# 汇添富消费行业股票型证券投资基金

## 2014 第二季度 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:中国建设银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014年7月19日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富消费行业股票 |
| 交易代码 | 000083 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年5月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 340,273,715.28份 |
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选消费行业的优质上市公司,结合市场脉络,做中长期布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘消费行业中商业模式独特、竞争优势明显,具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 中证主要消费行业指数× 40% + 中证可选消费行业指数× 40% + 上证国债指数× 20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年4月1日－2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | –2,511,402.89 |
| 2.本期利润 | 31,404,427.81 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0893 |
| 4.期末基金资产净值 | 424,946,678.63 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.249 |

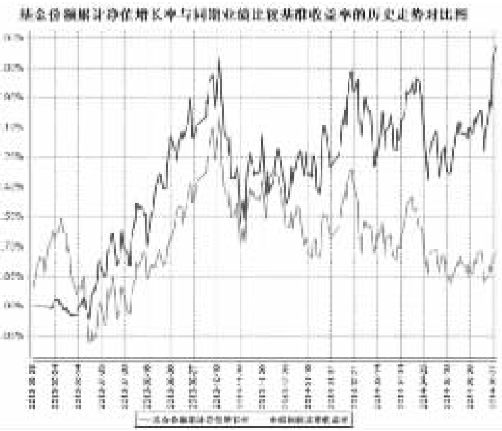
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 8.70% | 1.08% | 0.86% | 0.78% | 7.84% | 0.30% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年5月3日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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5月3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 公平交易专项说明

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,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为3次,其中2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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年2季度市场触底反弹,主要是在政府的托底预期下流动性环境开始改善,所以六月底市场出现了一波明显的上涨。从结构上看,代表传统经济的周期股继续疲软,而代表经济转型方向的互联网、医疗服务、信息安全等行业大幅反弹。

本基金在操作上坚持自下而上的投资方法,围绕消费升级和新消费这一核心趋势进行布局,主要投资集中在了日化、旅游、中药、乳业、传媒、互联网相关行业。其中旅游、互联网的相关标表现较好,帮助本基金取得了8.7%的正收益,而乳业、日化等白马股表现较差,对本基金有所拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年2季度,本基金净值上涨8.70%,跑赢业绩基准7.84%。同期沪深300上涨0.88%,中小板上涨4.25%,创业板上涨5.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年,我们认为在政府的底线思维支撑下,流动性环境的改善可以持续,所以对市场判断相对积极一些。但整体的经济状况依然难以出现大的转折,转型的背景下,国内经济去杠杆、去产能的进程不会改变,整体经济增长将回归到一个更加合理的水平,大部分产能过剩的制造业和周期性行业缺乏系统性机会。

中国的时代特征已经从由出口和投资拉动的发展,转向更有质量的增长,而我们判断互联网、医疗服务和环保就成为支撑未来新经济的基础产业。从消费基金的投资范围出发,在消费升级和移动互联网兴起的大背景下,我们继续看好会受益消费结构变化的日化、旅游、中药、乳业、传媒、互联网消费等行业,具体如下:

1、传统消费品行业中看好三类投资机会:

1) 受益消费结构变化的行业,度假休闲游、乳业;

2) 有中国传统特色的消费品公司,如中药消费品;

3) 互联网时代的品牌逆袭;

2、看好移动互联网普及带来的新消费行业,视频、游戏、教育以及产业链中的支付环节;

3、非消费行业看好医药以及环保相关行业:包括医院、行保行业、环保导致产能收缩的行业。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 369,335,612.46 | 84.47 |
| | 其中:股票 | 369,335,612.46 | 84.47 |
| 2 | 固定收益投资 | 27,981,400.00 | 6.40 |
| | 其中:债券 | 27,981,400.00 | 6.40 |
| | 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 | 27,560,811.15 | 6.30 |
| 7 | 其他资产 | 12,376,394.03 | 2.83 |
| 8 | 合计 | 437,254,217.64 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | – | – |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 129,761,078.60 | 30.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 5,321,836.80 | 1.25 |
| F | 批发和零售业 | 12,318,800.00 | 2.90 |
| 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 | 22,465,314.40 | 5.29 |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | – | – |
| L | 租赁和商务服务业 | 71,320,000.00 | 16.78 |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 72,526,991.20 | 17.07 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | – | – |
| P | 教育 | 31,760,391.46 | 7.47 |
| Q | 卫生和社会工作 | – | – |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 23,861,200.00 | 5.62 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 369,335,612.46 | 86.91 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300144 | 宋城演艺 | 1,580,000 | 41,996,400.00 | 9.88 |
| 2 | 002183 | 怡亚通 | 5,000,000 | 38,650,000.00 | 9.10 |
| 3 | 600138 | 中青旅 | 1,500,000 | 32,670,000.00 | 7.69 |
| 4 | 600661 | 新南洋 | 1,196,699 | 31,760,391.46 | 7.47 |
| 5 | 002094 | 青岛金王 | 2,500,000 | 28,500,000.00 | 6.71 |
| 6 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,600,000 | 25,840,000.00 | 6.08 |
| 7 | 300291 | 华录百纳 | 680,000 | 23,861,200.00 | 5.62 |
| 8 | 000716 | 南方食品 | 1,700,000 | 19,958,000.00 | 4.70 |
| 9 | 600315 | 上海家化 | 400,084 | 14,663,078.60 | 3.45 |
| 10 | 002563 | 森马服饰 | 540,000 | 14,661,000.00 | 3.45 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 18,005,400.00 | 4.24 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 9,976,000.00 | 2.35 |
| | 其中:政策性金融债 | 9,976,000.00 | 2.35 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | – | – |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 27,981,400.00 | 6.58 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 019314 | 13国债14 | 180,000 | 18,005,400.00 | 4.24 |
| 2 | 110418 | 11农发18 | 100,000 | 9,976,000.00 | 2.35 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 256,258.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,083,105.50 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 851,899.31 |
| 5 | 应收申购款 | 3,176,021.44 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | 9,109.00 |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 12,376,394.03 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 309,134,659.56 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 122,244,906.08 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 91,105,850.36 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列) | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 340,273,715.28 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富消费行业股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富消费行业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富消费行业股票型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、报告期内汇添富消费行业股票型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。

8.2 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

8.3 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7月19日**

---

# 汇添富信用债债券型证券投资基金

## 2014 第二季度 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:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014年7月19日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 汇添富信用债债券 | |
| 交易代码 | 470088 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011年12月20日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 33,988,700.47份 | |
| 投资目标 | 本基金主要投资于信用债券类固定收益品种,在严格管理投资风险、保持资产流动性的基础上,为基金份额持有人追求资产的长期稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的资产不低于基金固定收益类资产的80%;股票等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%;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%。 | |
| 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,属于证券投资基金中较低预期风险、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,低于混合型基金及股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 汇添富信用债A | 汇添富信用债C |
| 下属两级基金的交易代码 | 470088 | 470089 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 26,199,593.68份 | 7,789,106.79份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年4月1日－2014年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 汇添富信用债A | 汇添富信用债C |
| 1.本期已实现收益 | –5,642,354.41 | –483,468.55 |
| 2.本期利润 | 884,325.23 | 256,832.39 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0127 | 0.0286 |
| 4.期末基金资产净值 | 27,136,765.16 | 7,991,590.73 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.036 | 1.026 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

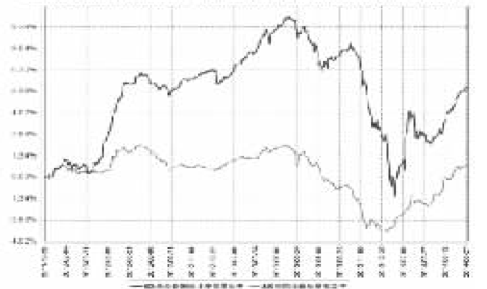
汇添富信用债A

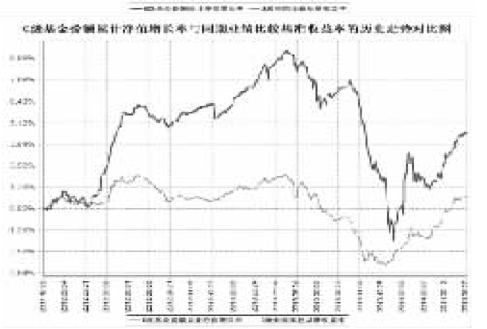
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.08% | 0.12% | 2.42% | 0.09% | 0.66% | 0.03% |

汇添富信用债C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.91% | 0.13% | 2.42% | 0.09% | 0.49% | 0.04% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年12月20日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈加荣 | 汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,汇添富双利债券基金、汇添富信用债债券基金、汇添富高息债债券基金、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。 |
| 何旻 | 汇添富安心中国债券基金、汇添富信用债债券基金的基金经理。 | 2014年1月21日 | – | 16年 | 国籍:中国。学历:英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格:基金从业资格、特许金融分析师(CFA)、财务风险经理人(FRM)。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理、固定收益部负责人;金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理,2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理,2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理,2008年9月3日至2009年3月10日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理,2009年3月29日至2010年12月29日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011年1月加入汇添富资产管理(香港)有限公司,2012年2月17日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,负责固定收益的研究和投资管理工作,2013年11月22日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理,2014年1月21日至今任汇添富信用债债券基金的基金经理。 |

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 公平交易专项说明

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,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为3次,其中2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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第二季度,国内消费价格指数(CPI)处于较低水平,4月仅为2%,之后两月由于去年同期基数较低而略有反弹。中国制造业采购经理指数(PMI)逐月上升,显示国内生产经营活动在复苏之中,但是反弹力度稍显不足。作为中国经济龙头的房地产行业,成交面积大幅下滑,房地产市场持续萎靡。6月初以来,房地产成交同比下跌40%,跌幅远高于上月,房地产市场疲态尽显。自4月以来,货币政策已经发生积极变化,包括定向降准和公开市场净投放。货币政策偏宽松,但仍以结构化政策为主,对基建、三农、小微企业、现代服务业相关银行定向宽松,而对过剩行业、房地产行业信贷依然偏紧。由于美国经济复苏,出口略有好转,但是进口方面依然疲弱。

在第二季度,市场资金宽松,加上整个宏观经济减速,所以债券市场延续了第一季度的上涨行情,只是在5月下旬和6月初,有小幅度的市场波动。第二季度,中债综合财富指数上涨幅度达到3.28%。标志性的10年国债收益率,最低下探至4.01%附近,在整个第二季度回落超过40个基点。

本基金在第二季度,积极操作,更换了组合中大部分债券,并且通过杠杆操作拉长组合久期。组合中增加高等级债券,提高组合流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为3.08%,C级净值增长率为2.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于去年第三季度基数较高,在目前刺激力度下,经济进一步下行压力较大,国内生产总值(GDP)将在7.5%以下,货币政策很可能会继续宽松,资金面也有望维持低位。我们判断,尽管无论利率债还是信用债,后期都存在较大供给压力,但在融资成本较高、企业盈利未改善大环境下,供给的冲击相对有限。就现券市场而言,第三季度收益率中枢有望继续下行。

债券市场上,我们相对看好利率债和城投债。城投债可能存在阶段性的加仓机会。而长端金融债的收益率仍有进一步下行空间。在后期操作上,我们会均衡配置,组合以高收益的交易所债券为主,另外增加高等级企业债配置,同时积极通过杠杆操作延长组合的久期。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 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 | 30,471,300.80 | 78.16 |
| | 其中:债券 | 30,471,300.80 | 78.16 |
| | 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 | 1,500,000.00 | 3.85 |
| | 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 | 6,093,139.78 | 15.63 |
| 7 | 其他资产 | 919,161.96 | 2.36 |
| 8 | 合计 | 38,983,602.54 | 100.00 |

5.2 报告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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | – | – |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | – | – |
| | 其中:政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | 30,471,300.80 | 86.74 |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | – | – |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 30,471,300.80 | 86.74 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1380265 | 13梅州债 | 100,000 | 10,111,000.00 | 28.78 |
| 2 | 112172 | 13普邦债 | 39,950 | 3,915,100.00 | 11.15 |
| 3 | 112059 | 11联化债 | 30,000 | 3,060,000.00 | 8.71 |
| 4 | 122106 | 11唐新01 | 30,000 | 3,017,400.00 | 8.59 |
| 5 | 112167 | 12莱士债 | 24,700 | 2,432,950.00 | 6.93 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 34,266.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 880,718.54 |
| 5 | 应收申购款 | 4,177.29 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 919,161.96 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 汇添富信用债A | 汇添富信用债C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 196,620,135.27 | 9,658,707.61 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,070,770.43 | 1,078,578.24 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 180,491,312.02 | 2,948,179.06 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列) | – | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 26,199,593.68 | 7,789,106.79 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富信用债债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富信用债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富信用债债券型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、报告期内汇添富信用债债券型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。

8.2 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

8.3 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7月19日**

---

# 汇添富新收益债券证券投资基金

## 2014 第二季度 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**
**报告送出日期:2014年7月19日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富新收益债券 |
| 交易代码 | 000366 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 71,901,469.83份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券资产,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上适度参与权益类品种投资,力争实现资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;股票资产的投资比例合计不超过基金资产的20%,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%,持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金通过参与一级市场新股申购、股票增发,以及因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票,不超过基金资产的20%;本基金通过二级市场直接买入股票或权证,所占比例不超过基金资产的5%。 |
| 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,属于证券投资基金中较低预期风险,较低预期收益品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年4月1日－2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 811,822.95 |
| 2.本期利润 | 831,700.97 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0087 |
| 4.期末基金资产净值 | 73,667,214.57 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.025 |

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。

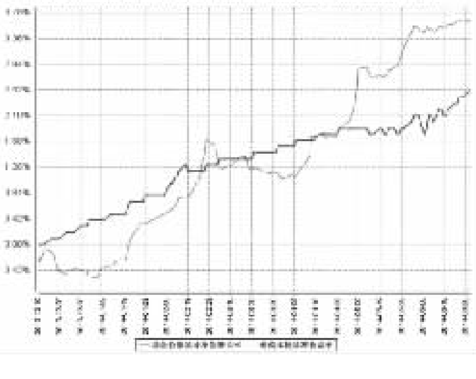
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.99% | 0.07% | 2.42% | 0.09% | –1.43% | –0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的《基金合同》生效日为2013年12月10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12月10日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 梁珂 | 汇添富可转换债券基金、汇添富新收益债券基金的基金经理。 | 2013年12月10日 | – | 6年 | 国籍:中国。学历:北京大学概率论及数理统计学学士、硕士,经济学双学位。相关业务资格:基金从业资格,特许金融分析师(CFA)。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。2012年11月加入汇添富基金管理股份有限公司从事固定收益研究。2013年3月28日至今任汇添富可转换债券债券的基金经理,2013年12月10日至今任汇添富新收益债券基金的基金经理。 |

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 公平交易专项说明

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,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为3次,其中2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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

随着政策托底的力量逐渐增强,二季度货币政策宽松由预期向现实转换,资金面持续宽松,国债、金融债和高等级信用债收益率显著下降,城投债和产业中的高收益品种交易活跃,收益率明显下降。然而,临近季度末,新股申购带来的资金面冲击与贷存比指标调整叠加,遏制了债券市场持续上涨的动力,收益率开始出现小幅度调整。与债券市场的持续火爆对应,A股市场整体波动幅度进一步收窄,市场热点切换更为迅速。

具体来看,中债综合财富指数受益于货币政策利好,单季涨幅达到3.28%,转债市场受益于债底提升及流动性推动双重利好,单季度上涨5.48%,沪深300指数窄幅波动,期间小幅上涨0.88%。

本基金在报告期内以对流动性风险的控制为首要目标,并基于对政策环境、宏观经济、公司基本面和市场特征的密切跟踪,择取优质个券进行了适度集中配置,同时通过积极的波段操作有效地提高了组合收益,但受制于流动性压力及投资范围的临时受限,未能通过更激进的操作进一步扩大投资成果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年二季度本基金净值收益率为0.99%,同期业绩比较基准收益率为2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在转型期的政策环境下,经济增速中枢的稳步下行顺理成章,并不会构成实体经济和资本市场的主要风险,管理层的底线思维继续凸显,毕竟经济的适度增长仍是民生就业持续改善的必要条件。虽然目前二季度宏观数据已经出现好转迹象,但考虑到下半年面临的高基数压力仍会给7.5%左右经济增长预期目标的实现带来较大压力,我们判断,政策的调整幅度在三季度很可能将继续放大,我们也将继续重点关注货币政策、财政政策、产业政策的变化以及资本市场改革对于市场本身的影响。

不过,我们需要认识到,随着托底政策由"宽货币"向"宽信贷"的转化,市场面临的资金面和基本面的不确定可能也在增大。纯债类资产向偏权益资产的轮动在二季度已经开始,而三季度有可能会加速。虽然大的方向较为清晰,但短期内需要防范企业盈利滞后下滑以及局部风险引爆降低市场风险偏好的可能。资产配置上,我们将把握好市场节奏,择机将资产配置向偏权益品种切换,攻守兼备的转债将成为我们积极参与提高组合收益的重要投资方向。此外,一级市场方面,债券融资需求持续旺盛,新股申购赚钱效应延续,转债市场继续扩容,将为我们通过一二级市场套利提高组合收益提供良好的投资机会。

基于以上分析,我们考虑把握好组合流动性和收益能力的平衡,在未来一个阶段逐步提高对于以转债为代表的偏权益资产的配置力度。当然,我们会在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下保持组合操作灵活性,并结合一级市场的最新发展,努力通过一二级市场套利交易为投资者增厚投资回报。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 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 | 74,571,300.50 | 92.68 |
| | 其中:债券 | 74,571,300.50 | 92.68 |
| | 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 | 3,716,403.22 | 4.62 |
| 7 | 其他资产 | 2,172,123.22 | 2.70 |
| 8 | 合计 | 80,459,826.94 | 100.00 |

5.2 报告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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 3,613,680.00 | 4.91 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 10,017,000.00 | 13.60 |
| | 其中:政策性金融债 | 10,017,000.00 | 13.60 |
| 4 | 企业债券 | 41,946,485.20 | 56.94 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,129,000.00 | 13.75 |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | 521,192.00 | 0.71 |
| 8 | 其他 | 8,343,943.30 | 11.33 |
| 9 | 合计 | 74,571,300.50 | 101.23 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 041453003 | 14宁城建CP001 | 100,000 | 10,129,000.00 | 13.75 |
| 2 | 112083 | 11国星债 | 100,000 | 10,040,000.00 | 13.63 |
| 3 | 140212 | 14国开12 | 100,000 | 10,017,000.00 | 13.60 |
| 4 | 122108 | 11新天01 | 100,000 | 10,010,000.00 | 13.59 |
| 5 | 018003 | 国开1401 | 77,770 | 8,343,943.30 | 11.33 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 23,596.86 |
| 2 | 应收证券清算款 | 999,165.30 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 1,128,188.22 |
| 5 | 应收申购款 | 21,172.84 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 2,172,123.22 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 122,172,384.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,518,173.80 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 51,789,088.96 |
| 报告期期末基金份额总额 | 71,901,469.83 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富新收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富新收益债券型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、报告期内汇添富新收益债券型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。

8.2 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

8.3 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7月19日**