

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:2017年10月25日

**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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2017年10月23日复核了本报告涉及的投资组合报告、净值表现、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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至2017年10月30日止。

**2. 基金产品概况**

本基金类别:债券型证券投资基金

交易代码:470001

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年1月20日

报告期末基金份额总额:69,882,123,942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、保持资产流动性的基础上，为基金份额持有人创造稳定收益。

投资策略:本基金通过分析宏观经济、利率、信用、行业、券种等因素的变化，综合评估各类债券品种的预期收益，调整不同债券品种的配置比例，从而确定组合内不同债券品种的配置比例，以实现本基金在严格控制风险的前提下，力争获得超越基准的收益。

业绩比较基准:中债综合指数

本基金的管理费率为每年0.6%，基金托管费率为每年0.2%。

基金的申购赎回费用:申购时收取，赎回时不收取。

投资组合报告:见正文部分。

风险收益特征:本基金是一只债券基金，属于货币市场基金中的低风险品种，其预期风险水平低于货币市场基金，但高于货币市场基金。

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代码:470001

报告期末下属分级基金的份额总额:54,049,069,956份

4.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标| 报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)

1.本期已实现收益| 1,064,070,477 | 80,006,13

2.本期利润| 2,304,390,493 | 175,899,013

3.加权平均基金份额本期利润| 0.0303 | 0.0032

4.期末基金资产净值| 83,306,910,10 | 6,744,161,76

5.期末基金份额净值| 1.510 | 1.372

注:1.本公司于2017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申购服务费。

2.所列财务指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将发生变动。

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申购服务费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金报告期内基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

双利债券A

双利债券C

报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)

阶段| 净值增长| 净值增长标准差| 收益率差异| 标准差差异

过去二个月| 2.02% | 0.01% | 0.03% | 0.00%

双利债券A

双利债券C

报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)

阶段| 净值增长| 净值增长标准差| 收益率差异| 标准差差异

过去二个月| 2.40% | 0.21% | 0.16% | 0.18%

注:1.本基金于2014年6月18日起正式转换为汇添富双利债券证券投资基金,转换前本基金的业绩比较基准为:2014年6月18日起定期存款基准收益率+0.2%。

2.所列财务指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将发生变动。

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申购服务费。

3.2.2 基金管理人收益效果以基金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

本基金报告期内基金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

双利债券C

报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)

阶段| 净值增长| 净值增长标准差| 收益率差异| 标准差差异

过去二个月| 2.02% | 0.01% | 0.03% | 0.00%

双利债券A

双利债券C

报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)

阶段| 净值增长| 净值增长标准差| 收益率差异| 标准差差异

过去二个月| 2.40% | 0.21% | 0.16% | 0.18%

注:1.本基金于2017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申购服务费。

2.所列财务指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将发生变动。

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申购服务费。

4.22 异常交易行为的专项说明

4.23 公平交易制度的执行情况

4.24 管理人对报告期内公平交易制度的执行情况的专项说明

4.25 报告期内基金投资组合的重大关联交易

4.26 报告期内未出现单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过20%的情况

4.27 报告期内未出现一个投资人持有一个以上基金的情况

4.28 公平交易制度的执行情况

4.29 报告期内未出现内幕交易、利益输送等不公平交易行为

4.30 报告期内未出现不公平对待不同客户的行为

4.31 公平交易制度的执行情况

4.32 报告期内未出现利益输送、不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.33 报告期内未出现利用基金财产进行牟取不正当利益的行为

4.34 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.35 报告期内未出现利益输送、不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.36 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.37 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.38 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.39 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.40 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.41 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.42 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.43 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.44 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.45 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.46 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.47 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.48 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.49 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.50 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.51 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.52 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.53 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.54 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.55 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.56 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.57 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.58 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.59 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.60 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.61 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.62 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.63 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.64 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.65 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.66 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.67 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.68 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.69 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.70 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.71 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.72 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.73 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.74 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.75 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.76 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.77 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.78 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.79 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.80 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.81 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.82 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.83 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.84 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.85 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.86 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.87 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.88 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.89 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.90 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.91 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.92 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.93 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.94 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.95 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.96 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.97 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.98 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.99 报告期内未出现不公平对待不同客户、不公平对待账户的情形

4.10 报告期内未出现不公平