

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

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事局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、完整性和客观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2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等，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未来表现。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告公告日期为2015年7月1日起至9月30日。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富互利分级债券
交易代码	164703
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月6日
报告期末基金份额总额	252,378,506.07份
投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金通过深入分析锁定收益类金融工具的现价价值进行动态管理，力争实现资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金。 本基金在投资策略上，本基金管理人努力争取长期与业绩基准的差距不超过20%，年度跟踪误差不超过14%。
业绩比较基准	业绩比较基准：沪深300指数收益率×5%+中债综合指数收益率×95%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，混合基金，高于货币市场基金。
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	汇添富互利分级债券A
下属分级基金的交易代码	164703
报告期末基金份额的总额	150142
报告期末基金份额的净值	41,572,36858份
报告期末基金份额的份额总额	210,806,13749份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	12,037,969.74
2.本期利润	17,206,706.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0082
4.期末基金份额净值	338,238,104.05
5.期末基金份额净值	1.340

注:1. 本期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份额的任何费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.22 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



§ 4 管理人报告

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

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局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、完整性和客观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2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等，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未来表现。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告公告日期为2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

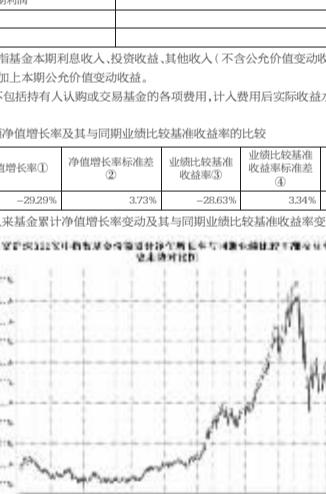
主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-26,301,646.93
2.本期利润	-107,346,724.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0548
4.期末基金份额净值	250,656,232.72
5.期末基金份额净值	1.2442

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份额的任何费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.22 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

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	-29.29%	3.73%	-28.63%	3.34%	-0.66%	0.39%

3.22 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



§ 4 管理人报告

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

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局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、完整性和客观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2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等，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未来表现。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告公告日期为2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

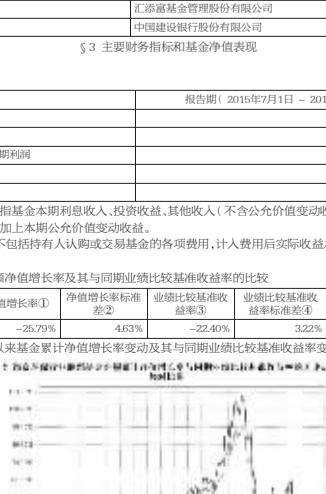
主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-185,404,605.28
2.本期利润	-1,434,886,007.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0897
4.期末基金份额净值	3,690,735,744.96
5.期末基金份额净值	1.203

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份额的任何费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.22 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

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	-25.79%	4.63%	-22.40%	3.22%	-3.39%	1.41%

3.22 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



§ 4 管理人报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局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、完整性和客观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2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等，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未来表现。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告公告日期为2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-185,404,605.28
2.本期利润	-1,434,886,007.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0897
4.期末基金份额净值	3,690,735,744.96
5.期末基金份额净值	1.203

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份额的任何费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.22 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

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	-25.79%	4.63%	-22.40%	3.22%	-3.39%	1.41%

3.22 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



§ 4 管理人报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局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、完整性和客观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2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等，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未来表现。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告公告日期为2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-185,404,605.28
2.本期利润	-1,434,886,007.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0897
4.期末	