

# 汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年年 度报告

2014 年 12 月 31 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：2015 年 3 月 31 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 2015 年 3 月 27 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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.2 基金产品说明.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	10
3.2 基金净值表现.....	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	16
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	25
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	25
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.....	27
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	28
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	28
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	29
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	29
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	29
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>30</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	30
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.....	30
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.....	30
<b>§6 审计报告(转型前)</b> .....	<b>30</b>
<b>§6 审计报告(转型后)</b> .....	<b>31</b>
<b>§7 年度财务报表(转型前)</b> .....	<b>32</b>
7.1 资产负债表(转型前).....	32
7.2 利润表.....	33
7.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	34
7.4 报表附注.....	36
<b>§7 年度财务报表(转型后)</b> .....	<b>63</b>
7.1 资产负债表(转型后).....	63
7.2 利润表.....	64
7.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	65
7.4 报表附注.....	66

<b>§8 投资组合报告(转型前)</b> .....	<b>89</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	89
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	90
8.3 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.....	90
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
8.6 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.....	90
8.7 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.....	90
8.8 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.....	91
8.9 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.....	91
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
8.11 投资组合报告附注.....	91
<b>§8 投资组合报告(转型后)</b> .....	<b>92</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	92
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	92
8.3 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).....	93
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	93
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	94
8.6 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.....	94
8.7 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.....	95
8.8 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.....	95
8.9 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.....	95
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	95
8.11 投资组合报告附注.....	95
<b>§9 基金份额持有人信息(转型前)</b> .....	<b>96</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	96
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	97
9.3 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.....	97
<b>§9 基金份额持有人信息(转型后)</b> .....	<b>97</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	97
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	97
9.3 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.....	98
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>98</b>
转型前.....	98
转型后.....	98
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>99</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	99
11.2 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.....	99
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	100
11.4 基金投资策略的改变.....	100
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	101
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	101
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后).....	101
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前).....	103
11.8 其他重大事件 (转型后).....	105

11.8 其他重大事件（转型前） .....	109
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>110</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>111</b>
13.1 备查文件目录.....	111
13.2 存放地点.....	111
13.3 查阅方式.....	111

## § 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	122,963,840.50 份
基金合同存续期（若有）	不定期

注：上表中“报告期末”指 2014 年 12 月 31 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	蒋松云
	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

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	2014 年 1 月 1 日 -2014 年 1 月 27 日 (转型前)	2014 年 1 月 28 日-2014 年 12 月 31 日		2013 年	2012 年
		双利债券 A (转 型后)	双利债券 C (转 型后)		
本期已 实现收 益	5,381,379.13	16,745,243.26	95,933.62	23,722,666.78	36,778,913.38
本期利 润	4,123,707.79	32,664,502.46	213,613.66	11,506,824.31	67,130,158.28
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0041	0.1885	0.2381	0.0095	0.0397
本期加 权平均 净值利 润率	0.38%	17.09%	22.03%	0.90%	3.83%
本期基 金份额 净值增 长率	0.38%	21.75%	18.40%	0.76%	3.75%
3.1.2 期末数 据和指 标	2014 年 1 月 27 日	2014 年末		2013 年末	2012 年末
期末可 供分配 利润	58,820,271.16	22,201,330.18	160,458.94	60,780,353.52	58,071,643.39



期末可供分配基金份额利润	0.0618	0.1831	0.0951	0.0578	0.0407
期末基金资产净值	1,009,882,758.17	156,868,460.19	1,997,478.01	1,112,477,781.95	1,498,338,376.15
期末基金份额净值	1.062	1.293	1.184	1.058	1.050
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	本期末 2014年1月27日	2014年末		2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	6.20%	21.75%	18.40%	5.80%	5.00%

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 1 年。

4、汇添富双利债券型证券投资基金自 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

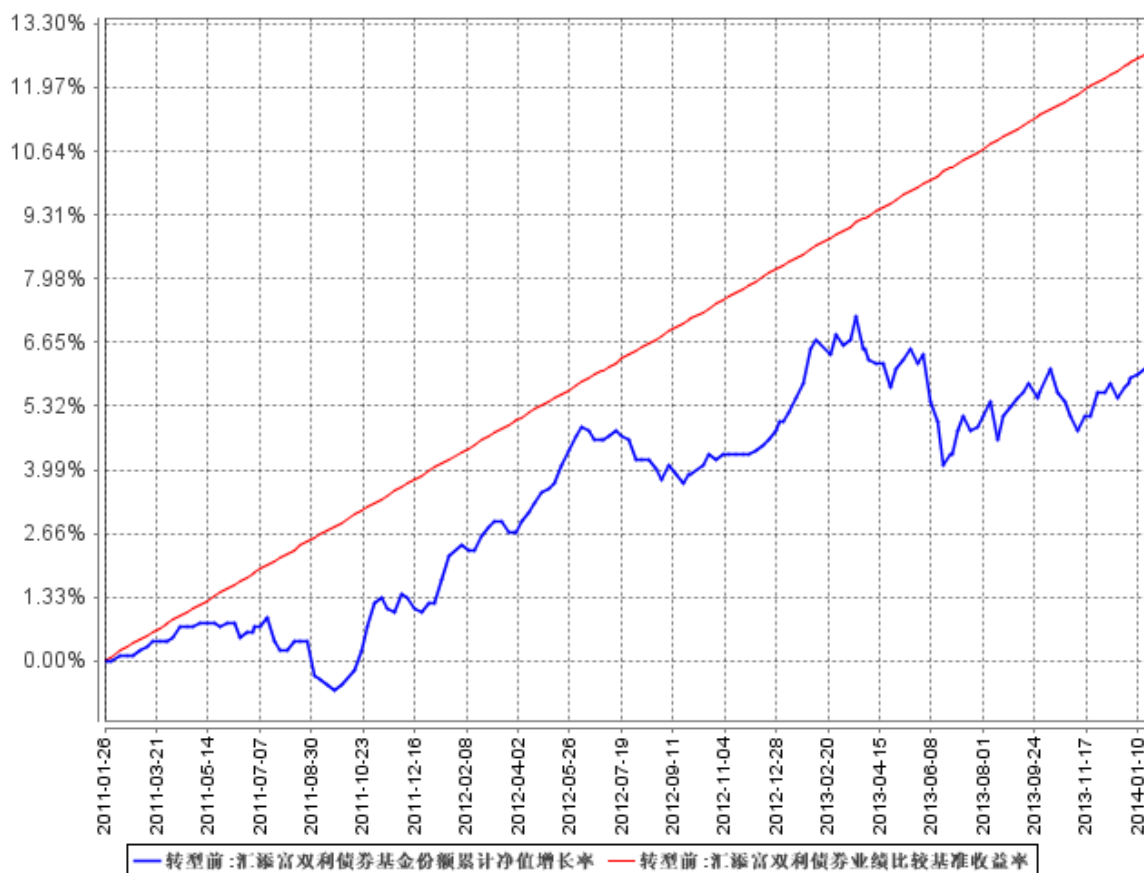
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 2013-10-28 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

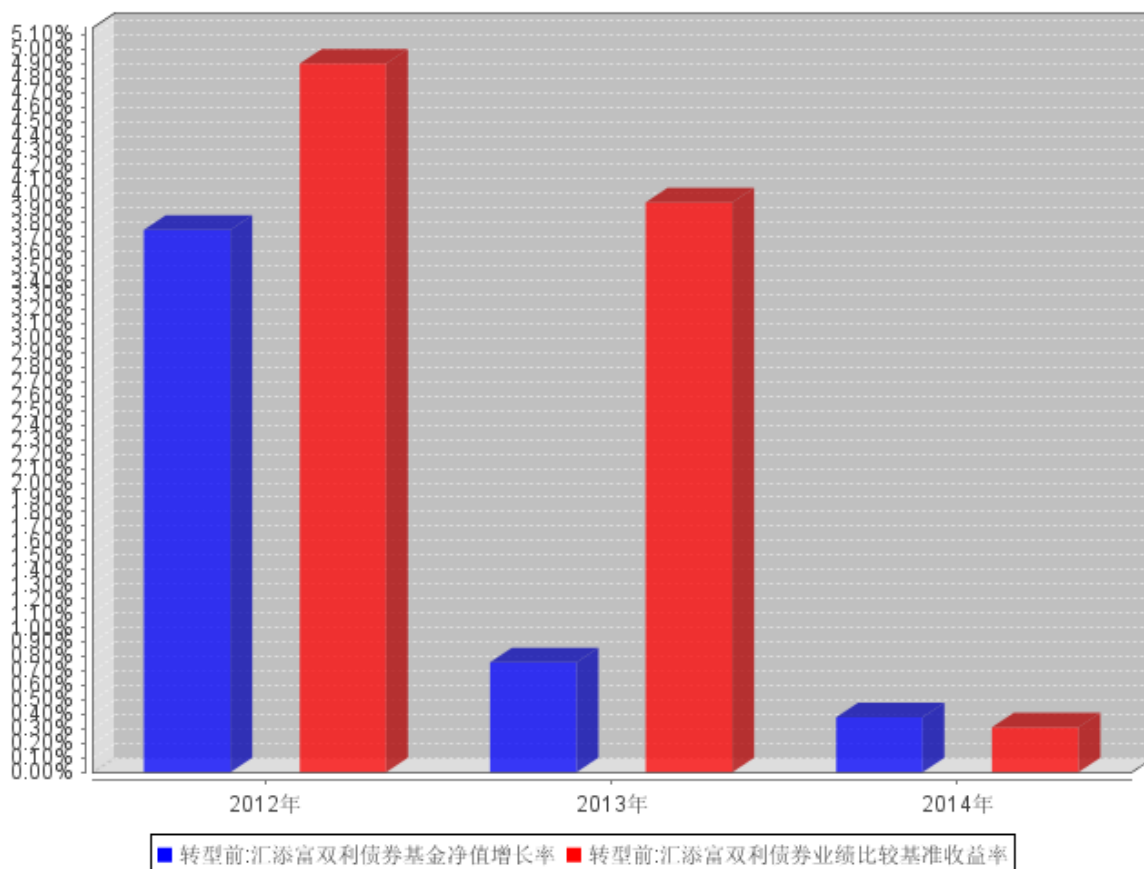
汇添富双利债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富双利债券自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2014 年 1 月 27 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算，基金转型当年的净值增长率按照当年基金转型前的实际存续期计算。

## 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
过去三个月	13.72%	0.83%	1.66%	0.17%	12.06%	0.66%
过去六个月	17.97%	0.60%	2.37%	0.13%	15.60%	0.47%
自基金合同生效日起至今	21.75%	0.45%	5.71%	0.11%	16.04%	0.34%
双利债券 C (转型后)						
阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④

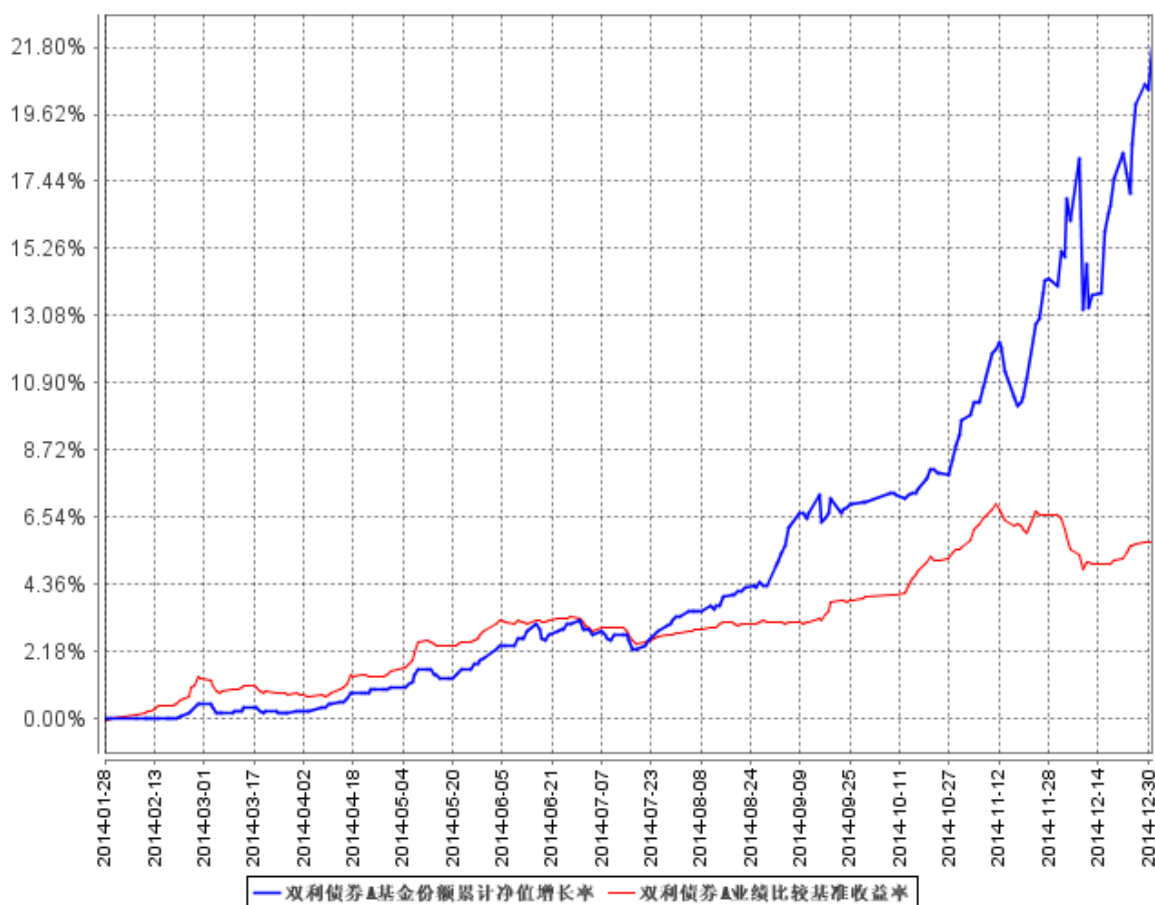
	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	13.85%	0.83%	1.66%	0.17%	12.19%	0.66%
过去六个月	17.93%	0.60%	2.37%	0.13%	15.56%	0.47%
自基金合同生效日起至今	18.40%	0.58%	2.43%	0.13%	15.97%	0.45%

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。

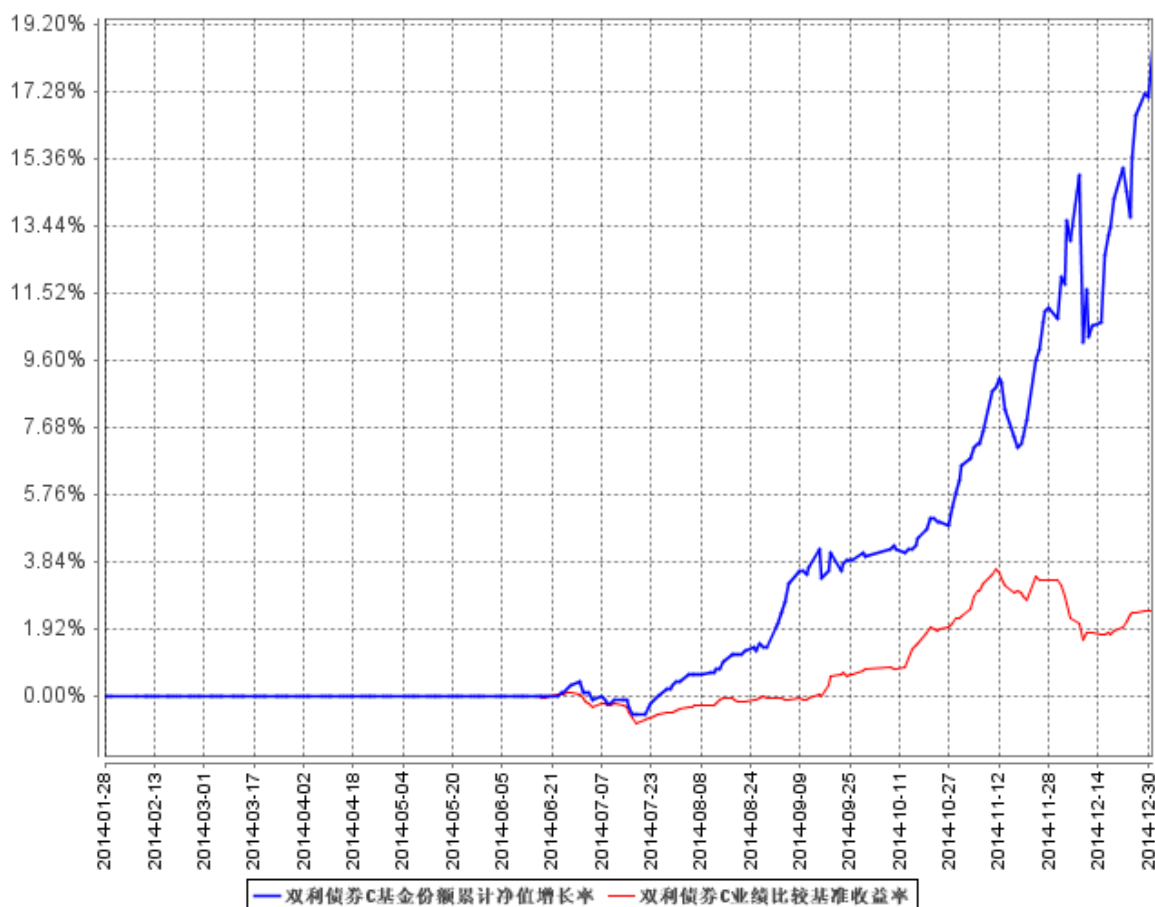
2、过去三个月指 2014 年 10 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日，过去六个月指 2014 年 7 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日。

### 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

双利债券A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



双利债券C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



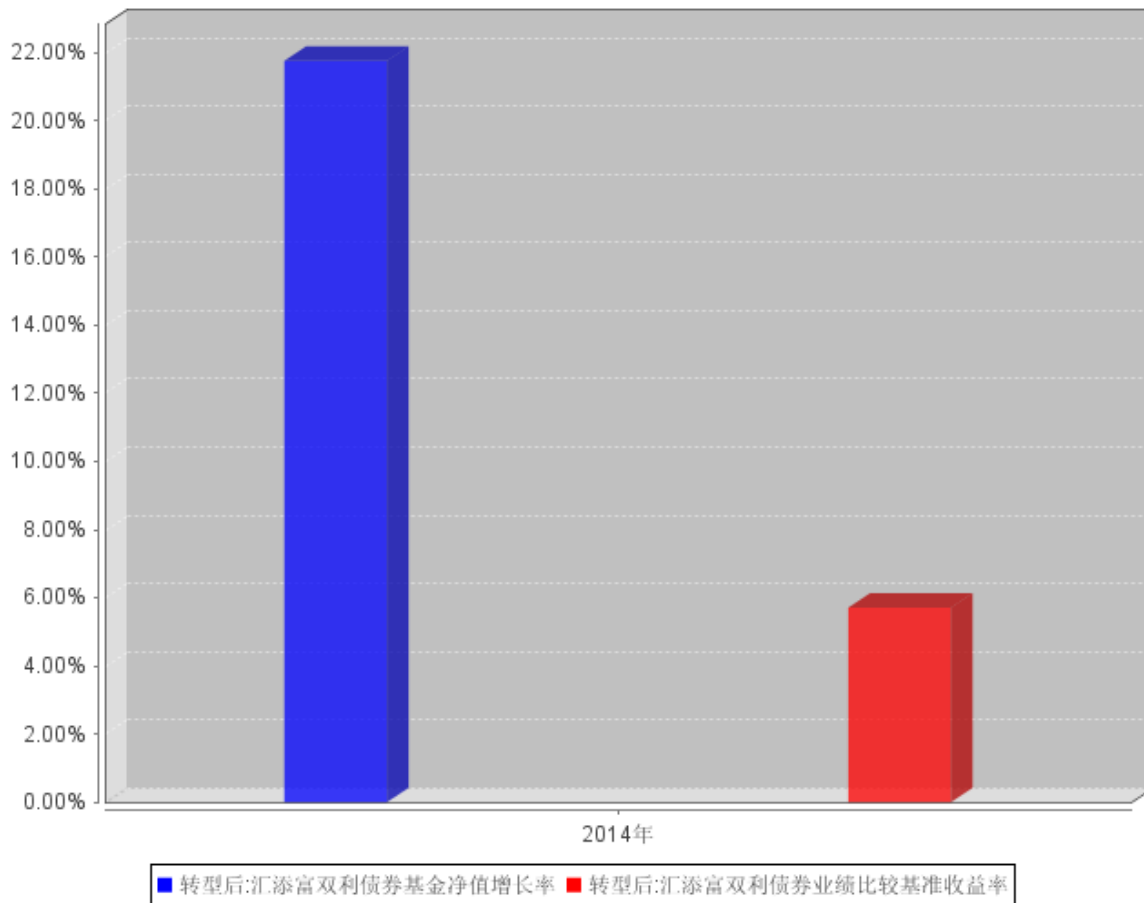
注：1、汇添富双利债券型证券投资基金由汇添富保本混合型证券投资基金转型而来，基金转型日（即 2014 年 1 月 28 日）至报告期期末，汇添富双利债券型证券投资基金转型时间未满一年。汇添富双利债券型证券投资基金的投资转型期为汇添富保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日（即 2014 年 1 月 28 日）起的 6 个月。截至投资转型期结束，汇添富双利债券型证券投资基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

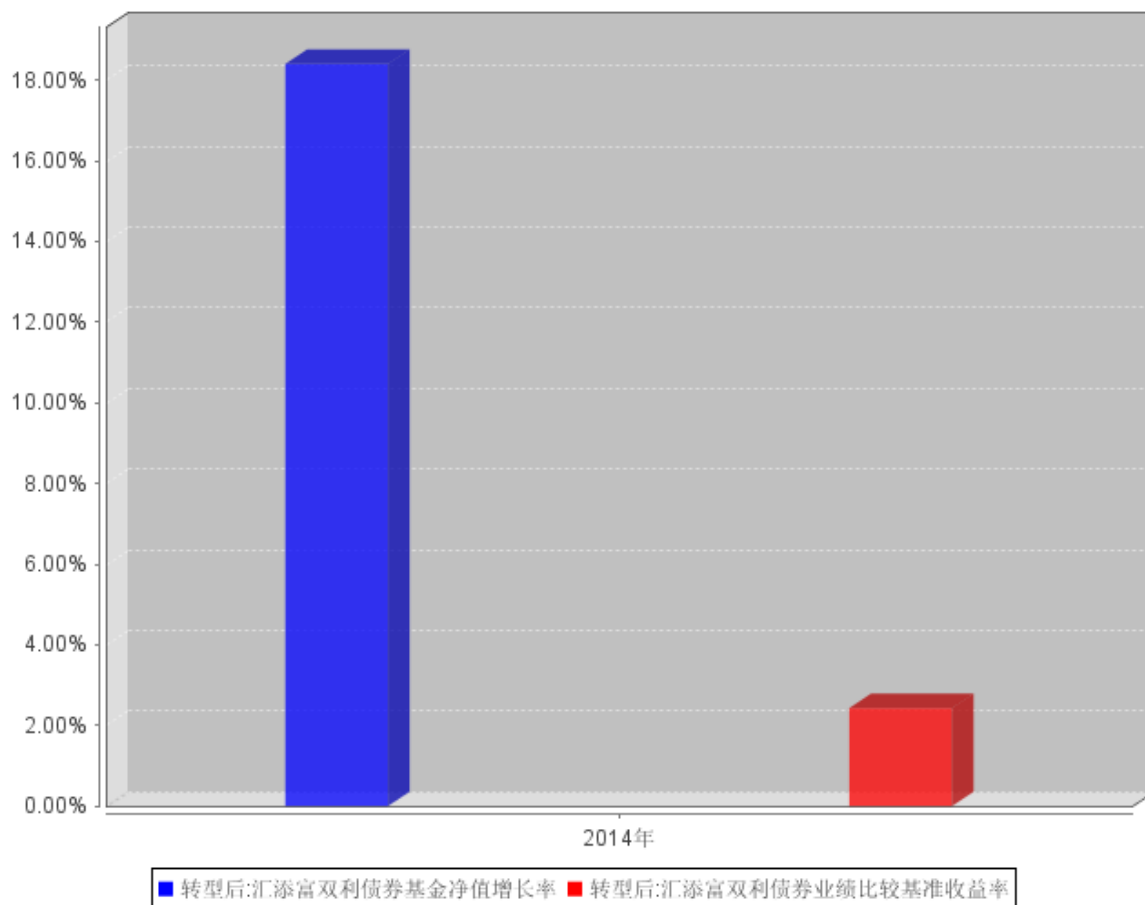
双利债券 A (转型后)

汇添富双利债券基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



双利债券 C (转型后)

汇添富双利债券基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：图示日期为 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日。基金转型当年的净值增长率按照当年基金转型后的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金成立于 2011 年 1 月 26 日，2011 年度、2012 年度、2013 年度和 2014 年度均未进行利润分配。

§ 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成立于 2005 年 2 月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京、南方以及上海虹桥机场三个分公司，以及两个子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司



(China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)和汇添富资本管理有限公司。

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII 业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人。在投资管理领域，汇添富已形成公募、专户、国际、养老金四大块业务以及股票、固定收益、被动投资、海外投资、另类投资五大块投资领域协同发展的格局。

截止 2014 年末，汇添富共管理 50 只证券投资基金，涵盖股票、指数、QDII、债券、货币市场基金等不同风险收益特征的产品。报告期内，汇添富共发行 6 只基金产品，包括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、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定地贯彻和执行。2014 年,汇添富取得了良好的整体投资业绩,准确把握市场节奏,精准布局产品线。旗下基金产品(除 QDII 产品)成立以来均实现正收益。其中逆向、美丽 30、价值、民营等基金位列全市场股票型基金前 1/4。

2014 年,汇添富专户业务快速发展,积极创新,推出了战略型定增专户、新股投资主题专户、海外市场 QDII 专户、企业现金管理专户等创新型产品。2014 年,公司成功获得包括国内全部大型保险公司在内的多家保险专户资格,获得多个专户组合并取得优异投资业绩。

2014 年,汇添富积极协助社保理事会研发新投资品种、参与社保产品设计和改造,并加强社保组合投资管理工作。目前公司的社保组合已经涵盖了股票、债券等品种,整体投资业绩优良。

2014 年,汇添富国际业务继续向前推进,香港子公司各项业务继续顺利推进,并成功发行添富主要消费 RQFII ETF 和医药 RQFII ETF,以及 RQFII 货币市场基金。同时加强国际机构合作,在北欧、中东都有业务推进。

2014 年,汇添富电子商务业务继续坚持“两条腿走路”,一方面加强公司官网直销能力优化客户体验,一方面继续加强跨界合作,目前汇添富电商合作伙伴已达 11 家。2014 年,“现金宝”品牌影响力进一步加强,现金宝 APP 成为下载和使用排名前十位的理财类手机应用中唯一由基金公司开发的应用。

2014 年,汇添富资本子公司发展良好,大力开展各类创新业务,推出按揭贷款收益权和供应链融资等创新业务。同时完成了大批规章制度和业务指引的修订,有力地保障公司运营合法有序。

公司在 2014 年还涉足一级市场业务，积极参与了绿地集团增资扩股项目，成为第一家介入一级市场并参与国企改革的公募基金公司。

2014 年，汇添富持续开展贴心的投资者服务与教育工作。公司围绕向“现代财富管理机构”转型的思路，从不同类型客户的切身需求出发，大力建设投顾式客户服务体系；同时，公司进一步着力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2014 年，汇添富社会责任事业进一步深入开展。“河流·孩子”助学计划启动第七季活动，公司公益基金会捐资在青海省海东地区互助县建设“添富小学”；为添富小学校长及优秀乡村教师提供国内外知名教育机构的师资培训；“河流·孩子”公益纪录片成功在全国范围公映；“添富之爱 感恩十年”公益行走遍六所添富小学，让汇添富的业务伙伴更加深入了解了汇添富的感恩文化。

2014 年，汇添富荣获了包括金牛基金奖、上海市金融创新二等奖、最佳债券公司奖、上海市五一劳动奖状、模范职工之家等多个重要奖项，行业地位进一步彰显。

展望 2015 年，是中国改革深化的关键之年，“互联网+”正式写入政府工作报告，财富管理行业也将在互联网和移动互联网的催化之下发生更加剧烈的变化。2015 年我们将继续为实现汇添富的梦想奋勇前行、为筑造中国梦添砖加瓦！

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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，汇添富收益快线货币基金、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	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

	<p>金、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。</p>			<p>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。</p>
--	-------------------------------	--	--	--

					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。
朱晓亮	汇添富消费行业股票基金、汇添富均衡增长股票基金、汇添富民营活力股票基金的基金经理，汇添富双利债	2013年8月1日	-	7年	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。从业经历：2007年5

	券基金、 汇添富可 转换债券 基金的基 金经理助 理。			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。

### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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，汇添富收益快线货币基金、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、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。	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

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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。
朱晓亮	汇添富消费行业股票基金、汇添富均衡增长股票基金、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。	2013 年 8 月 1 日	-	7 年	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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机

会（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

#### 4.3.2 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。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部、集中交易室、投资研究部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的监控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3日、5日）同向交易的样本，利用统计分析的方法和工具，根据对样本个数、差价率是否为0的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等原因进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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%的交易次数共8次，其中因专户到期清盘发生2次、因基金流动性需要发生3次、因对冲策略发生3次，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 年总体上是个股债双牛的年份。上半年，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有的配套的资金投放，市场资金利率开始下行，其中利率债先行，高评级信用债随后跟进，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。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。3 季度开始，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。到 4 季度，延续 3 季度的逻辑，股债双牛的走势表现更为强劲，尤其可转债，中标可转债指数上涨 42%，利率债、信用债整体也不弱，12 月初，受中证登“加强回购风险管理办法”出台的影响，收益率短时间内大幅上扬，但很快重新回落，整个 4 季度一般债券收益率整体下行。全年看，7 年国开债收益率下行 175bp，7 年评级 AA 的固定利率企业债收益率下行 132bp，下半年，11 月底，由于中登事件的影响，收益率由 5.73 快速反弹到 6.54%。转债指数上涨 56%，且主要是在 4 季度完成。回顾全年，一般债券的运行逻辑主要还是经济偏弱、央行政策偏松有任务要降低融资成本、信用风险可控，转债方面，更多和权益市场联动，无风险利率下行以及风险偏好的上升应是主因。本报告期内，本基金根据不同阶段市场特点及时调整组合，上半年，及时加仓利率债，维持高仓位信用债，下半年逐步加仓可转债，尤其 4 季度果断大幅增仓可转债，为投资者赢得较好回报。未来，本基金管理将继续秉持“稳中求进”的原则，向“熊市稳得住，牛市冲得上”努力，为投资人争取稳健回报。

### 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 0.31%。

自 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日，汇添富双利债券型证券投资基金的 A 级净值增长率为 21.75%，同期业绩比较基准增长率为 5.71%。C 级净值增长率 18.40%，同期业绩比较基准增

长率为 2.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为了长治久安，为了国家的长期竞争力，转型、调结构会像反腐一样强力推进，手段也会不断创新，市场运行的逻辑也很可能再次以新的面目出现。展望后市，经济较差、政策偏松、改革加码的组合仍会持续，但由于股债均已大幅上涨，加之“期权”等投资工具的不断推陈出新，市场波动会加大，但整体上仍有一定的机会。城投债等债券的信用风险可能会有控制的暴露，但一定不会失控。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查 and 系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

##### （一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

##### （二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

##### （三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控

制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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、固定收益部、集中交易室、基金运营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，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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（原汇添富保本混合型证券投资基金）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（原汇添富保本混合型证券投资基金）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（原汇添富保本混合型证券投资基金）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（原汇添富保本混合型证券投资基金）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（原汇添富保本混合型证券投资基金）2014 年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 审计报告(转型前)

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的汇添富保本混合型证券投资基金财务报表，包括 2014 年 1 月 27 日（即《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》失效前日，以下简称“基金合同失效前日”）的资产负债表、2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。

	<p>中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富保本混合型证券投资基金 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	汤 骏 蔺育化
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2015 年 3 月 27 日

## § 6 审计报告（转型后）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富双利债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的汇添富双利债券型证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

	<p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	汤骏 蔺育化
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2015 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表(转型前)

### 7.1 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	本期末 2014 年 1 月 27 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	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	7.4.7.2	-	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	300,000,000.00	20,000,000.00



应收证券清算款		-	1,500,833.33
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,218,261,085.64	1,115,556,668.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年1月27日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	231,944.84	211,880.94
负债合计		208,378,327.47	3,078,886.59
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	951,062,487.01	1,051,697,428.43
未分配利润	7.4.7.10	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、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日），基金份额净值 1.062 元，基金份额总额 951,062,487.01 份。

3、自 2014 年 1 月 28 日起，原《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》生效。

## 7.2 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 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		5,287,704.25	34,071,822.79
1.利息收入		3,385,429.20	51,647,766.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,058,936.14	997,141.67
债券利息收入		1,805,141.32	49,714,788.78
资产支持证券利息收入		-	507,433.71
买入返售金融资产收入		521,351.74	428,402.70
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,918,044.23	-6,433,126.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-13,120.76	-11,752,789.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,931,164.99	4,457,929.46
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	30,231.12
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	831,502.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,257,671.34	-12,215,842.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	241,902.16	1,073,025.28
<b>减：二、费用</b>		1,163,996.46	22,564,998.48
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	955,287.82	15,479,877.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	159,214.62	2,579,979.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,485.68	2,734,514.95
5. 利息支出		784.71	1,313,229.30
其中：卖出回购金融资产支出		784.71	1,313,229.30
6. 其他费用	7.4.7.20	41,223.63	457,397.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,123,707.79	11,506,824.31

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 7.3 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 12 月 31 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）	-	11,506,824.31	11,506,824.31
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）	-375,730,923.29	-21,636,495.22	-397,367,418.51
其中：1. 基金申购款	12,094,957.64	729,236.63	12,824,194.27
2. 基金赎回款	-387,825,880.93	-22,365,731.85	-410,191,612.78
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）	1,051,697,428.43	60,780,353.52	1,112,477,781.95

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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)向社会公开发行募集,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。

根据《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止为基金保本周期(如保本周期届满的最后一日为非工作日,则保本周期到期日顺延至下一个工作日),由中国投资担保有限公司担任保证人,为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证。保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续,否则,本基金变更为非保本的债券型基金,基金名称相应变更为“汇添富双利债券型证券投资基金”。

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。

### 7.4.2 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修订的《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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 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。

#### 7.4.4.1 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 1 日至 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日）止。

#### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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及贷款和应收款项；

本基金目前未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产款和各类应收款项等。

##### (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均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项。

#### 7.4.4.4 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

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

卖出股票于交易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交易日结转；债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易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；

卖出债券于交易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；

## (2) 权证投资

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

卖出权证于交易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交易日结转；

## (3) 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；

## (4) 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。

### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 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) 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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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。

#### 7.4.4.10 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 1.20%的年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提；

(3) 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；

(4) 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。

#### **7.4.4.11 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) 本基金收益分配方式分两种：1) 保本周期内：仅采用现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；2) 转型后：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。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 1 月 27 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	746,658,073.36	1,742,946.16
定期存款	170,000,000.00	195,000,000.00
其中：存款期限小于 1 个月	-	25,000,000.00
存款期限 1-3 个月	170,000,000.00	170,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	-	-
其他存款	-	-
合计：	916,658,073.36	196,742,946.16

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 1 月 27 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	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 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	141,378,267.10	138,515,486.70	-2,862,780.40
	银行间市场	727,932,548.26	732,053,000.00	4,120,451.74
	合计	869,310,815.36	870,568,486.70	1,257,671.34
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		869,310,815.36	870,568,486.70	1,257,671.34

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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
银行间市场	-	-
交易所市场	300,000,000.00	-
合计	300,000,000.00	-

单位：人民币元

项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	-	-
交易所市场	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年1月27日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	35,464.21	2,436.41
应收定期存款利息	1,057,777.78	211,388.92
应收其他存款利息	-	-

应收结算备付金利息	1,599.66	967.80
应收债券利息	-	24,104,815.19
应收买入返售证券利息	-	4,796.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	310.06	103.00
合计	1,095,151.71	24,324,507.32

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年1月27日	上年度末 2013年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,053.46	26,714.50
银行间市场应付交易费用	5,630.98	7,750.00
合计	6,684.44	34,464.50

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年1月27日	上年度末 2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	876.21	11,880.94
应付审计费	85,917.86	80,000.00
应付信息披露费	145,150.77	120,000.00
合计	231,944.84	211,880.94

#### 7.4.7.9 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
基金合同生效日	1,051,697,428.43	1,051,697,428.43
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

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

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
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

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日
活期存款利息收入	33,027.80	144,519.93
定期存款利息收入	1,025,069.42	783,828.51
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	631.86	63,256.69
其他	207.06	5,536.54
合计	1,058,936.14	997,141.67

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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12月31日
卖出股票成交总额	588,678.24	916,484,352.89
减：卖出股票成本总额	601,799.00	928,237,142.63
买卖股票差价收入	-13,120.76	-11,752,789.74



**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1 月27日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	898,151,936.86	1,358,241,509.68
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	869,310,815.36	1,314,884,865.59
减：应收利息总额	25,909,956.51	38,898,714.63
买卖债券差价收入	2,931,164.99	4,457,929.46

**7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

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12月 31日
卖出资产支持证券成交总 额	-	310,155.58
减：卖出资产支持证券成本 总额	-	279,000.00
减：应收利息总额	-	924.46
资产支持证券投资收益	-	30,231.12

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1 月27日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
股票投资产生的股利收益	-	831,502.28
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-	831,502.28

## 7.4.7.17 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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,257,671.34	-12,215,842.47
——股票投资	-	-2,837,020.83
——债券投资	-1,257,671.34	-10,359,821.64
——资产支持证券投资	-	981,000.00
——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	-12,215,842.47

## 7.4.7.18 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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
基金赎回费收入	241,902.16	1,062,246.84
其他	-	10,778.44
合计	241,902.16	1,073,025.28

## 7.4.7.19 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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	2,535.68	2,721,014.95
银行间市场交易费用	4,950.00	13,500.00
合计	7,485.68	2,734,514.95

## 7.4.7.20 其他费用

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 12 月 31 日
审计费用	5,917.86	70,000.00
信息披露费	25,150.77	340,000.00
账户维护费	9,000.00	36,600.00
银行划款费用	555.00	10,797.00
其他费用	600.00	-
合计	41,223.63	457,397.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2014 年 1 月 27 日保本周期到期并实施到期转型。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”。《汇添富双利债券基金基金合同》于 2014 年 1 月 28 日生效。

## 7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
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

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 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%	1,735,226,207.43	98.08%

#### 7.4.10.1.2 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12月31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%	377,025,098.74	96.24%

#### 7.4.10.1.3 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12月31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%	6,430,870,000.00	96.96%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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	1,565,877.39	98.10%	26,714.50	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	955,287.82	15,479,877.54
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	360,810.37	5,833,873.37

注：：基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每个月月末, 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给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	159,214.62	2,579,979.69

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金 买入	基金卖出	交易金 额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有 限公司	-	40,938,796.17	-	-	-	-
上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行 股份有限公司	51,953,851.51	102,150,063.70	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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 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 12 月 31 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	1,742,946.16	144,519.93

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（基金合同失效前日）获得的利息

收入为人民币 631.86 元(2013 年度:人民币 63,256.69 元),2014 年 1 月 27 日(基金合同失效前日)结算备付金余额为人民币 316,311.71 元(2013 年末:人民币 2,150,766.56 元)。

#### **7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### **7.4.11 利润分配情况**

注:本基金本报告期末未进行利润分配。

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

##### **7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 1 月 27 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 1 月 27 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的股票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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金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。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014 年 1 月 27 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	-	281,525,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	59,564,000.00
合计	-	341,089,000.00

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014 年 1 月 27 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	-	358,519,338.30
AAA 以下	-	170,960,148.40
未评级	-	-
合计	-	529,479,486.70

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

### 7.4.13.3 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。

本基金期末未持有证券，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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2014 年 1 月 27 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	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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
基金投资	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	300,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	300,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

应收利息									1,095,151.71	1,095,151.71
应收股利										
应收申购款	15,968.52								12,577.61	28,546.13
其他资产										
资产总计	1,217,153,356.32					0.00	0.00		1,107,729.32	1,218,261,085.64
负债										
短期借款										
交易性金融负债										
衍生金融负债										
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
应付税费										
应付利息										
应付利润										
其他负债									231,944.84	231,944.84

负债总计	-	-	-	-	-	0.00	0.00	-	208,378,327.47	208,378,327.47
利率敏感度缺口	1,217,153,356.32	-	-	-	-	0.00	0.00	-	-207,270,598.15	1,009,882,758.17
上年度末 2013年12月31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	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
基金投资	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	24,324,507.32	24,324,507.32
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	396.91	-	-	-	-	-	-	-	39,750.81	40,147.72
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
资产总计	460,606,090.38	309,611,845.70	0.00	312,693,440.00	0.00	0.00	1,347,492.60	5,432,708.40	25,865,091.46	1,115,556,668.54
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

金融负债											
衍生金融负债											
卖出回购金融资产款											
应付证券清算款											
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	
应付销售服务费											
应付交易费用									34,464.50	34,464.50	
应付税费											
应付利息											
应付利润											
其他负债									211,880.94	211,880.94	
负债总计						0.00	0.00		3,078,886.59	3,078,886.59	
利率敏感度缺口	460,606,090.38	309,611,845.70	0.00	312,693,440.00	0.00	0.00	1,347,492.60	5,432,708.40	22,786,204.87	1,112,477,781.95	

#### 7.4.13.4.1.2 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、存出保证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；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	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 1 月 27 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	基准利率增加 25 个基点	-	-502,677.04
	基准利率减少 25 个基点	-	503,658.12

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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及债券，所面临的最大其他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其他价格风险，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 1 月 27 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	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	-	-	870,568,486.70	78.25
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	-	-	870,568,486.70	78.25

注：股票、权证等风险资产占基金资产的的比例不高于 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%。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。

#### 7.4.13.4.3.2 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 1 月 27 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	-	162, 148. 01
	沪深 300 指数下跌 5%	-	-162, 148. 01

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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日），本基金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中无第一层次、第二层次及第三层次余额。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 1 月 27 日（基金合同失效前日）止期间，对于以公允价值计量的金融工具，无由第一层次转入第二层次以及第二层次转入第一层次的投资。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

**7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额**

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

**7.4.14.2 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大承诺事项。

**7.4.14.3 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。

**7.4.14.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2015 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

**§ 7 年度财务报表(转型后)****7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,562,160.76
结算备付金		7,413,204.00
存出保证金		23,888.91
交易性金融资产	7.4.7.2	270,062,390.88
其中：股票投资		12,649,324.47
基金投资		-
债券投资		257,413,066.41
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		2,246,770.68
应收利息	7.4.7.5	5,912,102.23
应收股利		-

应收申购款		678,110.30
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		287,898,627.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		127,499,740.40
应付证券清算款		720,880.61
应付赎回款		337,915.95
应付管理人报酬		94,131.28
应付托管费		26,894.66
应付销售服务费		581.93
应付交易费用	7.4.7.7	2,985.00
应交税费		-
应付利息		49,455.04
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	300,104.69
负债合计		129,032,689.56
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	122,963,840.50
未分配利润	7.4.7.10	35,902,097.70
所有者权益合计		158,865,938.20
负债和所有者权益总计		287,898,627.76

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额总额 122,963,840.50 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.293 元，份额总额 121,276,614.29 份；下属 C 类基金份额净值 1.184 元，份额总额 1,687,226.21 份。

3、本基金合同于 2014 年 1 月 28 日生效。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期
		2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日



一、收入		36,923,410.71
1. 利息收入		9,143,733.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	199,742.00
债券利息收入		8,494,563.00
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		449,428.86
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,735,982.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,210,974.41
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	9,525,008.05
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,036,939.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	6,755.15
<b>减：二、费用</b>		4,045,294.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,264,333.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	357,285.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,107.63
4. 交易费用	7.4.7.19	41,166.58
5. 利息支出		1,969,903.52
其中：卖出回购金融资产支出		1,969,903.52
6. 其他费用	7.4.7.20	410,498.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		32,878,116.12

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 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）	-	32,878,116.12	32,878,116.12
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）	-828,098,646.51	-55,796,289.58	-883,894,936.09
其中：1. 基金申购款	20,494,861.64	2,741,032.39	23,235,894.03
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-848,593,508.15	-58,537,321.97	-907,130,830.12
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）	122,963,840.50	35,902,097.70	158,865,938.20

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富双利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由汇添富保本混合型证券投资基金（以下简称“汇添富保本基金”）转型而来，按照原《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，汇添富保本基金自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止为基金保本周期（如保本周期届满的最后一日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日），保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续，否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“汇添富双利债券型证券投资基金”。自 2014 年 1 月 28 日起，《汇添富双利债券型证券投资基金基金合同》正式生效，基金合同生效日的规模为 951,062,487.01 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。

原汇添富保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）向社会公开发行募集，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。

自 2014 年 6 月 18 日起对本基金增设 C 类基金份额类别。增设基金份额后，本基金将分设为 A 类基金份额和 C 类基金份额。其中，在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类

别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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、资产支持证券以及经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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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修订的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自

2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 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。

#### 7.4.4.1 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）至 2014 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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及贷款和应收款项；

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包括股票和债券等投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金

和各类应收款项等。

#### (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均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

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；

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。

##### 金融资产转移

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列

示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 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) 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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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。

#### 7.4.4.10 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% 的年费率计提；

(3) 对于 A 类基金份额，不收取销售服务费；对于 C 类基金份额，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率逐日计提；

(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。

#### 7.4.4.11 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各类基金份额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) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的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至日）的时间不超过 15 个工作日；

(6)法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	1,562,160.76
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,562,160.76

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日
----	-------------------------

	成本	公允价值	估值增值
股票	12,073,792.14	12,649,324.47	575,532.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	159,476,409.09	13,928,657.32
	银行间市场	82,475,250.41	1,532,749.59
	合计	241,951,659.50	15,461,406.91
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	254,025,451.64	270,062,390.88	16,036,939.24

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应收活期存款利息	944.50
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	3,336.00
应收债券利息	5,907,811.03
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	10.70
合计	5,912,102.23

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	2,985.00
合计	2,985.00

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	104.69
应付审计费	80,000.00
应付信息披露费	220,000.00
合计	300,104.69

### 7.4.7.9 实收基金

项目	本期（双利债券 A） 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	951,062,487.01	951,062,487.01
本期申购	13,038,472.61	13,038,472.61
本期赎回（以“-”号填列）	-842,824,345.33	-842,824,345.33
本期末	121,276,614.29	121,276,614.29

项目	本期（双利债券 C） 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	7,456,389.03	7,456,389.03
本期赎回（以“-”号填列）	-5,769,162.82	-5,769,162.82
本期末	1,687,226.21	1,687,226.21

注（1） 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 原汇添富保本基金于 2014 年 1 月 27 日的实收基金为 951,062,487.01 元, 折合 951,062,487.01 份基金份额, 已于 2014 年 1 月 28 日(本基金合同生效日)全部转为本基金的基金资产份额(即 A 类基金份额)。

#### 7.4.7.10 未分配利润

项目(双利债券 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	62,187,424.84	-3,367,153.68	58,820,271.16
本期利润	16,745,243.26	15,919,259.20	32,664,502.46
本期基金份额交易产生的变动数	-56,731,337.92	838,410.20	-55,892,927.72
其中:基金申购款	1,538,465.01	588,818.22	2,127,283.23
基金赎回款	-58,269,802.93	249,591.98	-58,020,210.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,201,330.18	13,390,515.72	35,591,845.90

项目(双利债券 C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	95,933.62	117,680.04	213,613.66
本期基金份额交易产生的变动数	64,525.32	32,112.82	96,638.14
其中:基金申购款	343,548.66	270,200.50	613,749.16
基金赎回款	-279,023.34	-238,087.68	-517,111.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	160,458.94	149,792.86	310,251.80

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	135,961.66
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	62,886.00
其他	894.34
合计	199,742.00

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	10,472,516.96
卖出股票成本总额	8,261,542.55
买卖股票差价收入	2,210,974.41

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	401,010,827.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	384,174,031.92
减：应收利息总额	7,311,787.58
买卖债券差价收入	9,525,008.05

#### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 7.4.7.17 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 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	16,036,939.24

——股票投资	575,532.33
——债券投资	15,461,406.91
——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	16,036,939.24

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月28日至2014年12月31日
基金赎回费收入	6,755.15
合计	6,755.15

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月28日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	33,416.58
银行间市场交易费用	7,750.00
合计	41,166.58

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月28日至2014年12月31日
审计费用	74,082.14
信息披露费	294,849.23
账户维护费	27,000.00
银行划款费用	14,566.83
其他费用	-
合计	410,498.20

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
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

## 7.4.10 本报告期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日	
	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	21,574,187.50	100.00%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 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	296,295,762.94	100.00%



**7.4.10.1.3 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28日至2014年12月31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	9,462,728,000.00	96.09%

**7.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.10.1.5 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28日至2014年12月31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	19,316.42	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月28日至2014年12月31日
当期应支付的管理费	1,264,333.15
其中：支付销售机构的客 户维护费	607,201.77

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，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给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	357,285.51

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	双利债券 A	双利债券 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	2,107.63	2,107.63

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金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、休息日等，支付日期顺延。

**7.4.10.3 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的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

**7.4.10.5 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 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,562,160.76	135,961.66

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（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 62,886.00 元，2014 年末结算备付金余额为人民币 7,413,204.00 元。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 29,999,755.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
------	------	------	--------	-------	--------

		日			
140209	14 国开 09	2015 年 1 月 7 日	102.62	100,000	10,262,000.00
140222	14 国开 22	2015 年 1 月 7 日	105.12	200,000	21,024,000.00
合计				300,000	31,286,000.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止,基金从事上海证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 88,700,000.00 元,于 2015 年 1 月 5 日到期;从事深圳证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 8,799,985.40 元,于 2015 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的股票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发行的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金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。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	10,002,000.00
合计	10,002,000.00

**7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014 年 12 月 31 日
AAA	44,956,025.80
AAA 以下	138,491,040.61
未评级	63,964,000.00
合计	247,411,066.41

**7.4.13.3 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 7.4.12 中列示的本基金于年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。

**7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 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、债券投资、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等；生息负债主要为卖出回购金融资产款。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 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
<b>资产</b>										
银行存款	1,562,160.76	-	-	-	-	-	-	-	-	1,562,160.76
结算备付金	7,413,204.00	-	-	-	-	-	-	-	-	7,413,204.00
存出保证金	23,888.91	-	-	-	-	-	-	-	-	23,888.91
交易性金融资产	15,234,180.00	50,724.60	-	-7,125,475.10	-	-	-150,837,730.47	84,164,956.24	12,649,324.47	270,062,390.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,246,770.68	2,246,770.68
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	5,912,102.23	5,912,102.23
应收申购款	436,719.96	-	-	-	-	-	-	-	241,390.34	678,110.30
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	24,670,153.63	50,724.60	-	-7,125,475.10	-	-	-150,837,730.47	84,164,956.24	21,049,587.72	287,898,627.76
<b>负债</b>										
卖出回购金融资产款	127,499,740.40	-	-	-	-	-	-	-	-	127,499,740.40
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	720,880.61	720,880.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	337,915.95	337,915.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	94,131.28	94,131.28
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	26,894.66	26,894.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	581.93	581.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	2,985.00	2,985.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	49,455.04	49,455.04
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	300,104.69	300,104.69
负债总计	127,499,740.40	-	-	-	-	-	-	-	1,532,949.16	129,032,689.56
利率敏感度缺口	-102,829,586.77	50,724.60	-	-7,125,475.10	-	-	-150,837,730.47	84,164,956.24	19,516,638.56	158,865,938.20

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。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。

### 7.4.13.4.1.2 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、存出保证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 12 月 31 日）
	基准利率增加 25 个基点	-1, 935, 433. 78
	基准利率减少 25 个基点	1, 968, 338. 63

### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 7.4.13.4.3 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及债券，所面临的最大其他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其他价格风险，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 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	12, 649, 324. 47	7. 96
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	257, 413, 066. 41	162. 03
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	270,062,390.88	169.99
----	----------------	--------

注：本基金 80%以上的基金资产投资于固定收益类金融工具，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%，持有的全部权证不超过基金净值的 3%。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。

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）
	沪深 300 指数上涨 5%	2,457,886.74
	沪深 300 指数下跌 5%	-2,457,886.74

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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币 111,584,973.68 元，属于第二层次的余额为人民币 158,477,417.20 元，无第三层次余额。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

自 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间，对于以公允价值计量的金融工具，无由第一层次转入第二层次以及第二层次转入第一层次的投资。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。



**7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额**

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末不以第三层次公允价值计量。

**7.4.14.2 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大承诺事项。

**7.4.14.3 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。

**7.4.14.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2015 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

**§ 8 投资组合报告(转型前)****8.1 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

## 8.2 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。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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。

### 8.4.2 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。

### 8.4.3 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

## 8.5 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。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1

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、处罚的情形。

#### 8.11.2

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。

#### 8.11.3 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

**8.11.4 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。

**8.11.5 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。

**§8 投资组合报告(转型后)****8.1 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	12,649,324.47	4.39
	其中：股票	12,649,324.47	4.39
2	固定收益投资	257,413,066.41	89.41
	其中：债券	257,413,066.41	89.41
	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	8,975,364.76	3.12
7	其他资产	8,860,872.12	3.08
8	合计	287,898,627.76	100.00

**8.2 期末按行业分类的股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,609,496.93	1.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,587,163.24	2.89
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	3,367,664.30	2.12
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	2,085,000.00	1.31
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	12,649,324.47	7.96

### 8.3 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)

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600795	国电电力	990,748	4,587,163.24	2.89
2	600109	国金证券	170,170	3,367,664.30	2.12
3	601989	中国重工	283,333	2,609,496.93	1.64
4	600661	新南洋	100,000	2,085,000.00	1.31

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002183	怡亚通	5,177,017.43	3.26
2	600795	国电电力	4,448,458.52	2.80
3	600109	国金证券	3,110,707.60	1.96
4	600352	浙江龙盛	3,084,525.12	1.94
5	600661	新南洋	2,840,127.99	1.79

6	601989	中国重工	1,674,498.03	1.05
---	--------	------	--------------	------

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。

#### 8.4.2 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

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002183	怡亚通	7,556,155.26	4.76
2	600352	浙江龙盛	2,916,361.70	1.84

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。

#### 8.4.3 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	8,261,542.55
卖出股票收入（成交）总额	10,472,516.96

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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	10,382,000.00	6.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	63,584,000.00	40.02
	其中：政策性金融债	63,584,000.00	40.02
4	企业债券	117,196,906.50	73.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,042,000.00	6.32
7	可转债	56,208,159.91	35.38
8	其他	-	-
9	合计	257,413,066.41	162.03

#### 8.6 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	140222	14 国开 22	400,000	43,032,000.00	27.09
2	112208	14 华邦 01	120,000	12,180,000.00	7.67

3	124601	14 唐城债	100,000	10,780,000.00	6.79
4	124557	13 天易 02	101,000	10,603,990.00	6.67
5	124505	14 嘉市镇	100,000	10,600,000.00	6.67

### 8.7 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。

### 8.8 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投资。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1

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、处罚的情形。

#### 8.11.2

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。

#### 8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,888.91
2	应收证券清算款	2,246,770.68
3	应收股利	-
4	应收利息	5,912,102.23

5	应收申购款	678,110.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,860,872.12

### 8.11.4 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	9,125,820.00	5.74
2	113001	中行转债	7,359,730.00	4.63
3	110015	石化转债	6,476,160.00	4.08
4	113005	平安转债	5,232,180.00	3.29
5	110020	南山转债	4,188,300.00	2.64
6	127002	14 天能 02	4,112,538.00	2.59
7	110011	歌华转债	4,006,634.00	2.52
8	110022	同仁转债	3,647,376.20	2.30

### 8.11.5 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不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息(转型前)

### 9.1 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%



### 9.2 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。

### 9.3 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

## § 9 基金份额持有人信息(转型后)

### 9.1 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	3414	35,523.32	59,409.24	0.05%	121,217,205.05	99.95%
汇添富双利债券 C	135	12,497.97	-	0.00%	1,687,226.21	100%
合计	3549	34,647.46	59,409.24	0.05%	122,904,431.26	99.95%

### 9.2 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	3315.08	0.002733%
	汇添富双利债券 C	754.53	0.044720%

	合计	4069.61	0.003310%
--	----	---------	-----------

**9.3 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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

**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	13,038,472.61	7,456,389.03
减：本报告期基金总赎回份额	842,824,345.33	5,769,162.82
本报告期基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	121,276,614.29	1,687,226.21

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

### 11.2 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，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，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，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，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，齐东超先生不再担任该基金的基金经理。

8、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。

9、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，齐东超先生不再担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理，由雷鸣先生单独管理该基金。

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、《汇添富移动互联股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 8 月 26 日正式生效，欧阳沁春先生任该基金的基金经理。

12、《汇添富环保行业股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 16 日正式生效，叶从飞先生任该基金的基金经理。

13、基金管理人 2014 年 10 月 25 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

14、基金管理人 2014 年 10 月 25 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，与陆文磊先生共同管理该基金。

15、基金管理人 2014 年 11 月 27 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理，与汤从珊女士共同管理该基金。

16、《汇添富外延增长主题股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 8 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。

17、《汇添富收益快线货币市场基金基金合同》于 2014 年 12 月 23 日正式生效，陆文磊先生、徐寅喆女士共同任该基金的基金经理。

18、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。

### 11.3 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。

### 11.4 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》。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2011 年 1 月 26 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币捌万元整。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

### 11.7.1 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	21,574,187.50	100.00%	19,316.42	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	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 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	296,295,762.94	100.00%	9,462,728,000.00	96.09%	-	-
国泰君安	-	-	385,000,000.00	3.91%	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：（1）基金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、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、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金共用。本报告期新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：华创证券（深交所交易单元）。退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：金元证券（上交所交易单元）。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

#### 11.7.1 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。

### 11.7.2 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：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。

### 11.8 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	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
2	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
3	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
4	汇添富保本混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2014 年第 1 号）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 3 月 12 日
5	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

6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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

15	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
16	汇添富基金管理股份有限公司关于香港子公司办公地址变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 7 月 1 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2014 年上半年度资产净值的公告	管理人网站	2014 年 7 月 1 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华龙证券开展的申购基金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, 深交所	2014 年 7 月 7 日
19	汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年第 2 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 7 月 19 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加包商银行行为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 7 月 26 日
21	汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年半年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 8 月 25 日
22	汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年半年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 8 月 25 日
23	汇添富基金管理有限公司澄清公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 8 月 29 日
24	汇添富基金管理股份有限公司	中国证券报, 上海证	2014 年 9 月 3 日

	澄清公告	券报, 证券时报, 管理人网站	
25	汇添富双利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要(2014年第1号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014年9月6日
26	汇添富双利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要(2014年第1号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014年9月6日
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加创金启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9月26日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与五矿证券开展的网上交易系统申购基金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10月15日
29	汇添富双利债券型证券投资基金 2014 年第 3 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10月24日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加天风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	2014年10月30日
31	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加恒久浩信为代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014年12月22日
32	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行 2015 倾心回馈基金定投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12月30日
33	汇添富基金管理股份有限公司	中国证券报, 上海证	2014年12月30日

	关于旗下部分基金增加邮储银行为销售机构并参与费率优惠活动的公告	券报, 证券时报, 管理人网站	
34	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参与平安银行开展的网上银行申购和定投基金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 12 月 31 日
35	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华福证券开展的基金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, 深交所	2014 年 12 月 31 日
36	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与申万证券开展的基金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 12 月 31 日

### 11.8 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

	告		
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二次提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 1 月 24 日
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

## § 12 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 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。

### 13.2 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

### 13.3 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](http://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  
2015 年 3 月 31 日