

汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 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

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

汇添富保本混合型证券投资基金的保本周期为三年，自本基金基金合同生效之日（2011 年 1 月 26 日）起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即 2014 年 1 月 27 日为本基金保本周期到期日。汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期，已按照本基金基金合同的约定变更为非保本的债券型基金，即“汇添富双利债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为“470018”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，2014 年 1 月 27 日为汇添富保本混合型证券投资基金的保本周期到期选择期，在本基金保本周期到期日的次日，即 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”。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制。其中，基金转型前的报告期间为 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 1 月 27 日止。基金转型后的报告期间为 2014 年 1 月 28 日起至 2014 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)	18
6.1 资产负债表(转型前).....	18
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)	38
6.1 资产负债表（转型后）.....	38
6.2 利润表.....	39
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	40
6.4 报表附注.....	41
§7 投资组合报告(转型前)	62
7.1 期末基金资产组合情况.....	62
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	62
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
7.6 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	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 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贵金属投资明细	64
7.9 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	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§7 投资组合报告(转型后)	65
7.1 期末基金资产组合情况	65
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	65
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)	65
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 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	66
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
7.8 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贵金属投资明细	67
7.9 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	67
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息(转型前)	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	69
§8 基金份额持有人信息(转型后)	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	70
§9 开放式基金份额变动	70
转型前	70
转型后	70
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)	75
10.8 其他重大事件 (转型后)	77
10.8 其他重大事件 (转型前)	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	81

12.1 备查文件目录.....81
 12.2 存放地点.....81
 12.3 查阅方式.....81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富保本混合型证券投资基金
基金简称	汇添富保本混合
基金主代码	470018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 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
报告期末基金份额总额	951,062,487.01 份
基金合同存续期（若有）	汇添富保本混合型证券投资基金的保本周期为三年，自本基金基金合同生效之日（2011 年 1 月 26 日）起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即 2014 年 1 月 27 日为本基金保本周期到期日。

注：上表中“报告期末”指 2014 年 1 月 27 日。

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富双利债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富双利债券	
基金主代码	470018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 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	
报告期末基金份额总额	163,407,590.31 份	
基金合同存续期（若有）	不定期	
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	163,398,594.31 份	8,996.00 份

注：上表中“报告期末”指 2014 年 6 月 30 日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本周期内实现基金财产的稳健增值。
------	---

投资策略	本基金将按照投资组合保险技术的要求动态调整保本资产与风险资产的投资比例,以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现基金资产在保本基础上的保值增值目的;在此基础上将通过严谨的量化分析和翔实的实地调研,精选优质股票和债券进行投资布局,以实现基金资产最大限度的增值。
业绩比较基准(若有)	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征(若有)	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。

2.2 基金产品说明

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(若有)	中债综合指数。
风险收益特征(若有)	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		林利军	姜建清

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日- 2014 年 1 月 27 日)	
	转型前	
本期已实现收益	5,381,379.13	
本期利润	4,123,707.79	
加权平均基金份额本期利润	0.0041	
本期加权平均净值利润率	0.38%	
本期基金份额净值增长率	0.38%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日- 2014 年 1 月 27 日)	
期末可供分配利润	58,820,271.16	
期末可供分配基金份额利润	0.0618	
期末基金资产净值	1,009,882,758.17	
期末基金份额净值	1.0620	
3.1.3 累计期末指标	报告期(2014 年 1 月 1 日- 2014 年 1 月 27 日)	
基金份额累计净值增长率	6.2000%	

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、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。截至本报告期末(2014 年 6 月 30 日)，汇添富双利债券型证券投资基金转型时间未满半年。

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 28 日- 2014 年 6 月 30 日)	
	双利债券 A (转型后)	双利债券 C (转型后)
本期已实现收益	2,717,660.60	4.35

本期利润	6,413,891.70	30.36
加权平均基金份额本期利润	0.0304	0.0047
本期加权平均净值利润率	2.84%	0.42%
本期基金份额净值增长率	3.20%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配利润	12,946,950.59	4.80
期末可供分配基金份额利润	0.0792	0.0005
期末基金资产净值	179,125,027.42	9,030.36
期末基金份额净值	1.096	1.004
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.20%	0.40%

金额单位：人民币元

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、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。截至本报告期末(2014 年 6 月 30 日)，汇添富双利债券型证券投资基金转型时间未满半年。

4、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

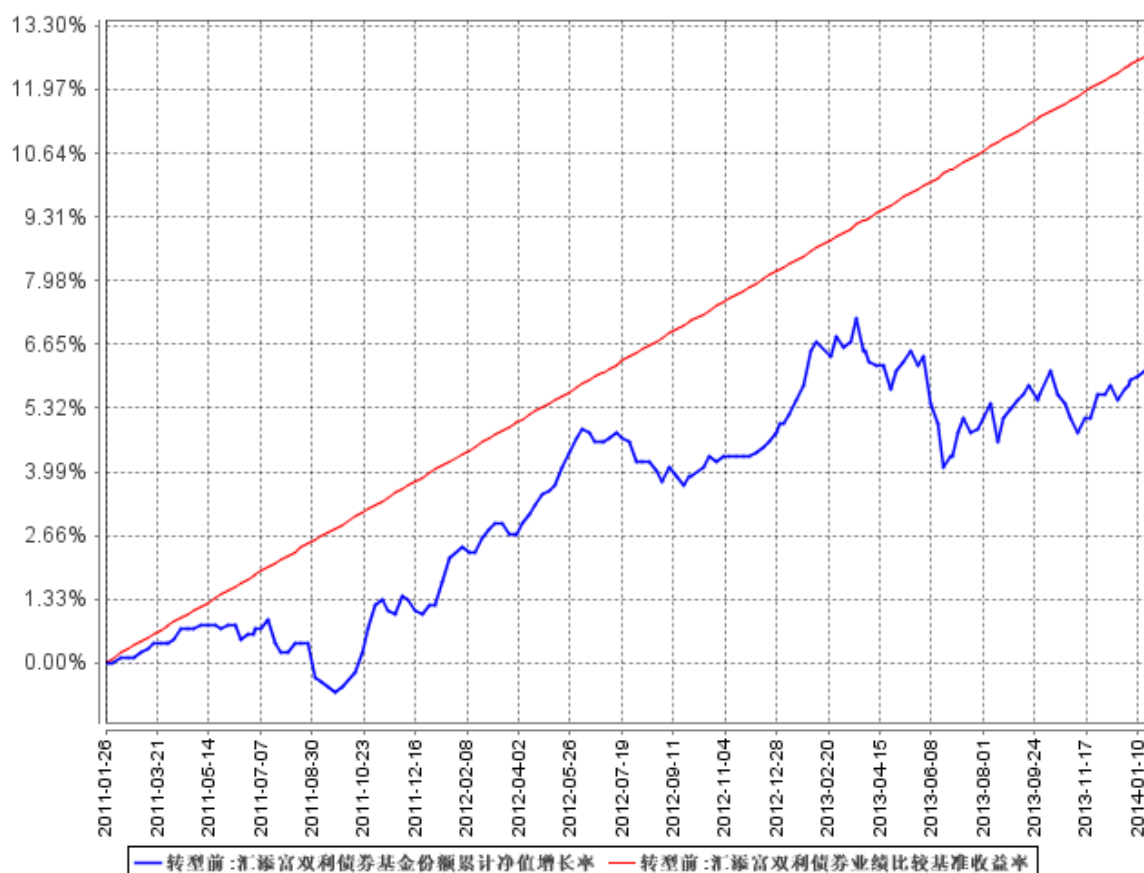
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型前						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自 2013-12-28 至 2014-01-27	0.47%	0.04%	0.36%	0.01%	0.11%	0.03%
自 2013-10-28 至 2014-01-27	0.76%	0.08%	1.09%	0.01%	-0.33%	0.07%
自 2013-07-28 至 2014-01-27	1.24%	0.14%	2.15%	0.01%	-0.91%	0.13%
自 2013-01-28 至 2014-01-27	0.38%	0.16%	4.27%	0.01%	-3.89%	0.15%
自 2011-01-28 至 2014-01-27	6.20%	0.12%	12.75%	0.01%	-6.55%	0.11%
自 2011-01-26 至 2014-01-27	6.20%	0.12%	12.77%	0.01%	-6.57%	0.11%

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

汇添富双利债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 (转型后)						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.20%	0.15%	0.42%	0.07%	0.78%	0.08%
过去三个月	2.91%	0.10%	2.42%	0.09%	0.49%	0.01%
自基金合同生效日起至今	3.20%	0.09%	3.26%	0.09%	-0.06%	0.00%
双利债券 C (转型后)						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④

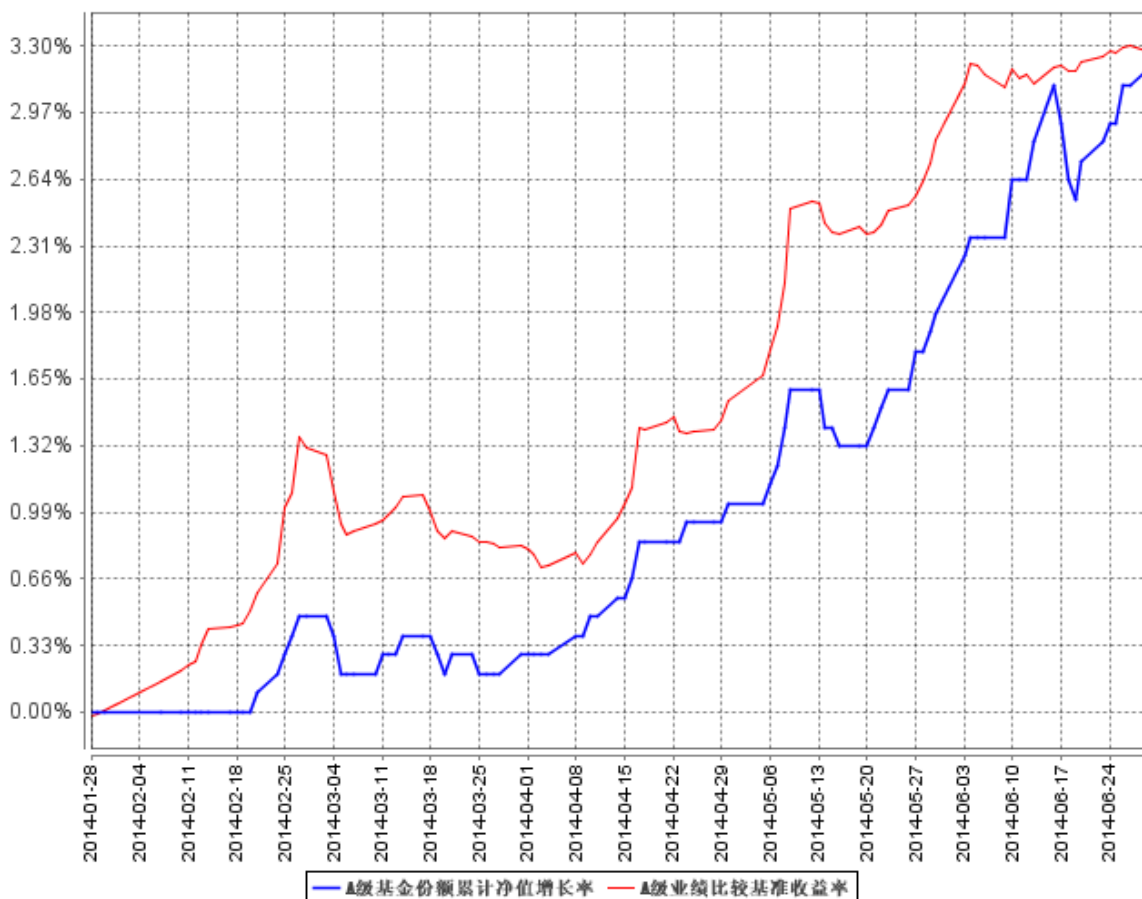
		②		准差④		
自基金合同生效日起至今	0.40%	0.05%	0.06%	0.03%	0.34%	0.02%

注：1、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，本表列示的是基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为中债综合指数。

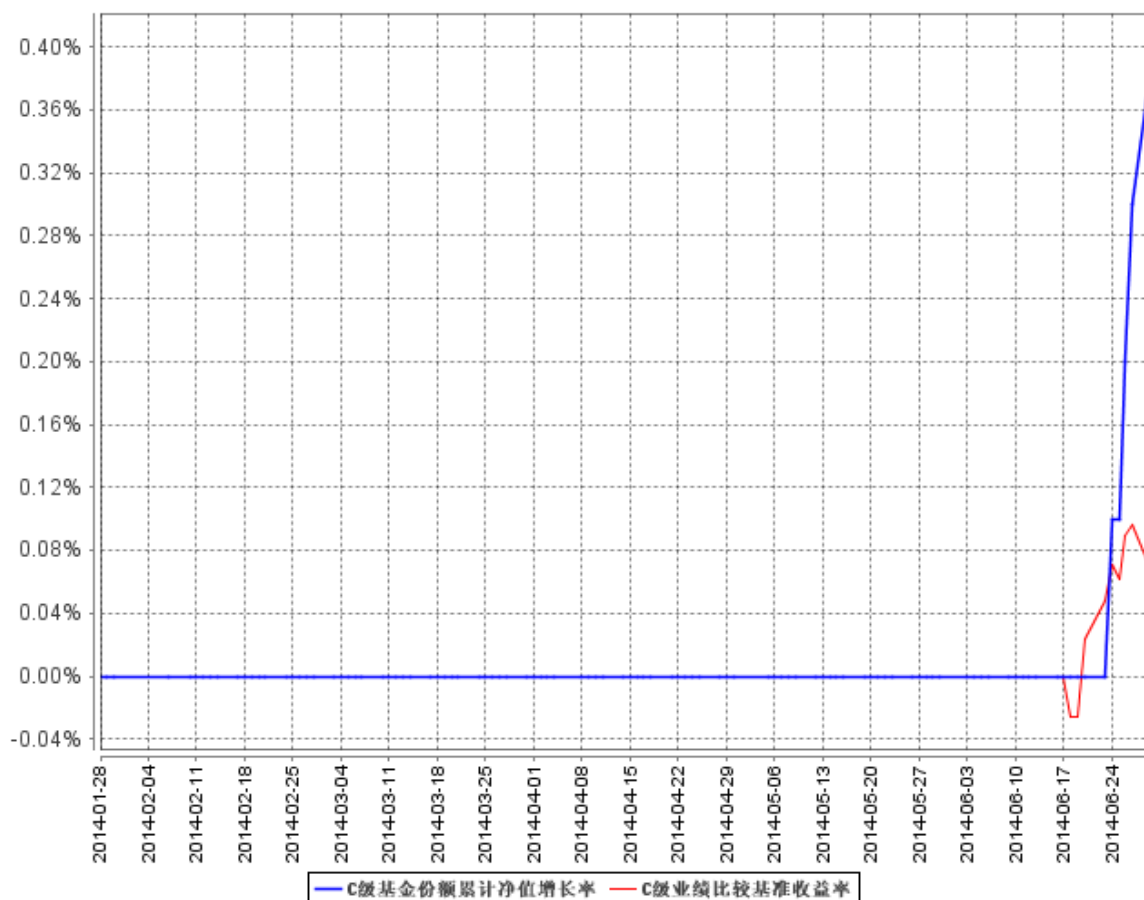
2、过去一个月指 2014 年 6 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日，过去三个月指 2014 年 4 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日。

3.2.2 自基金转型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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、汇添富双利债券型证券投资基金由汇添富保本混合型证券投资基金转型而来，自汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日，即2014年1月28日起6个月的时间区间内，为汇添富双利债券型证券投资基金的投资转型期，基金管理人应当自基金投资转型期截止日次日起使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末，汇添富双利债券型证券投资基金尚处于投资转型期。

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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本金为1亿元人民币。截止到2014年6月30日，公司管理证券投资基金规模约981.54亿元，有效客户数约290万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理47只开放

式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财 28 天债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富新收益债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、汇添富收益快	2013 年 2 月 7 日	-	13 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

	线货币基金、汇添富信用债券基金、汇添富高息债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。				<p>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。</p>
朱晓亮	汇添富消费行业股票基金、汇添富均衡增长股	2013 年 8 月 1 日	-	7 年	<p>国籍：中国。学历：上海财经大学金融学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从</p>

	票基金、汇添富民营活力股票基金的基金经理，汇添富双利债券基金、汇添富可转换债券基金的基金经理助理。			业经历：2007 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业分析师、高级行业分析师，2013 年 5 月 3 日至今任汇添富消费行业股票基金的基金经理，2013 年 8 月 1 日至今任汇添富双利债券基金、汇添富可转换债券基金的基金经理助理，2013 年 11 月 22 日至今任汇添富均衡增长股票基金的基金经理，2014 年 4 月 8 日至今任汇添富民营活力股票基金的基金经理。
--	---	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

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 4 次，其中 3 次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致，1 次是由于投资流动性的需求导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年，央行政策及资金面的宽松与否仍是目前影响债券市场的最大因素。尽管经济基本面并未出现很大的变化，主要投资机构在“非标”上的投资热情也未见明显减退，1 月中下旬，伴随央行为有效管控春节临近前的资金紧张而大量向市场逆回购资金，以及人民币汇率改革中可能的资金投放，市场资金利率开始下行，2013 年下半年大幅下跌后收益率处于历史高位的债券市场应声开始反弹，利率债先行，高评级信用债随后跟进。到 2 月底 3 月初，银行间 7 天回购利率下降 200bp，10 年国债收益率下降 15 个 bp，5 年评级 AA+ 的交易所公司债收益率下行 70bp。之后，由于央行开始延长正回购期限并加大资金回笼的力度，资金利率开始上行，市场预期相应开始调整，超日债的违约预告，则导致债市全面走弱。至季末，利率债、信用债收益率均有不同程度的上行。时间进入 2 季度，政府在经济上维稳的紧迫性略有增强，央行继续维持相对宽松的资金供给。债券收益率曲线呈现“牛平”状，中长段的信用债、利率债利率均有不同程度的下行，利率债在 127 号文以及市场对经济维稳政策的预期下略有反复。转债市场估值有所修复。本基金

根据市场变化，适时进行了资产组合的调整，重点持有以城投债为主的信用债，利率债和转债进行了一些波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日，汇添富保本混合型证券投资基金的净值增长率为 0.38%，同期业绩比较基准增长率为 0.01%

自 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日，汇添富双利债券型证券投资基金的 A 级净值增长率为 3.20%，同期业绩比较基准增长率为 3.26%。C 级净值增长率 0.40%，同期业绩比较基准增长率为 0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，政府在经济上维稳的态度比较明确，“微刺激”措施不断，国务院也派出了督查组加强“执行力”的检查，央行也比较配合，预计 3 季度市场流动性仍不会太紧，但由于经济结构性问题短期内难以解决，“微刺激”的小范围、低烈度特点以及去年 3 季度基期较高等因素，3 季度经济是否能有所反弹尚需观察，经济刺激的见效与否关键还是要看 4 季度。但是，证券市场预期往往会有所提前。一般债券市场价值尚存，转债战略性机会渐显。本基金会在维持基本组合的基础上，稳健操作，承担有价值的风险，努力为持有人创造收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富双利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富双利债券型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富双利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富双利债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 1 月 27 日

单位：人民币元

资产	附注号	报告期初至转型前	上年度末
----	-----	----------	------

			2013 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	916,658,073.36	196,742,946.16
结算备付金		316,311.71	2,150,766.56
存出保证金		163,002.73	228,980.75
交易性金融资产	6.4.7.2	-	870,568,486.70
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	870,568,486.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000,000.00	20,000,000.00
应收证券清算款		-	1,500,833.33
应收利息	6.4.7.5	1,095,151.71	24,324,507.32
应收股利		-	-
应收申购款		28,546.13	40,147.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,218,261,085.64	1,115,556,668.54
负债和所有者权益	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		199,950,507.38	-
应付赎回款		7,074,688.37	1,496,274.81
应付管理人报酬		955,287.82	1,145,371.12
应付托管费		159,214.62	190,895.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,684.44	34,464.50
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	231,944.84	211,880.94
负债合计		208,378,327.47	3,078,886.59
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	951,062,487.01	1,051,697,428.43
未分配利润	6.4.7.10	58,820,271.16	60,780,353.52
所有者权益合计		1,009,882,758.17	1,112,477,781.95

负债和所有者权益总计		1, 218, 261, 085. 64	1, 115, 556, 668. 54
------------	--	----------------------	----------------------

注：1、报告截止日 2014 年 1 月 27 日，基金份额净值 1.062 元，基金份额总额 951,062,487.01 份。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		5, 287, 704. 25	6, 738, 846. 28
1. 利息收入		3, 385, 429. 20	27, 822, 145. 29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1, 058, 936. 14	112, 575. 52
债券利息收入		1, 805, 141. 32	27, 014, 696. 12
资产支持证券利息收入		-	405, 736. 35
买入返售金融资产收入		521, 351. 74	289, 137. 30
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2, 918, 044. 23	-14, 018, 352. 22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13, 120. 76	-14, 707, 971. 04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2, 931, 164. 99	-143, 395. 37
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	833, 014. 19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1, 257, 671. 34	-7, 678, 525. 10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	241, 902. 16	613, 578. 31
减：二、费用		1, 163, 996. 46	12, 985, 743. 19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	955, 287. 82	8, 282, 990. 72
2. 托管费	6.4.10.2.2	159, 214. 62	1, 380, 498. 48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7, 485. 68	2, 019, 214. 22
5. 利息支出		784. 71	1, 074, 005. 64
其中：卖出回购金融资产支出		784. 71	1, 074, 005. 64
6. 其他费用	6.4.7.20	41, 223. 63	229, 034. 13

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,123,707.79	-6,246,896.91
---------------------	--	--------------	---------------

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富保本混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,051,697,428.43	60,780,353.52	1,112,477,781.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,123,707.79	4,123,707.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-100,634,941.42	-6,083,790.15	-106,718,731.57
其中：1. 基金申购款	572,728.22	34,246.13	606,974.35
2. 基金赎回款	-101,207,669.64	-6,118,036.28	-107,325,705.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	951,062,487.01	58,820,271.16	1,009,882,758.17
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,427,428,351.72	70,910,024.43	1,498,338,376.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,246,896.91	-6,246,896.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-213,328,208.09	-12,911,205.17	-226,239,413.26
其中：1. 基金申购款	8,112,738.35	516,687.85	8,629,426.20
2. 基金赎回款	-221,440,946.44	-13,427,893.02	-234,868,839.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-

变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,214,100,143.63	51,751,922.35	1,265,852,065.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林利军</u>	<u>陈灿辉</u>	<u>王小练</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]1875 号文《关于核准汇添富保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）作为发起人于 2011 年 1 月 4 日至 2011 年 1 月 24 日向社会公开募集，基金合同于 2011 年 1 月 26 日正式生效。首次设立募集规模为 2,506,696,469.30 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金将按照投资组合保险技术的要求动态调整保本资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现基金资产在保本基础上的保值增值目的；在此基础上将通过严谨的量化分析和翔实的实地调研，精选优质股票和债券进行投资布局，以实现基金资产最大限度的增值。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、

《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2014 年 1 月 27 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准, 财政部、国家税务总局研究决定, 自 2008 年 4 月 24 日起, 调整证券(股票)交易印花税税率, 由原先的 3% 调整为 1%;

经国务院批准, 财政部、国家税务总局研究决定, 自 2008 年 9 月 19 日起, 调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税, 受让方不再征收, 税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 1 月 27 日
活期存款	746,658,073.36
定期存款	170,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限小于 1 个月	170,000,000.00
其他存款	-
合计：	916,658,073.36

6.4.7.2 交易性金融资产

注：本基金本期末未持有交易性金融资产。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年1月27日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	300,000,000.00	-
合计	300,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年1月27日
应收活期存款利息	35,464.21
应收定期存款利息	1,057,777.78
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,599.66
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	310.06
合计	1,095,151.71

注：“其他”为结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年1月27日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	6,684.44

合计	6,684.44
----	----------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 1 月 27 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	876.21
预提信息披露费	145,150.77
预提审计费	85,917.86
合计	231,944.84

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,051,697,428.43	1,051,697,428.43
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	572,728.22	572,728.22
本期赎回（以“-”号填列）	-101,207,669.64	-101,207,669.64
本期末	951,062,487.01	951,062,487.01

6.4.7.10 未分配利润

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,115,182.26	-2,334,828.74	60,780,353.52
本期利润	5,381,379.13	-1,257,671.34	4,123,707.79
本期基金份额交易产生的变动数	-6,309,136.55	225,346.40	-6,083,790.15
其中：基金申购款	35,179.47	-933.34	34,246.13
基金赎回款	-6,344,316.02	226,279.74	-6,118,036.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,187,424.84	-3,367,153.68	58,820,271.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月27日
活期存款利息收入	33,027.80
定期存款利息收入	1,025,069.42
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	631.86
其他	207.06
合计	1,058,936.14

注：表中“其他”为保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月27日
卖出股票成交总额	588,678.24
减：卖出股票成本总额	601,799.00
买卖股票差价收入	-13,120.76

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月27日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	898,151,180.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	869,310,058.85
减：应收利息总额	25,909,956.51
债券投资收益	2,931,164.99

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期未投资资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期未有股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年1月27日
1. 交易性金融资产	-1,257,671.34
——股票投资	-
——债券投资	-1,257,671.34
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,257,671.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月27日
基金赎回费收入	241,902.16
合计	241,902.16

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月27日
交易所市场交易费用	2,535.68
银行间市场交易费用	4,950.00
合计	7,485.68

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日
审计费用	5,917.86
信息披露费	25,150.77
其他费用	600.00
银行划款费用	555.00
帐户维护费	9,000.00
合计	41,223.63

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年1月27日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东方证券股份 有限公司	1,190,477.24	100.00%	1,287,084,142.71	97.43%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年1月27日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东方证券股份 有限公司	32,935,307.46	23.76%	310,175,448.49	95.47%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年1月27日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东方证券股份 有限公司	156,100,000.00	12.66%	3,933,270,000.00	95.13%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年1月27日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东方证券股份 有限公司	1,053.46	100.00%	1,053.46	100.00%

关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东方证券股份 有限公司	1,161,027.37	97.46%	679,687.01	99.59%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券
 结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包
 括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月 27日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	955,287.82	8,282,990.72
其中：支付销售机构的客 户维护费	360,810.37	3,123,646.72

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2% 的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.2\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管
 理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管
 理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年1月27日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	159,214.62	1,380,498.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期及上年度可比期间本公司未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年1月27日		2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	746,658,073.36	33,027.80	1,284,442.89	72,970.34

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2014年1月1日至2014年1月27日获得的利息收入为人民币 631.86 元(2013 半年度：人民币 37,961.27 元)，2014 年 1 月 27 日结算备付金余额为人民币 316,311.71 元(2013 半年末：人民币 5,147,103.05 元)。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 1 月 27 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构

进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2014 年1 月 27 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	916,658,073.36						916,658,073.36

结算 备付 金	316,311.71						316,311.71
存出 保证 金	163,002.73						163,002.73
交易 性金 融资 产							
买入 返售 金融 资产	300,000,000.00						300,000,000.00
应收 利息						1,095,151.71	1,095,151.71
应收 申购 款	28,546.13						28,546.13
资产 总计	1,217,165,933.93					1,095,151.71	1,218,261,085.64
负债							
卖出 回购 金融 资产 款							
应付 证券 清算 款						199,950,507.38	199,950,507.38
应付 赎回 款						7,074,688.37	7,074,688.37
应付 管理 人报 酬						955,287.82	955,287.82
应付 托管 费						159,214.62	159,214.62
应付 销售 服务							

费							
应付交易费用						6,684.44	6,684.44
应付利息							
其他负债						231,944.84	231,944.84
负债总计						208,378,327.47	208,378,327.47
利率敏感度缺口	1,217,165,933.93					-207,283,175.76	1,009,882,758.17
本期末 2013 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	196,742,946.16	-	-	-	-	-	196,742,946.16
结算备付金	2,150,766.56	-	-	-	-	-	2,150,766.56
存出保证金	228,980.75	-	-	-	-	-	228,980.75
交易性金融资产	241,483,000.00	309,611,845.70	312,693,440.00	1,347,492.60	5,432,708.40	-	870,568,486.70
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,500,833.33	1,500,833.33
应收	-	-	-	-	-	24,324,507.32	24,324,507.32

利息							
应收申购款	396.91	-	-	-	-	39,750.81	40,147.72
资产总计	460,606,090.38	309,611,845.70	312,693,440.00	1,347,492.60	5,432,708.40	25,865,091.46	1,115,556,668.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,496,274.81	1,496,274.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,145,371.12	1,145,371.12
应付托管费	-	-	-	-	-	190,895.22	190,895.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	34,464.50	34,464.50
其他负债	-	-	-	-	-	211,880.94	211,880.94
负债总计	-	-	-	-	-	3,078,886.59	3,078,886.59
利率敏感度缺口	460,606,090.38	309,611,845.70	312,693,440.00	1,347,492.60	5,432,708.40	22,786,204.87	1,112,477,781.95

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：汇添富保本混合型证券投资基金的利率风险的敏感性与基金所持有的债券有关，由于双利债转型期末即 2014 年 1 月 27 日未有债券持仓，故不做利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。汇添富保本混合型证券投资基金期末未持有交易性金融资产。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

注：汇添富保本混合型证券投资基金的市场价格敏感性与基金所持有的股票，可转债有关，由于汇添富保本混合型证券投资基金期末（2014 年 1 月 27 日）未有股票持仓与可转债持仓，故不做其他价格风险的敏感性分析。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)**6.1 资产负债表（转型后）**

会计主体：汇添富双利债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	转型后至报告期末
资产：		
银行存款	6.4.7.1	188,794.90
结算备付金		1,053,778.69
存出保证金		35,686.75
交易性金融资产	6.4.7.2	254,222,415.61
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		254,222,415.61
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		2,572,042.00
应收利息	6.4.7.5	4,258,836.59
应收股利		-
应收申购款		10,930.00

递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		262,342,484.54
负债和所有者权益	附注号	转型后至报告期末
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		81,599,733.60
应付证券清算款		947.60
应付赎回款		1,240,682.15
应付管理人报酬		106,143.14
应付托管费		30,326.60
应付销售服务费		0.55
应付交易费用	6.4.7.7	4,683.28
应交税费		-
应付利息		17,632.40
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	208,277.44
负债合计		83,208,426.76
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	163,407,590.31
未分配利润	6.4.7.10	15,726,467.47
所有者权益合计		179,134,057.78
负债和所有者权益总计		262,342,484.54

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额总额 163,407,590.31 份。其中 A 类基金份额总额 163,398,594.31 份，份额净值 1.096 元；C 类基金份额总额 8,996.00 份，份额净值 1.004 元。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：汇添富双利债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		7,859,191.37
1. 利息收入		4,178,198.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	139,127.88

债券利息收入		3,594,106.83
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		444,963.30
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,563.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-18,563.38
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,696,257.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,299.63
减：二、费用		1,445,269.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	684,205.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	191,534.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	0.55
4. 交易费用	6.4.7.19	5,758.88
5. 利息支出		369,366.08
其中：卖出回购金融资产支出		369,366.08
6. 其他费用	6.4.7.20	194,404.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,413,922.06

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富双利债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	951,062,487.01	58,820,271.16	1,009,882,758.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,413,922.06	6,413,922.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-787,654,896.70	-49,507,725.75	-837,162,622.45

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	2,791,706.40	207,704.99	2,999,411.39
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-790,446,603.10	-49,715,430.74	-840,162,033.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	163,407,590.31	15,726,467.47	179,134,057.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

林利军	陈灿辉	王小练
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富双利债券型证券投资基金(以下使用其全称或简称“本基金”)由汇添富保本混合型证券投资基金转型而来。汇添富保本混合型证券投资基金的保本周期期限为三年，自汇添富保本混合型证券投资基金基金合同生效日(即2011年1月26日)起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即2014年1月27日为本基金保本周期到期日。汇添富保本混合基金保本周期到期，按照本基金基金合同的约定变更为非保本的债券型基金，即“汇添富双利债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为“470018”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

为了更好地满足投资者的理财需求，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，汇添富基金管理股份有限公司决定自2014年6月18日起对汇添富双利债券型证券投资基金增设C类基金份额类别(C类基金份额代码：000692)及相应的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)，A类基金份额代码保持不变为“470018”，并相应修改基金合同。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离债券、债券回购、短期融资券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。本基金80%以上的基金资产投资于固定收益类金融工具，其中本基金持有的公司债、企业债、可转换债券、金融债、资产支持证券、

短期融资券等非国家信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 30%；本基金还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但上述非固定收益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）起至 2014 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃

市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以

相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(9) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提;

(3) 本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费, C 类基金份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率计提。

(4) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 6 次,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 10%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	188,794.90
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	188,794.90

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	109,450,680.56	110,958,415.61	1,507,735.05
	银行间市场	141,075,477.94	143,264,000.00	2,188,522.06
	合计	250,526,158.50	254,222,415.61	3,696,257.11
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		250,526,158.50	254,222,415.61	3,696,257.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	2,881.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	426.78
应收债券利息	4,255,514.06
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.40
合计	4,258,836.59

注：“其他”为结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	4,683.28
合计	4,683.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.55
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费	168,603.31
合计	208,277.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期初	951,062,487.01	951,062,487.01
- 基金份额折算调整		
- 未领取红利份额折算调整（若有）		
- 集中申购募集资金本金及利息		
- 基金拆分和集中申购完成后		
本期申购	2,791,706.40	2,791,706.40
本期赎回（以“-”号填列）	-790,446,603.10	-790,446,603.10
本期末	163,407,590.31	163,407,590.31

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	62,187,424.84	-3,367,153.68	58,820,271.16
本期利润	2,717,664.95	3,696,257.11	6,413,922.06
本期基金份额交易产生的变动数	-51,958,134.40	2,450,408.65	-49,507,725.75
其中：基金申购款	200,322.03	7,382.96	207,704.99

基金赎回款	-52,158,456.43	2,443,025.69	-49,715,430.74
本期已分配利润			
本期末	12,946,955.39	2,779,512.08	15,726,467.47

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期	
	2014年1月28日至2014年6月30日	
活期存款利息收入	110,350.31	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	28,200.98	
其他	576.59	
合计	139,127.88	

注：表中“其他”指直销申购款和保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本期末未投资股票。

6.4.7.13 债券投资收益

项目	本期	
	2014年1月28日至2014年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	194,204,647.65	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	190,881,098.85	
减：应收利息总额	3,342,112.18	
债券投资收益	-18,563.38	

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期末未投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期末有股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,696,257.11
——股票投资	-
——债券投资	3,696,257.11
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,696,257.11

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,299.63
合计	3,299.63

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	508.88
银行间市场交易费用	5,250.00
合计	5,758.88

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	33,753.72
信息披露费	143,452.54
其他费用	-
银行划款费用	8,197.83
帐户维护费	9,000.00

合计	194,404.09
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

6.4.10 本报告期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月28日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期回购债券 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	94,015,508.36	100.00%

6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	3,146,744,000.00	89.10%

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本期末未支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日
	当期应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	338,025.32

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.7% 的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日
	当期应支付的托管费

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富双利债券 A	汇添富双利债券 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	0.55	0.55
合计	-	0.55	0.55

本基金销售服务费按前一日 C 类份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类份额的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期本公司未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	188,794.90	143,378.11

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 28,200.98 元，2014 年半年末结算备付金余额为人民币 6,374,271.57 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额
112208	14 华邦 01	2014 年 6 月 17 日	-	新债未上市	99.93	99.93	150,000	14,989,183.56	14,989,183.56
124555	14 余城建	2014 年 3 月 4 日	2014 年 3 月 24 日	新债未上市	100.00	100.00	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00
128006	长青转债	2014 年 6 月 25 日	2014 年 7 月 9 日	新债未上市	99.99	99.99	9,790	978,922.75	978,922.75

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、部分应收申购款、买入返售金融资产及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2014年6月30 日	1个月以内	1-3个月	6个月 以内	3个月-1年	6个月-1 年	1年 以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	188,794.90	-	-	-	-	-	-	-	-	188,794.90
结算备付金	1,053,778.69	-	-	-	-	-	-	-	-	1,053,778.69
存出保证金	35,686.75	-	-	-	-	-	-	-	-	35,686.75
交易性金融资 产	-	1,186,900.00	-	86,958,263.85	-	-	82,035,176.36	84,042,075.40	-	254,222,415.61
应收证券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,572,042.00	2,572,042.00
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	4,258,836.59	4,258,836.59
应收申购款	4,970.18	-	-	-	-	-	-	-	5,959.82	10,930.00
资产总计	1,283,230.52	1,186,900.00	-	86,958,263.85	-	-	82,035,176.36	84,042,075.40	6,836,838.41	262,342,484.54
负债										
卖出回购金融 资产款	81,599,733.60	-	-	-	-	-	-	-	-	81,599,733.60
应付证券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	-	947.60	947.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,240,682.15	1,240,682.15
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	-	-	-	106,143.14	106,143.14
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	30,326.60	30,326.60
应付销售服务 费	-	-	-	-	-	-	-	-	0.55	0.55
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	4,683.28	4,683.28
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	17,632.40	17,632.40
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	208,277.44	208,277.44
负债总计	81,599,733.60	-	-	-	-	-	-	-	1,608,693.16	83,208,426.76
利率敏感度缺 口	-80,316,503.08	1,186,900.00	-	86,958,263.85	-	-	82,035,176.36	84,042,075.40	5,228,145.25	179,134,057.78

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假 设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变

	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；	
	银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；	
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2014 年 6 月 30 日）
	0.25%	-1,332,637.11
	-0.25%	1,350,543.59

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	254,222,415.61	141.92
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	254,222,415.61	141.92

注：本基金投资组合中债券投资比例范围为基金资产净值的 60%-100%；股票为 0%-40%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关	
	对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；	
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2014年6月30日）
	5%	663,196.28
	-5%	-663,196.28

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告(转型前)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	300,000,000.00	24.63
	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	916,974,385.10	75.26
7	其他资产	1,286,700.57	0.11
8	合计	1,218,261,085.64	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	601,799.00	0.34

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	588,678.24	0.05

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	601,799.00
卖出股票收入（成交）总额	588,678.24

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本期末未持有债券。

7.6 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：本基金本期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本期末未持有贵金属。

7.9 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：本基金本期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现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、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	163,002.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,095,151.71

5	应收申购款	28,546.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,286,700.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末未持有股票。

§ 7 投资组合报告(转型后)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	254,222,415.61	96.90
	其中：债券	254,222,415.61	96.90
	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	1,242,573.59	0.47
7	其他资产	6,877,495.34	2.62
8	合计	262,342,484.54	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未投资股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	22,016,500.00	12.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,582,000.00	28.80
	其中：政策性金融债	51,582,000.00	28.80
4	企业债券	86,932,658.36	48.53
5	企业短期融资券	40,228,000.00	22.46
6	中期票据	10,095,000.00	5.64
7	可转债	43,368,257.25	24.21
8	其他	-	-
9	合计	254,222,415.61	141.92

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	140409	14 农发 09	200,000	20,678,000.00	11.54
2	140001	14 付息国债 01	200,000	20,512,000.00	11.45
3	041472002	14 深地铁 CP002	200,000	20,186,000.00	11.27
4	041452030	14 国电集 CP003	200,000	20,042,000.00	11.19
5	112208	14 华邦 01	150,000	14,989,183.56	8.37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期期末未持有股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期期末未持有股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,686.75

2	应收证券清算款	2,572,042.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,258,836.59
5	应收申购款	10,930.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,877,495.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	9,558,400.00	5.34
2	110015	石化转债	9,321,050.10	5.20
3	113003	重工转债	7,954,878.00	4.44
4	113005	平安转债	7,052,256.40	3.94
5	113001	中行转债	4,376,970.00	2.44
6	110024	隧道转债	1,186,900.00	0.66

7.12.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息(转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
11,770	80,803.95	3,539,359.49	0.37%	947,523,127.52	99.63%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0	0.00%

本基金的基金管理人从业人员本报告期末未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况#

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 8 基金份额持有人信息(转型后)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富双利债券 A	4281	38,168.32	59,409.24	0.04%	163,339,185.07	99.96%
汇添富双利债券 C	3	2,998.67	-	0.00%	8,996.00	100%
合计	4284	38,143.70	59,409.24	0.04%	163,348,181.07	99.96%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富双利债券 A	0	0
	汇添富双利债券 C	0	0
	合计	0	0

本基金的基金管理人从业人员本报告期末未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富双利债券 A	0
	汇添富双利债券 A	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富双利债券 A	0
	汇添富双利债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

转型前

基金合同生效日(2011 年 1 月 26 日)的基金份额总额	2,506,696,469.30
本报告期期初基金份额总额	1,051,697,428.43
本报告期基金总申购份额	572,728.22
减：本报告期基金总赎回份额	101,207,669.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	951,062,487.01

转型后

项目	汇添富双利债券 A	汇添富双利债券 C
----	-----------	-----------

基金合同生效日(2011 年 1 月 26 日)的基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	951,062,487.01	
本报告期基金总申购份额	2,782,710.40	8,996.00
减：本报告期基金总赎回份额	790,446,603.10	
本报告期基金拆分变动份额		
本报告期期末基金份额总额	163,398,594.31	8,996.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤从珊女士担任汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤从珊女士担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

3、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘陆文磊先生担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。同时，陈加荣先生不再担任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘何旻先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

5、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 6 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2014 年 3 月 28 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理，与齐东超先生共同管理该基金。

7、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，汇添富成长焦点股票型证券投资基金由雷鸣先生单独管理，齐东超先生不再管理该基金。

8、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘朱晓亮先生担任汇添富民营活力股票型证券投资基金的基金经理。同时，齐东超先生不再担任该基金的基金经理。

9、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘顾耀强先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生、叶从飞先生、朱晓亮先生共同管理该基金。

10、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 5 月 28 日正式生效，汤从珊女士任该基金的基金经理。

11、本报告期内，因基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

2014 年 1 月 28 日原“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”。汇添富双利债券的投资目标、投资范围、投资策略请详见本公司刊登在 2014 年 1 月 24 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司网站的《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
中国中投	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	94,015,508.36	100.00%	3,146,744,000.00	89.10%	-	-
国泰君安	-	-	385,000,000.00	10.90%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中国中投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 32 个交易单元与汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金共用。本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	1,190,477.24	100.00%	1,053.46	100.00%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
中国中投	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
信达债券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	32,935,307.46	23.76%	156,100,000.00	12.66%	-	-
国泰君安	105,680,716.57	76.24%	1,077,000,000.00	87.34%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中国中投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
信达债券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 32 个交易单元与汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金共用。本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富双利增强债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 29 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鑫鼎盛为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 2 月 14 日
3	关于汇添富双利债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 2 月 15 日
4	汇添富现金宝理财服务澄清公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 2 月 25 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加太平洋证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 3 月 7 日
6	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2014	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2014 年 3 月 12 日

	年第 1 号)	理人网站	
7	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书(2014 年第 1 号)	管理人网站	2014 年 3 月 12 日
8	汇添富保本混合型证券投资基金 2013 年年度报告	管理人网站	2014 年 3 月 26 日
9	汇添富保本混合型证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 3 月 26 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与中金公司开展的申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 4 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于客服中心变更办公地址的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 10 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 11 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 21 日
14	汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 22 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 6 月 10 日

16	汇添富基金汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大同证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 6 月 11 日
17	关于汇添富双利债券型证券投资基金增设基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 6 月 17 日

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于调整现金宝快速取现业务规则的公告	管理人网站	2014 年 1 月 1 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2013 年年度资产净值的公告	管理人网站	2014 年 1 月 2 日
3	关于汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及汇添富双利债券型证券投资基金转型后运作相关业务规则的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 16 日
4	关于汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期转型的第一次提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 17 日
5	汇添富保本混合型证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 20 日
6	关于汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期转型的第	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2014 年 1 月 24 日

	二次提示性公告	理人网站	
7	汇添富双利债券型证券投资基金基金合同	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 24 日
8	汇添富双利债券型证券投资基金托管协议	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据《基金合同》规定, 汇添富保本混合型证券投资基金的保本周期为三年, 自《基金合同》生效日 (即 2011 年 1 月 26 日) 起开始保本周期, 到三年后对应日止 (如该对应日为非工作日, 保本周期到期日顺延至下一个工作日)。本基金对应日 2014 年 1 月 26 日为非工作日, 则下一工作日 2014 年 1 月 27 日为本基金保本周期到期日。汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期后, 已按照《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》的约定变更为非保本的债券型基金, 即“汇添富双利债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变, 基金代码亦保持不变为“470018”。转型后基金的投资目标、投资策略及基金费率等按照《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

有关汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为汇添富双利债券型证券投资基金后的相关运作业务规则详情请查阅本基金管理人 2014 年 1 月 16 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及汇添富双利债券型证券投资基金转型后运作相关业务规则的公告》及刊登于 2014 年 1 月 27 日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的汇添富双利债券型证券投资基金的《基金合同摘要》、《招募说明书》等。投资者亦可通过本基金管理人网站或相关代销机构查阅汇添富双利债券型证券投资基金的相关基金法律文件。

§ 12 备查文件目录

12.1 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、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各项公告的原稿。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 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 8 月 25 日