;股票资产的投资比例不超过基金资产的10%。本基金将通过严格的风险控制和科学的资产配置,在保证基金资产安全的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。

风险收益特征:本基金为债券型基金,其预期风险及预期收益水平低于货币市场基金,高于混合型基金及股票型基金。

基金经理:王军伟(本基金基金经理)、陈晓东(本基金基金经理)

本报告期内:2015年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	35,256,499.35	8.00
其中:股票		35,256,499.35	8.00
2	固定收益投资	382,540,996.37	90.97
其中:债券		382,540,996.37	90.97
3	贵金属投资	-	-
4	银行存款和结算备付金投资	-	-
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	2,539,073.49	0.58
7	其他资产	20,444,201.17	4.64
8	合计	440,799,760.38	100.00

5.2 报告期末行业分类的股票投资组合

序号	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	-	-	-
C 制造业	31,693,156.75	10.30	
D 电力、热力、燃气及水生产供应业	-	-	-
E 建筑业	-	-	-
F 铁路、船舶、航空航天和其他运输设备制造业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
H 宿舍和餐饮业	-	-	-
J 信息传输、软件和信息技术服务业	3,592,342.60	1.17	
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	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	36,256,499.35	11.47	

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

汇添富双利增强债券A 汇添富双利增强债券C

1. 本期已实现收益 -992,567.76 -41,798.02

2. 本期利润 -7,749,070.17 -1,226,871.13

3. 加权平均基金份额本期利润 -0.0298 -0.0263

4. 期末基金资产净值 304,893,167.27 2,309,106.76

5. 期末基金份额净值 1.196 1.201

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平均基金份额变动。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,即未扣除申购费用后的余额。

3. 所述基金净值是指基金份额净值,即每份基金份额的净资产值。

3.2 报告期内基金净值增长率及其与同期行业平均比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ① - ③ ② - ④

过去三个月 -1.40% 0.63% 1.17% 0.01% -25.7% 0.64%

注:本基金对定期报告中所列示的基金净值增长率及其与同期行业平均比较基准收益率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金净值增长率减去同期银行存款利率后除以报告期初至报告期末的同期行业平均比较基准收益率。

3.3 报告期内基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ① - ③ ② - ④

过去三个月 -0.49% 0.63% 1.17% 0.01% -21.0% 0.64%

注:本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

3.4 报告期内基金资产净值增长率与同期行业平均比较基准净值增长率的比较

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

汇添富双利增强债券A 汇添富双利增强债券C

1. 本期资产净值增长率 -0.49% -0.01%

2. 同期比较基准净值增长率 -0.02% -0.02%

3. 两者净值增长率差异及原因 -0.47% -0.01%

注:1.本期资产净值增长率指报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间基金资产净值增长率;同期比较基准净值增长率指同期银行存款利率加同期比较基准收益率。

2. 本期资产净值增长率=报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间基金资产净值增长率-同期比较基准净值增长率。

3. 两者净值增长率差异及原因=本期资产净值增长率-同期比较基准净值增长率。

4. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

5. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

6. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

7. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

8. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

9. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

10. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

11. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

12. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

13. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

14. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

15. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

16. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

17. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

18. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

19. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

20. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

21. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

22. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

23. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

24. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

25. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

26. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

27. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

28. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

29. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

30. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

31. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

32. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

33. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

34. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

35. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

36. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

37. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

38. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

39. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

40. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

41. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

42. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。

43. 本基金对定期报告中所列示的基金资产配置比例及其与同期行业平均比较基准资产配置比例的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产配置比例减去同期行业平均比较基准资产配置比例。

44. 本基金对定期报告中所列示的基金资产净值增长率及其与同期行业平均比较基准净值增长率的比较,是根据报告期初至报告期末的基金资产净值增长率减去同期行业平均比较基准净值增长率。