汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年第三季度报告

2018年9月30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

报告送出日期：2018年10月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

2.1基金产品情况

基金简称	汇添富深证300ETF联接
交易代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月28日
报告期末基金份额总额	55,320,114.45份
投资目标	通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证300交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，并不参与目标ETF的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	汇添富深证300ETF
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月16日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年11月24日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化
投资策略	本基金主要采取完全复制法。正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%
业绩比较基准	深证300指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-159,812.16
2.本期利润	-5,908,333.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1109
4.期末基金资产净值	63,174,378.07
5.期末基金份额净值	1.1420

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。

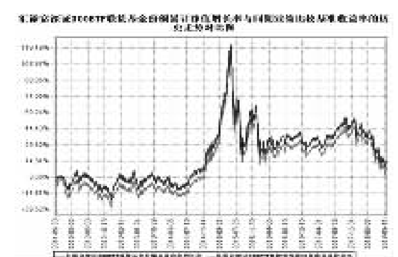
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2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	-9.01%	1.37%	-9.58%	1.39%	0.57%	-0.02%

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（2011年9月28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		
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理、汇添富恒生指数分级（QDII）基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富中证环境治理指数（LOF）基金、汇添富优选回报混合基金、汇添富中证港股通高股息投资指数（LOF）基金的基金经理。	2015年1月6日	-	11年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理，2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级（QDII）基金的基金经理，2015年1月6日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势混合基金的基金经理，2016年12月29日至今任汇添富中证环境治理指数（LOF）基金的基金经理，2017年5月18日至今任汇添富优选回报混合基金的基金经理，2017年11月24日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数（LOF）基金的基金经理。
过蓓蓓	汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证生物科技指数（LOF）基金、汇添富中证中药指数（LOF）基金、汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）基金的基金经理。	2015年8月18日	-	7年	国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015年8月3日至今任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理，2015年8月18日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技指数（LOF）基金的基金经理，2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数（LOF）基金的基金经理，2018年5月23日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）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，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、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3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

2018年三季度沪深300指数下跌2.05%，创业板指下跌12.16%，恒生指数下跌4.03%。全球贸易争端升级、新兴市场货币危机、美联储加息是影响三季度全球市场的主要因素。美国工业产出、ISM制造业和非制造业PMI等数据均显示强劲的增长动能，而通胀相对保持稳定，导致美元相对走强，全球范围内资金在不同资产流动带来压力，中美利差不断收窄，新兴市场资金流出增大。

三季度，金融去杠杆对A股的负面影响边际钝化，紧信用的环境得以改善，但信用放松的滞后效应导致三季度并未出现明显的融资上升，非金融企业盈利下滑短期尚未得到抑制，预计四季度A股市场还将面临企业下调盈利预期的压力。

从宏观经济基本面来看，9月以来生产数据依旧偏弱，发电耗煤量增速继续为负且扩大。汽车批零销量不见起色对社会零售品消费增速仍然是制约，海外油价不断攀升带来CPI增速回升压力。投资方面，房地产投资继续回落，基建与制造业投资增速改善，且将成为四季度支撑投资的最关键因素。9月下旬，促销费、降税费改革政策细则落地，未来执行力度能否超市场预期将成为影响风险溢价的焦点。四季度，外部的贸易摩擦、美联储加息对新兴市场冲击等还需观察，我国国内也做出相应对冲措施来稳定投资者预期，改善风险偏好，对市场整体仍需要维持谨慎。

本基金在报告期内遵循了指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，股票投资仓位在考察期内始终保持在90%～95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金日常管理中非常重视风险管理，对股票和现金头寸严格管理、实时监控，基本实现了基金平稳运作管理的目的。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.1420元；本报告期基金份额净值增长率为-9.01%，业绩比较基准收益率为-9.58%。

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	912,622.35	1.44
	其中：股票	912,622.35	1.44
2	基金投资	58,739,531.96	92.84
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	3,575,803.84	5.65
8	其他资产	42,255.34	0.07
9	合计	63,270,213.49	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	29,045.04	0.05
B	采矿业	2,069.00	0.00
C	制造业	542,528.18	0.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,839.00	0.01
E	建筑业	5,500.50	0.01
F	批发和零售业	29,060.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	4,294.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,372.12	0.14
J	金融业	77,974.94	0.12
K	房地产业	68,775.09	0.11
L	租赁和商务服务业	20,648.48	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,002.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,686.60	0.02
R	文化、体育和娱乐业	17,853.00	0.03
S	综合	974.40	0.00
	合计	912,622.35	1.44

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	000651	格力电器	1,300	52,260.00	0.08
2	000858	五粮液	500	33,975.00	0.05
3	000002	万科A	1,100	26,730.00	0.04
4	002415	海康威视	900	25,866.00	0.04
5	000001	平安银行	2,260	24,973.00	0.04
6	300498	温氏股份	1,004	23,312.88	0.04
7	000725	京东方A	6,900	21,735.00	0.03
8	002027	分众传媒	2,048	17,428.48	0.03
9	002230	科大讯飞	450	12,856.50	0.02
10	002304	洋河股份	100	12,800.00	0.02

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	深300ETF	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公司	58,739,531.96	92.98

5.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

5.12投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

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。

5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,234.54
2	应收证券清算款	18,408.85
3	应收股利	-
4	应收利息	649.17
5	应收申购款	21,962.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,255.34

5.12.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5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的情况。

§6开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	51,406,320.38
报告期期间基金总申购份额	6,409,710.40
减：报告期期间基金总赎回份额	2,495,916.33
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	55,320,114.45

注：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。

§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影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年7月1日至2018年9月30日	14,982,768.95	-	-	14,982,768.95	27.08%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接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。

9.2存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

9.3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

2018年10月26日

汇添富实业债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30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：2018年10月26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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	汇添富实业债债券	
交易代码	000122	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月14日	
报告期末基金份额总额	65,924,578.84份	
投资目标	在严格管理风险和保持资产流动性的基础上，努力实现资产的长期稳健增值。	
投资策略	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%；其中对实业债的投资比例不低于债券类资产的80%。实业债指以生产制造和基础设施为主业的企业所发行的债券，包括公司债、企业债（含城投债）、可转换债券、可分离债券、短期融资券（不含金融企业短期融资券）、中期票据和中小企业私募债等；本基金持有的现金或到期日在一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	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
下属分级基金的交易代码	000122	000123
报告期末下属分级基金的份额总额	46,858,801.84份	19,065,777.00份

§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（2018年7月1日－2018年9月30日）	
	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
1. 本期已实现收益	289,721.41	86,238.55
2. 本期利润	575,125.41	193,892.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0117	0.0102
4. 期末基金资产净值	51,541,353.38	20,410,681.21
5. 期末基金份额净值	1.100	1.071

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。

3.2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

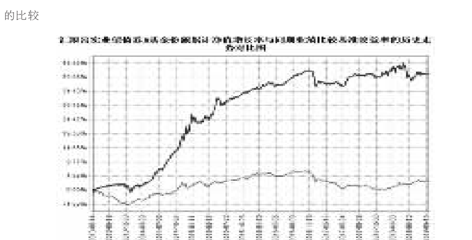
汇添富实业债债券A

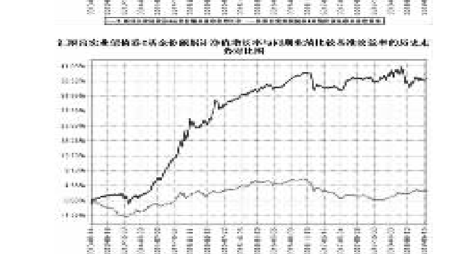
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.10%	0.14%	0.57%	0.07%	0.53%	0.07%

汇添富实业债债券C

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	1.04%	0.14%	0.57%	0.07%	0.47%	0.07%

3.2.2自基金合同生效以来基金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（2013年6月14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。

§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、添富年年益定开混合基金、添富熙和混合基金、汇添富达欣混合基金的基金经理，现金管理部总经理。	2013年6月14日	-	17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。从业经历：2008年5月15日至2010年2月5日任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日任华富强化回报基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金，现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理，2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理，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2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理，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2015年3月31日任汇添富理财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日至2015年3月31日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，2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理，2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理，2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放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8月3日至今任汇添富盈稳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12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理，2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理，2018年2月11日至今任汇添富熙和混合基金的基金经理，2018年7月6日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理。
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金、优选回报混合基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定开债券基金、汇添富睿丰混合基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理，汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2016年6月7日	-	12年	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理，固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理，2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金，汇添富优选回报混合基金（原理财21天债券基金）的基金经理，2015年3月10日至2018年5月4日任汇添富理财14天债券基金的基金经理，2016年6月7日至今任汇添富货币基金，添富通货币基金，实业债债券基金的基金经理，2016年6月7日至2018年5月4日任理财30天债券基金，理财60天债券基金的基金经理，2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理，2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2018年8月2日至今任汇添富睿丰混合基金，汇添富新睿精选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，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、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3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

三季度，宏观经济数据维持弱势，投资增速缓慢下行，制造业、基建与房地产投资总体均无亮点，消费维持弱势，消费升级与降级并存，考虑到抢跑因素之后进出口数据也面临一定困难，实体企业盈利能力与此同时三季度原油因美伊冲突持续上涨，风灾水灾猪瘟等事件带动CPI略上行，尽管是几项短期因素，但一定程度上仍然引发了“滞涨”的扰动，对未来通胀产生一些分歧。三季度，央行政策保持相对宽松，7月份定向降准支持债转股，融资便利且利率处于低位，在中美贸易摩擦仍绷紧的情况下，从资产配置上债仍优于股；信用违约事件多于二季度，带动信用利差继续分化，从市场表现看，利率债总体平稳，国开略下行，地方政府债受欢迎，高评级信用债小幅下行，低评级成交仍不活跃。

可转债三季度表现一般，股票市场在估值底部开始以震荡为主，反弹的认可度提高但力度不大，7月份银行、钢铁转债等上涨抬升了转债指数，8、9月份则总体表现散乱，阴跌为主，成交量不大；部分债性转债开始得到关注。

本组合三季度净值上涨1%，本期组合的纯债维持较高的比例配置，可转债仓位较高，个券表现不一，但总体平稳。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富实业债债券A基金份额净值为1.100元，本报告期基金份额净值增长率为1.10%；截至本报告期末汇添富实业债债券C基金份额净值为1.071元，本报告期基金份额净值增长率为1.04%；同期业绩比较基准收益率为0.57%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	74,522,168.00	95.52
	其中：债券	74,522,168.00	95.52
	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	-	-
	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	1,709,803.26	2.19
8	其他资产	1,781,526.56	2.28
9	合计	78,013,497.82	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未持有港股通投资股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,017,000.00	13.92
	其中：政策性金融债	10,017,000.00	13.92
4	企业债券	53,672,428.00	74.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,832,740.00	15.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	74,522,168.00	103.57

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	180209	18国开09	100,000	10,017,000.00	13.92
2	112230	14司尔01	60,000	6,022,800.00	8.37
3	112516	17国信01	50,000	5,023,000.00	6.98
4	143179	17杭金02	50,000	5,015,000.00	6.97
5	122428	15信投01	50,000	5,014,000.00	6.97

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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,761.57
2	应收证券清算款	494,681.51
3	应收股利	-
4	应收利息	1,196,692.61
5	应收申购款	81,390.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,781,526.56

5.10.4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	110032	三一转债	1,396,230.00	1.94
2	128028	赣锋转债	1,269,190.00	1.76
3	123006	东财转债	1,268,190.00	1.76
4	113019	N玲珑转	1,237,440.00	1.72
5	113015	隆基转债	973,800.00	1.35
6	128032	双环转债	949,200.00	1.32
7	113505	杭电转债	895,000.00	1.24
8	113014	林洋转债	824,490.00	1.15
9	110034	九州转债	684,905.00	0.95
10	110042	航电转债	667,200.00	0.93
11	128017	金禾转债	667,095.00	0.93

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
报告期期初基金份额总额	49,790,552.57	19,226,348.81
报告期期间基金总申购份额	4,423,192.81	1,316,133.47
减：报告期期间基金总赎回份额	7,354,943.54	1,476,705.28
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	46,858,801.84	19,065,777.00

注：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。

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：无。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富实业债债券型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富实业债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富实业债债券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、报告期内汇添富实业债债券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。

9.2存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

9.3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

2018年10月26日

汇添富双利债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30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

报告送出日期：2018年10月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	汇添富双利债券	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	99,680,393.13份	
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。	
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	
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	83,230,937.44份	16,449,455.69份

§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（2018年7月1日－2018年9月30日）	
	双利债券A	双利债券C
1. 本期已实现收益	-4,321,029.61	-793,250.44
2. 本期利润	-990,525.77	-202,338.21
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0117	-0.0121
4. 期末基金资产净值	126,072,376.58	22,470,882.19
5. 期末基金份额净值	1.515	1.366

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、本基金自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

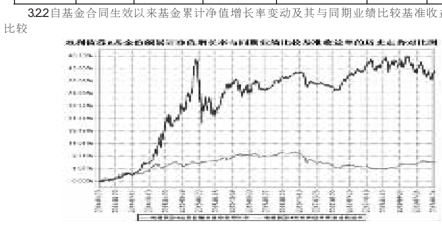
双利债券A

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	-0.72%	0.43%	0.57%	0.07%	-1.29%	0.36%

双利债券C

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	-0.87%	0.43%	0.57%	0.07%	-1.44%	0.36%

3.2.2自基金合同生效以来基金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：1、自2014年1月28日起，汇添富保本混合型证券投资基金转型为汇添富双利债券型证券投资基金，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。

2、本基金自2014年6月18日起增加C类收费模式，该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2014年6月18日起计算。

§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		
郑慧莲	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券、汇添富多元收益债券、添富年年益定开混合、添富熙和混合、汇添富安鑫智选混合、汇添富达欣混合、添富全球消费混合（QDII）的基金经理。	2017年12月12日	-	8年	国籍：中国。学历：复旦大学会计学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格、中国注册会计师。从业经历：2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业研究员、高级研究员。2017年5月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定开混合基金和汇添富6月红定开债基金的基金经理助理，2017年5月18日至2017年12月25日任汇添富年年益定开混合基金的基金经理助理。2017年12月12日至今任汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理，2017年12月26日至今任汇添富多元收益债券、添富年年益定开混合基金的基金经理，2018年3月1日至今担任添富熙和混合基金的基金经理，2018年4月2日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理，2018年7月6日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理，2018年9月21日至今任添富全球消费混合（QDII）的基金经理。
陈加荣	汇添富双利债券基金、汇添富高息债债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金、添富年年丰定开混合基金、添富民安增益定开混合基金、添富鑫成定开债基金的基金经理。	2013年2月7日	-	17年	国籍：中国。学历：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，2017年4月20日至今任添富年年丰定开混合基金的基金经理，2018年2月13日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理，2018年4月26日至今任添富鑫成定开债基金的基金经理。
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、汇添富鑫利债券基金、汇添富绝对收益定开混合基金、汇添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。	2018年9月28日	-	7年	国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕士。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8月3日至今任汇添富盈稳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，2017年3月13日至今任汇添富鑫利债券基金的基金经理，2017年3月15日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理，2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2017年9月27日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理，2018年1月25日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理，2018年4月16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理，2018年9月28日至今任添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。

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，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、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3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

基本面，三季度融资环境的持续收缩开始对经济产生拖累。工业生产整体有所放缓，受基建投资拖累，固定资产投资增速显著下滑，但房地产投资增速依然维持2位数增长。通胀7月超预期反弹，8月进一步上行超预期，虽然通胀主要受天气、猪瘟等结构性因素扰动，但市场对于通胀的担忧加剧。金融数据方面，融资总额有所改善，不过同比增速仍然持续下滑，信贷质量依然较差。政策面，三季度以来从宽货币到宽信用，从去杠杆到稳杠杆的政策导向非常明确，但实际落地过程中宽信用传导机制仍不通畅。资金面维持宽松，货币政策实质偏宽松。

三季度债券收益率先下后上，曲线陡峭化下行。信用利差经过二季度的明显扩大，三季度先收缩后反弹，民营企业信用利差依然维持在历史高位。三季度，中债财富综合指数上涨1%。股票市场出现明显分化，上证50指数上涨5.11%，沪深300指数下跌2.05%，创业板指数则大跌12.16%。投资者亦进一步向一些确定性较强的资产抱团取暖，缺乏基本面支撑的公司则越来越边缘化。

报告期内，基金适时积极调整债券组合，拉长久期，但转债仓位偏重，导致组合净值波动较大。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末双利债券A基金份额净值为1.515元，本报告期基金份额净值增长率为-0.72%；截至本报告期末双利债券C基金份额净值为1.366元，本报告期基金份额净值增长率为-0.87%；同期业绩比较基准收益率为0.57%。

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	23,553,240.86	13.78
	其中：股票	23,553,240.86	13.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	129,443,101.36	75.75
	其中：债券	129,443,101.36	75.75
	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	-	-
	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	15,527,253.90	9.09
8	其他资产	2,353,501.28	1.38
9	合计	170,877,097.40	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	-	-
C	制造业	14,964,103.00	10.07
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	63,728.20	0.04
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	2,076,389.16	1.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,945,054.00	3.33
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	1,503,966.50	1.01
S	综合	-	-
	合计	23,553,240.86	15.86

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未持有港股通投资股票。

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	600104	上汽集团	169,265	5,633,139.20	3.79
2	601888	中国国旅	72,700	4,945,054.00	3.33
3	000651	格力电器	106,149	4,267,189.80	2.87
4	600845	宝信软件	84,716	2,076,389.16	1.40
5	600519	贵州茅台	2,345	1,711,850.00	1.15
6	600872	中炬高新	51,000	1,662,600.00	1.12
7	300144	宋城演艺	67,594	1,503,966.50	1.01
8	600887	伊利股份	31,200	801,216.00	0.54
9	002415	海康威视	23,200	666,768.00	0.45
10	002536	西泵股份	21,700	221,340.00	0.15

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,746,200.00	5.21
	其中：政策性金融债	7,746,200.00	5.21
4	企业债券	94,433,620.50	63.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,398,000.00	6.33
7	可转债（可交换债）	17,865,280.86	12.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	129,443,101.36	87.14

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	127452	16蚌口债	140,000	13,414,800.00	9.03
2	143647	18电投03	100,000	10,140,000.00	6.83
3	122497	15远洋04	100,000	10,082,000.00	6.79
4	136047	15国君G1	100,000	10,000,000.00	6.73
5	101754002	17鲁宏桥MTN002	100,000	9,398,000.00	6.33

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。

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国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	33,051.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,230,537.62
5	应收申购款	89,912.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,353,501.28

5.10.4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	128024	宁行转债	4,676,585.46	3.15
2	123006	东财转债	2,305,800.00	1.55
3	113014	N林洋转	2,167,492.60	1.46
4	113011	光大转债	2,167,200.00	1.46
5	110038	济川转债	1,739,938.70	1.17
6	128028	赣锋转债	1,672,401.90	1.13
7	132010	17桐昆EB	715,500.00	0.48
8	110032	三一转债	99,005.40	0.07

5.10.5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未存在流通受限的情况。

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	双利债券A	双利债券C
报告期期初基金份额总额	85,447,114.67	17,023,297.83
报告期期间基金总申购份额	1,749,974.10	1,669,224.03
减：报告期期间基金总赎回份额	3,966,151.33	2,243,066.17
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	83,230,937.44	16,449,455.69

注：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。

§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影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年7月1日至2018年9月30日	38,167,302.80	0.00	0.00	38,167,302.80	38.29%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富保本混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富保本混合型证券投资基金托管协议》；

4、《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》；

5、《汇添富双利债券型证券投资基金托管协议》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内汇添富双利债券型证券投资基金和汇添富保本混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

8、中国证监会要求的其他文件。

9.2存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20层 汇添富基金管理股份有限公司

9.3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

2018年10月26日