汇添富双利增强债券型证券投资基金

【2014】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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富双利增强债券
交易代码	000406
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	182,843,255.10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,并适度参与权益类品种投资,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的资产不低于基金资产的60%;股票资产的投资比例合计不超过基金资产的20%;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	银行三年期存款税后利率+1.5%。
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	上海浦东发展银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	汇添富双利增强债券A / 汇添富双利增强债券C
下属两级基金的交易代码	000406 / 000407
报告期末下属两级基金的份额总额	182,154,661.19份 / 688,593.91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(2014年7月1日 - 2014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	6,981,167.62	21,697.80
2.本期利润	8,275,330.07	26,121.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0346	0.0364
4.期末基金资产净值	194,506,309.96	736,605.52
5.期末基金份额净值	1.068	1.070

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

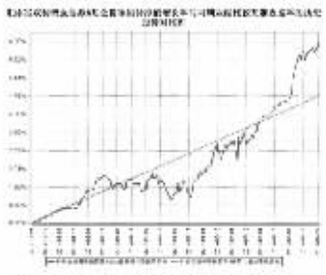
汇添富双利增强债券A

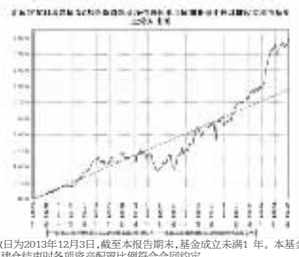
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.69%	0.19%	1.45%	0.01%	2.24%	0.18%

汇添富双利增强债券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	3.68%	0.19%	1.45%	0.01%	2.23%	0.18%

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:本基金的《基金合同》生效日为2013年12月3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(2013年12月3日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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	汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,汇添富理财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。	2013年12月3日	-	13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:曾在红塔证券、汉唐证券、华夏兴业基金负责宏观经济和债券的研究,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 管理人对投资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,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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。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1次,由于专户到期清盘导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

总体而言,3季度是难得的股债双牛。流动性充裕以及央行通过降低正回购利率这种变通的方式降低融资成本,为股票、债券市场提供了坚强支撑。尽管经济走势一般,市场对强有力领导下的改革的信心也是权益类市场走强的重要原因。信用债方面,虽然信用热点事件频出,但"超日债"的最终妥善解决,市场对信用风险的担心有所降低。报告期内,本基金积极增仓权益类资产及利率产品,较好分享到市场机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度汇添富双利债券型证券投资基金A份额净值增长率为3.74%,C份额净值增长率为3.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在转型、调结构的大背景下,今后的经济走势都不会像过去那样很强,但改革可能超预期,市场会维持较强的改革信心,同时央行会进一步采用多种变通的手法降低融资成本,上述对证券市场都有一定的支持。

§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	15,450,800.00	5.88
	其中:股票	15,450,800.00	5.88
2	固定收益投资	236,977,635.10	90.20
	其中:债券	236,977,635.10	90.20
	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	-	-
	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	2,881,843.92	1.10
7	其他资产	7,416,889.22	2.82
8	合计	262,727,168.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	8,188,500.00	4.19
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	1,324,000.00	0.68
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	2,695,000.00	1.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,744,800.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	1,498,500.00	0.77
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	15,450,800.00	7.91

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	300006	莱美药业	120,000	4,116,000.00	2.11
2	300090	盛运股份	250,000	4,072,500.00	2.09
3	002183	怡亚通	120,000	1,744,800.00	0.89
4	300012	华测检测	75,000	1,498,500.00	0.77
5	600037	歌华有线	100,000	1,471,000.00	0.75
6	000417	合肥百货	200,000	1,324,000.00	0.68
7	002232	启明信息	100,000	1,224,000.00	0.63

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	37,338,450.00	19.12
	其中:政策性金融债	37,338,450.00	19.12
4	企业债券	199,059,615.10	101.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	579,570.00	0.30
8	其他	-	-
9	合计	236,977,635.10	121.37

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	018001	国开1301	267,000	27,327,450.00	14.00
2	122921	10郫州债	235,710	24,509,125.80	12.55
3	124606	14菏泽债	200,000	20,840,000.00	10.67
4	124609	14常德投	199,000	20,138,800.00	10.31
5	124604	14富阳02	200,000	20,000,000.00	10.24

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

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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	125,005.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,291,883.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,416,889.22

5.10.4 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。

5.10.5 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不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富双利增强债券A	汇添富双利增强债券C
报告期期初基金份额总额	287,462,705.58	835,084.97
报告期期间基金总申购份额	3,963,661.76	378,389.17
减:报告期期间基金总赎回份额	109,271,706.15	524,880.23
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	182,154,661.19	688,593.91

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:本基金的基金管理人本报告期内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双利增强债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富双利增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富双利增强债券型证券投资基金托管协议》;

4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内双利增强债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

7、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

上海市浦城路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
2014年10月24日

汇添富双利债券型证券投资基金

【2014】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:2014年10月24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2014年10月22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2014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	141,820,230.54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
下属两级基金的基金简称	双利债券A / 双利债券C
下属两级基金的交易代码	470018 / 000692
报告期末下属两级基金的份额总额	140,550,738.11份 / 1,269,492.43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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
	双利债券A	双利债券C
1.本期已实现收益	5,966,802.58	17,162.94
2.本期利润	6,005,785.65	13,319.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0393	0.0449
4.期末基金资产净值	159,812,226.88	1,320,548.09
5.期末基金份额净值	1.137	1.040

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,该类别基金的各项费用,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

双利债券A

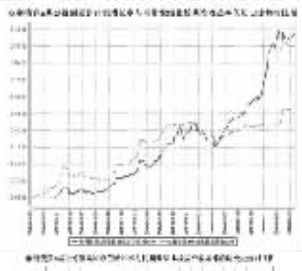
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.74%	0.21%	0.70%	0.07%	3.04%	0.14%

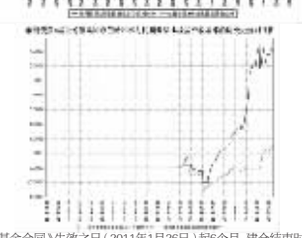
双利债券C

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
成立以来	3.59%	0.21%	0.70%	0.07%	2.89%	0.14%

注:汇添富保本混合型证券投资基金从2014年1月28日起正式转型为汇添富双利债券型证券投资基金,本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

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、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年1月26日)起6个月,建仓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		
陈加荣	汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,汇添富双利债券基金、汇添富信用债券基金、汇添富高息债券基金、汇添富年利定期开放债券基金的基金经理。	2013年2月7日	-	13年	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任金融工程部高级经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,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、汇添富信用债券基金的基金经理,2013年6月27日至今任汇添富高息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。

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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。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1次,由于专户到期清盘导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

总体而言,3季度是难得的股债双牛。流动性充裕以及央行通过降低正回购利率这种变通的方式降低融资成本,为股票、债券市场提供了坚强支撑。尽管经济走势一般,市场对强有力领导下的改革的信心也是权益类市场走强的重要原因。信用债方面,虽然信用热点事件频出,但"超日债"的最终妥善解决,市场对信用风险的担心有所降低。报告期内,本基金积极增仓权益类资产及利率产品,较好分享到市场机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度汇添富双利债券型证券投资基金A份额净值增长率为3.74%,C份额净值增长率为3.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在转型、调结构的大背景下,今后的经济走势都不会像过去那样很强,但改革可能超预期,市场会维持较强的改革信心,同时央行会进一步采用多种变通的手法降低融资成本,上述对证券市场都有一定的支持。

§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	2,810,000.00	1.55
	其中:股票	2,810,000.00	1.55
2	固定收益投资	168,755,133.19	92.92
	其中:债券	168,755,133.19	92.92
	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	-	-
	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	5,363,965.73	2.95
7	其他资产	4,693,106.02	2.58
8	合计	181,622,204.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	2,810,000.00	1.74
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,810,000.00	1.74

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	600661	新南洋	100,000	2,810,000.00	1.74

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	10,228,000.00	6.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,385,000.00	12.65
	其中:政策性金融债	20,385,000.00	12.65
4	企业债券	105,410,464.69	65.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,042,000.00	6.23
7	可转债	22,689,668.50	14.08
8	其他	-	-
9	合计	168,755,133.19	104.73

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	112208	14华邦01	120,000	12,072,000.00	7.49
2	1480073	14唐山城投债	100,000	10,587,000.00	6.57
3	124505	14嘉市镇	100,000	10,450,000.00	6.49
4	124555	14余城建	100,000	10,410,000.00	6.46
5	124557	13天易02	100,000	10,375,000.00	6.44

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

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:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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	15,795.08
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,026,621.22
5	应收申购款	150,689.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,693,106.02

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	110015	石化转债	7,414,040.00	4.60
2	110018	国电转债	3,236,122.80	2.01
3	110022	同仁转债	3,206,628.10	1.99
4	113003	重工转债	2,736,800.00	1.70
5	110023	民生转债	1,871,200.00	1.16
6	110011	歌华转债	1,315,380.00	0.82
7	113005	平安转债	547,250.00	0.34
8	113001	中行转债	517,800.00	0.32
9	110024	隧道转债	394,080.00	0.24

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有股票未存在流通受限情况。

§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	163,398,594.31	8,996.00
报告期期间基金总申购份额	1,954,998.44	1,618,940.11
减:报告期期间基金总赎回份额	24,802,854.64	358,443.68
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	140,550,738.11	1,269,492.43

注:1、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。

2、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情况

§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双利债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富双利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、报告期内汇添富双利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。

8.2 存放地点

上海市浦城路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
2014年10月24日

汇添富香港优势精选股票型证券投资基金

【2014】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:2014年10月24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2014年10月22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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富香港优势精选股票(QDII)
交易代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月25日
报告期末基金份额总额	58,968,806.89份
投资目标	在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券,通过有效的资产配置和组合管理,进行中长期投资布局,在有效管理风险的前提下,追求持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中,根据宏观经济和证券市场状况,通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征,确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中,采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势,且估值有吸引力