

汇添富互利分级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。

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。

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
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
^{3.1} 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富互利分级债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富互利分级债券	
基金主代码	164703	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 日	
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	416,894,999.82 份	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2014-04-30	
下属分级基金的基金简称:	汇添富互利分级债券 A (场内简称: 互利债 A)	汇添富互利分级债券 B (场内简称: 互利债 B)
下属分级基金的交易代码:	164704	150142
报告期末下属分级基金的份额总额	206,088,862.33 份	210,806,137.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上, 本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理, 力争实现资产的长期稳健增值。	
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下, 本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%, 年跟踪误差不超过 4%。	
业绩比较基准	中债综合指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金, 属于具有中低风险收益特征的基金品种, 其长期平均风险和预期收益率低于股票基金, 混合基金, 高于货币市场基金。	
	汇添富互利分级债券 A (场内简称: 互利债 A)	汇添富互利分级债券 B (场内简称: 互利债 B)
下属分级基金的风险收益特征	互利 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征, 其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	互利 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征, 其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

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

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	17,879,077.45
本期利润	32,306,230.88
加权平均基金份额本期利润	0.0539
本期加权平均净值利润率	5.28%
本期基金份额净值增长率	7.05%
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	11,177,021.33
期末可供分配基金份额利润	0.0268
期末基金资产净值	440,932,090.06
期末基金份额净值	1.058
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	7.47%
-------------	-------

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

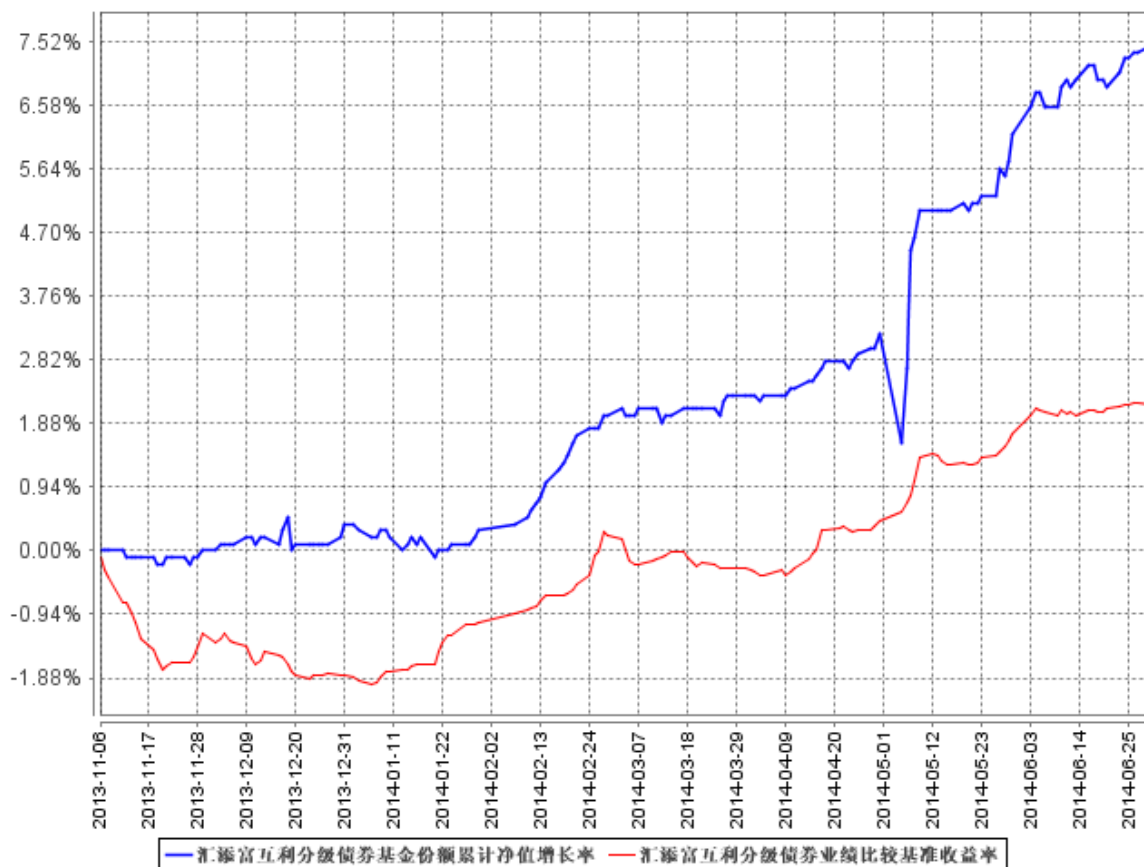
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.24%	0.15%	0.42%	0.07%	0.82%	0.08%
过去三个月	5.06%	0.35%	2.42%	0.09%	2.64%	0.26%
过去六个月	7.05%	0.26%	4.07%	0.08%	2.98%	0.18%
自基金合同生效日起至今	7.47%	0.23%	2.15%	0.10%	5.32%	0.13%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 11 月 06 日，至本报告期末未满 1 年。

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

汇添富互利分级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：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 11 月 06 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 06 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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		
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富互利分级债券基金、汇	2013 年 11 月 6 日	-	12 年	国籍：中国。学历：华东师范大学金融学博士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：曾

	<p>添富全额宝货币基金、汇添富收益快线货币基金的基金经理，固定收益投资总监。</p>			<p>任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益高级经理，现任固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理，2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理，2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合基金的基金经理，2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基</p>
--	---	--	--	---

					金经理， 2012 年 12 月 31 日至 2014 年 1 月 20 日任 汇添富收 益快线货 币基金的 基金经理 助理， 2013 年 11 月 6 日至 今任汇添 富互利分 级债券基 金的基金 经理， 2013 年 12 月 13 日至 今任汇添 富全额宝 货币基金 的基金经 理，2014 年 1 月 21 日至今任 汇添富收 益快线货 币基金的 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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人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 年上半年全球经济表现平稳，美国经济持续向好，欧美各大央行继续推行宽松货币政策，全球流动性宽裕，债券收益率低位徘徊，市场风险偏好不断提升。上半年国内经济表现不及预期，受投资和消费增速回落的影响，上半年经济增长率为 7.4%，低于全年增长目标，通胀维持在较低水平。为稳定经济增长，二季度以后宏观政策趋于积极，央行先后出台了定向降准和再贷款等政策，财政开支力度也明显加大。随着政策效果陆续显现，6 月份以后主要经济指标出现企稳迹象。上半年央行对流动性管理较为主动积极，货币市场流动性相对宽裕，短期利率年初以来出现持续

回落走势。

上半年债券市场受益于经济回落和政策放松出现较大幅度上涨，中债综合指数上涨 5.82%，各类债券收益率普遍下行，利率债收益率曲线呈陡峭化下移的走势，政策性金融债收益率降幅大于国债，信用债表现好于利率债，其中高等级信用债收益率降幅与利率债接近，而中低等级信用债收益率降幅大于高等级信用债，部分信用债受评级下调影响出现下跌。本基金上半年采取了较为积极的操作，增持了长久期利率债和信用债，降低了存款配置比例，对可转债也进行了一定的波段操作，较好的把握了上半年债券市场的上涨行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年上半年本基金的收益率为 7.05%，同期业绩比较基准率为 4.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年美国经济有望继续向好，但随着经济进一步复苏，年内美联储将逐渐结束 QE，明年上半年以后可能逐渐进入加息周期，对全球利率水平和资金流动的影响不容忽视。国内宏观经济政策下半年将继续以稳增长为主要目标，微刺激政策有望继续出台，经济企稳并小幅回升的概率较大，但目前经济仍处于结构转型期，推动经济持续回升的内在动力尚未形成，而房地产市场限购限贷政策放松以后的走向及其对经济的影响尤为值得关注。从物价走势看，受猪肉价格反弹和基数效应影响，CPI 涨幅可能会在四季度以后出现一定幅度回升，但通胀压力预计不会明显增加。下半年央行有望继续维持较为宽松的货币政策，定向放松仍是主要的政策手段，如果外汇占款增速持续下降，下半年存在全面降准的可能性。货币市场资金面有望维持偏宽松格局，但短期利率水平可能比上半年小幅上升。

目前期国债、金融债收益率仍处于历史较高的水平，在经济回升乏力、货币政策基调偏宽松的情况下，下半年债券市场收益率仍存在进一步的下降空间，但收益率下降的幅度可能会受到经济企稳的制约而较为有限，市场波动可能有所加大，利率债存在波段操作的机会。信用利差已经处于较低水平，未来信用事件可能继续增加，信用债配置方面需要加强筛选，以票息收益为主。本管理人将坚持价值投资的理念，重视绝对收益目标，不断优化组合的结构，控制组合下行风险，力争为投资者创造持续稳定的收益。

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历，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签订了《中债收益率曲线和中债估值最终服务协议》而取得中债估值服务。

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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 20%，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互利分级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

本报告期内汇添富互利分级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互利分级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，汇添富互利分级债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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互利分级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）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富互利分级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	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	481,247.13	411,084,544.96
结算备付金		10,143,201.51	8,608,126.66
存出保证金		40,184.71	53,959.12
交易性金融资产	6.4.7.2	706,474,691.59	512,187,868.66
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		706,474,691.59	512,187,868.66
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		4,995,802.19	9,989,908.52
应收利息	6.4.7.5	17,425,637.53	13,754,307.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	54,980.40	-
资产总计		739,615,745.06	955,678,715.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	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		292,799,912.10	246,499,918.20
应付证券清算款		5,002,358.64	20,576,731.93
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		252,385.26	407,592.31
应付托管费		72,110.08	116,454.92
应付销售服务费		180,275.18	291,137.39
应付交易费用	6.4.7.7	2,355.67	-
应交税费		-	-
应付利息		165,983.18	116,505.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,274.89	20,000.00
负债合计		298,683,655.00	268,028,340.07
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	416,894,999.82	684,640,965.82
未分配利润	6.4.7.10	24,037,090.24	3,009,409.21
所有者权益合计		440,932,090.06	687,650,375.03
负债和所有者权益总计		739,615,745.06	955,678,715.10

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额总额 416,894,999.82 份。其中 A 类基金份额总额 206,088,862.33 份，份额净值 1.008 元；B 类基金份额总额 210,806,137.49 份，份额净值 1.106 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：汇添富互利分级债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 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 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		41,418,379.54
1.利息收入		23,113,595.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,380,387.05
债券利息收入		15,733,208.37
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,877,630.69
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	3,877,630.69
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	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,427,153.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、费用		9,112,148.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,139,180.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	611,194.29
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,527,985.75
4. 交易费用	6.4.7.18	4,684.72
5. 利息支出		4,592,523.80
其中：卖出回购金融资产支出		4,592,523.80
6. 其他费用	6.4.7.19	236,579.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,306,230.88

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、本基金合同于 2013 年 11 月 6 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富互利分级债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 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）	684,640,965.82	3,009,409.21	687,650,375.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,306,230.88	32,306,230.88
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）	-267,745,966.00	-	-267,745,966.00
其中：1. 基金申购款	109,587,279.12	-	109,587,279.12
2. 基金赎回款	-377,333,245.12	-	-377,333,245.12

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）	-	-11,278,549.85	-11,278,549.85
五、期末所有者权益（基金净值）	416,894,999.82	24,037,090.24	440,932,090.06

注：本基金于 2013 年 11 月 6 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示本期数据，特此说明。

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

汇添富互利分级债券型证券投资基金（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[2013]641 号文《关于核准汇添富互利分级债券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股份有限公司于 2013 年 10 月 21 日至 2013 年 11 月 1 日向社会公开发发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2013）验字第 60466941_B50 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 11 月 6 日正式生效。本基金为契约型，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 684,424,432.64 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 216,533.18 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 684,640,965.82 元，折合 684,640,965.82 份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为固定收益类品种，国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款），以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证，也不参与一级市场新股申购。因持有可转债转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，应当在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，持有的现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基

金融资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。在严格控制风险的基础上，本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理，力争实现资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准是中债综合指数。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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 01 月 01 日起至 2014 年 06 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；

C. 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；

D. 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) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.50% 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、本基金在分级运作期内及分级运作期届满时，收益分配应遵循下列政策：

(1) 本基金不单独对互利 A 与互利 B 基金份额进行收益分配；

(2) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2、本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，本基金收益分配应遵循以下政策：

(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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 场外基金份额的收益分配方式分两种：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；场内基金份额的收益分配方式只能为现金分红，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所和登记机构的相关规定；

(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) 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估计变更。。

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	481,247.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	481,247.13

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	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	552,497,278.18	563,250,691.59
	银行间市场	141,117,344.50	143,224,000.00
	合计	693,614,622.68	706,474,691.59
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	693,614,622.68	706,474,691.59	12,860,068.91

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	1,267.59
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	4,107.96
应收债券利息	17,420,245.69
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	16.29
合计	17,425,637.53

注：“其他”为结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	54,980.40
合计	54,980.40

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	2,355.67
合计	2,355.67

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	-
预提审计费用	39,671.58
预提信息披露费	168,603.31
合计	208,274.89

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富互利分级债券 A（场内简称：互利债 A）		
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	473,834,828.33	473,834,828.33
本期申购	98,308,729.27	98,308,729.27
本期赎回(以“-”号填列)	-377,333,245.12	-377,333,245.12
基金拆分/份额折算变动份额	11,278,549.85	11,278,549.85
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	206,088,862.33	206,088,862.33

金额单位：人民币元

汇添富互利分级债券 B（场内简称：互利债 B）	
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,806,137.49	210,806,137.49
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	210,806,137.49	210,806,137.49

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

6.4.7.10 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	4,576,493.73	-1,567,084.52	3,009,409.21
本期利润	17,879,077.45	14,427,153.43	32,306,230.88
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-11,278,549.85	-	-11,278,549.85
本期末	11,177,021.33	12,860,068.91	24,037,090.24

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6月30日
活期存款利息收入	41,454.31
定期存款利息收入	7,268,177.79
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	70,209.13
其他	545.82
合计	7,380,387.05

注：表中“其他”为直销申购款和保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本期末未投资股票。

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6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	293,913,645.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	277,358,467.60
减：应收利息总额	12,677,546.96
债券投资收益	3,877,630.69

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：本基金本期末未持有贵金属。

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

本基金本期末未持有股票。

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6月30日
1. 交易性金融资产	14,427,153.43
——股票投资	-
——债券投资	14,427,153.43
——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	14,427,153.43

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,309.72
银行间市场交易费用	2,375.00
合计	4,684.72

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	168,603.31
其他费用	900.00
上市费用	20,019.60
银行间划款费用	5,885.50
帐户维护费	1,500.00
合计	236,579.99

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

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
中国建设银行股份有限公司	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
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

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
-------------	------------------

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 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 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	488,351,615.12	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 1 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	11,333,100,000.00	100.00%

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 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户 维护费	817,672.16

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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、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 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	611,194.29

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富互利分级债券 A (场内简称: 互利债 A)	汇添富互利分级债券 B (场内简称: 互利债 B)	合计
中国工商银行股份有限公司	930,778.35	656.88	931,435.23
汇添富基金管理股份有限公司	470.95	540,320.23	540,791.18
合计	931,249.30	540,977.11	1,472,226.41

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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

注：本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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。

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1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	481,247.13	41,454.31

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 半年度获得的利息收入为人民币 70,209.13 元，2014 半年末结算备付金余额为 10,143,201.51。

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：本基金本期末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：本基金在本期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1.2 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	备注
112208	14 华	2014 年 6	-	新债未	99.93	99.93	100,000	9,992,789.04	9,992,789.04	-

	邦 01	月 17 日		上市					
--	------	--------	--	----	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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。

6.4.13.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
--------	------------------------	--------------------------

A-1	20,138,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	20,138,000.00	-

6.4.13.2.2 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6月30日	上年度末 2013年12月31日
AAA	36,694,600.00	23,570,940.00
AAA 以下	460,149,867.59	418,770,121.66
未评级	189,492,224.00	69,846,807.00
合计	686,336,691.59	512,187,868.66

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

单位：人民币元

本期末 2014年 6月30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	481,247.13	-	-	-	-	-	481,247.13
结算备付金	10,143,201.51	-	-	-	-	-	10,143,201.51
存出保证金	40,184.71	-	-	-	-	-	40,184.71
交易性金融资产	-	-	34,279,130.75	287,872,789.84	384,322,771.00	-	706,474,691.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,995,802.19	4,995,802.19
应收利息	-	-	-	-	-	17,425,637.53	17,425,637.53
其他资	-	-	-	-	-	54,980.40	54,980.40

产							
资产总计	10,664,633.35	-	34,279,130.75	287,872,789.84	384,322,771.00	22,476,420.12	739,615,745.06
负债							
卖出回购金融资产款	292,799,912.10	-	-	-	-	-	292,799,912.10
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,002,358.64	5,002,358.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	252,385.26	252,385.26
应付托管费	-	-	-	-	-	72,110.08	72,110.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	180,275.18	180,275.18
应付	-	-	-	-	-	2,355.67	2,355.67

交易费用							
应付利息						165,983.18	165,983.18
其他负债						208,274.89	208,274.89
负债总计	292,799,912.10					5,883,742.90	298,683,655.00
利率敏感度缺口	-282,135,278.75		-34,279,130.75	287,872,789.84	384,322,771.00	16,592,677.22	440,932,090.06
上年度末 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	311,084,544.96	100,000,000.00					411,084,544.96
结算备付金	8,608,126.66						8,608,126.66
存	53,959.12						53,959.12

出保证金							
交易性金融资产		4,826,500.00		200,024,979.96	307,336,388.70		512,187,868.66
应收证券清算款						9,989,908.52	9,989,908.52
应收利息						13,754,307.18	13,754,307.18
资产总计	319,746,630.74	104,826,500.00		200,024,979.96	307,336,388.70	23,744,215.70	955,678,715.10
负债							
卖出回购金融资产款	246,499,918.20						246,499,918.20
应付证券清算款						20,576,731.93	20,576,731.93
应						407,592.31	407,592.31

付管理人报酬							
应付托管费						116,454.92	116,454.92
应付销售服务费						291,137.39	291,137.39
应付利息						116,505.32	116,505.32
其他负债						20,000.00	20,000.00
负债总计	246,499,918.20					21,528,421.87	268,028,340.07
利率敏感度缺口	73,246,712.54	104,826,500.00		200,024,979.96	307,336,388.70	2,215,793.83	687,650,375.03

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）	上年度末（2013年12月31日）
	0.25%	-5,660,026.74	-3,959,230.64
	-0.25%	5,743,754.75	4,011,946.50

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		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	706,474,691.59	160.22	512,187,868.66	74.48
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	706,474,691.59	160.22	512,187,868.66	74.48

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）	上年度末（2013年12月31日）
	5%	287,807.43	322,106.42
	-5%	-287,807.43	-322,106.42

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

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	706,474,691.59	95.52
	其中：债券	706,474,691.59	95.52
	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	10,624,448.64	1.44
7	其他各项资产	22,516,604.83	3.04
8	合计	739,615,745.06	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投资。

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：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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	105,740,224.00	23.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	83,752,000.00	18.99
	其中：政策性金融债	83,752,000.00	18.99
4	企业债券	471,487,236.84	106.93
5	企业短期融资券	20,138,000.00	4.57
6	中期票据	-	-
7	可转债	25,357,230.75	5.75
8	其他	-	-
9	合计	706,474,691.59	160.22

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	010107	21 国债(7)	584,030	58,870,224.00	13.35
2	140205	14 国开 05	300,000	32,118,000.00	7.28
3	140203	14 国开 03	300,000	31,386,000.00	7.12
4	122620	12 乌城投	250,000	25,125,000.00	5.70
5	112059	11 联化债	238,059	24,282,018.00	5.51

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投资。

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国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期期末无国债期货持仓。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 本基金本报告期末未持有股票投资。#

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	40,184.71
2	应收证券清算款	4,995,802.19
3	应收股利	-
4	应收利息	17,425,637.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	54,980.40
8	其他	-
9	合计	22,516,604.83

7.11.4 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	113005	平安转债	11,216,100.00	2.54
2	110015	石化转债	5,398,500.00	1.22
3	110023	民生转债	4,640,000.00	1.05

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
汇添富互利分级债券 A (场内简称: 互利债 A)	1,903	108,296.83	0.00	0.00%	206,088,862.33	100.00%
汇添富互利分级债券 B (场内简称: 互利债 B)	24	8,783,589.06	210,082,800.00	99.66%	723,337.49	0.34%
合计	1,927	216,344.06	210,082,800.00	50.39%	206,812,199.82	49.61%

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富互利分级债券 A（场内简称：互利债 A）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

汇添富互利分级债券 B（场内简称：互利债 B）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	和谐健康保险股份有限公司一万能产品	100,000.00	27.17%
2	答文静	68,000.00	18.47%
3	姚家庆	50,004.00	13.59%
4	新华人寿保险股份有限公司分红产品	50,000.00	13.59%
5	娄德成	50,000.00	13.59%
6	中国平安人寿保险股份有限公司	50,000.00	13.59%

8.3 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	汇添富互利分级债券 A（场内简称：互利债 A）	-	-
	汇添富互利分级债券 B（场内简称：互利债 B）	-	-
	合计	-	-

注：本基金的基金管理人从业人员本报告期末未持有本基金。

8.4 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	汇添富互利分级债券 A（场内简称：互利债 A）	0
	汇添富互利分级债券 B（场内简称：互利债 B）	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富互利分级债券 A（场内简称：互利债 A）	0
	汇添富互利分级债券	0

	B (场内简称: 互利债 B)	
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	汇添富互利分级债券 A (场内简称: 互利债 A)	汇添富互利分级债券 B (场内简称: 互利债 B)
基金合同生效日 (2013 年 11 月 6 日) 基金份额总额	473,834,828.33	210,806,137.49
本报告期期初基金份额总额	473,834,828.33	210,806,137.49
本报告期基金总申购份额	98,308,729.27	-
减: 本报告期基金总赎回份额	377,333,245.12	-
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	11,278,549.85	-
本报告期末基金份额总额	206,088,862.33	210,806,137.49

注: 本基金基金合同生效之日起 3 年内, 互利 A 将自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次, 互利 B 封闭运作并上市交易。互利 A 的每次开放日, 基金管理人将对互利 A 进行基金份额折算, 互利 A 的基金份额净值调整为 1.000 元, 基金份额持有人持有的互利 A 份额数按折算比例相应增减。

§ 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

本基金投资策略未发生改变。

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

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	-	-	-	-	-

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	488,351,615.12	100.00%	11,333,100,000.00	100.00%	-	-

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 2 个交易单元与汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富新收益债券证券投资基金、添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金共用。本报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

10.8 其他重大事件

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	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
4	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
5	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 B 份额开通跨系统转托管业务的公告	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 4 日
6	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
7	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
8	汇添富互利分级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, 深交所	2014 年 4 月 22 日

9	汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 B 基金份额上市交易公告书	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 25 日
10	汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额开放日常申购、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, 深交所	2014 年 4 月 29 日
11	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额开放申购、赎回期间互利债 B 基金份额风险提示性公告	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 29 日
12	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额折算方案公告	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 29 日
13	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 B 基金份额上市交易提示性公告	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 30 日
14	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 B 基金份额暂停交易的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 5 月 5 日
15	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额增加中国银行为场外销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 5 月 5 日
16	关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额折算和申购与赎回结果的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 5 月 7 日
17	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
18	汇添富基金汇添富基金管理股份有限公司	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深	2014 年 6 月 11 日

	关于旗下部分基金增加大同证券为销售机构的公告	交所	
19	汇添富互利分级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6月19日
20	汇添富互利分级债券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6月19日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富互利分级债券证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富互利分级债券证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富互利分级债券证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内汇添富互利分级债券证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
- 6、中国证监会要求的其他文件。

11.2 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

11.3 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