



Disclosure 信息披露

2015年7月17日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B71

华商双债丰利债券型证券投资基金

2015 第二季度报告

2015年6月30日

基金管理人：华商基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2015年7月17日

1.1 重要提示
基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。
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2015年7月16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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者自行承担投资风险，基金管理人不承担保证责任，对本基金的业绩表现不承担保证责任。
本报告所载数据截至2015年6月30日止。

1.2 基金基本情况	
基金名称	华商双债丰利债券型证券投资基金
基金代码	000609
交易场所	000609
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2014年4月18日
报告期末基金份额总额	1,594,026,961.09份
投资目标	本基金为债券型基金，主要投资于信用债、利率债、可转债、股票、权证、股指期货、国债期货等金融工具，在严格控制风险的前提下，通过严谨的信用分析和信用利用策略，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准。
投资策略	本基金为债券型基金，主要投资于信用债、利率债、可转债、股票、权证、股指期货、国债期货等金融工具，在严格控制风险的前提下，通过严谨的信用分析和信用利用策略，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，主要投资于信用债、利率债、可转债、股票、权证、股指期货、国债期货等金融工具，在严格控制风险的前提下，通过严谨的信用分析和信用利用策略，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准。
基金管理人	华商基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属基金的资金来源	华商双债丰利债券型证券投资基金
下属基金的资金用途	华商双债丰利债券型证券投资基金
报告期末下属基金的资金余额	1,072,346,195.60元

1.3 主要财务指标
1.3.1 主要财务指标和基金净值表现
1.3.2 基金净值表现

1.3.1 主要财务指标和基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.1.1 主要财务指标	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

1.3.2.2.1 基金净值表现	
报告期（2015年4月1日 - 2015年6月30日）	单位：人民币元
1.3.2.2.1 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金
1.3.2.2.1.2 基金净值表现	华商双债丰利债券型证券投资基金

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值变动说明
本报告期，本基金基金份额持有人数量未发生变动，未达到基金资产净值低于5000万元的情形。

5.1 报告期内基金资产组合情况
5.1.1 基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	400,402,235.17	14.36
2	固定收益投资	400,402,235.17	14.36
3	其中：债券	2,335,655,500.13	72.84
4	货币市场工具	2,335,655,500.13	72.84
5	银行存款	-	-
6	其他资产	-	-
7	其他负债	-	-
8	资产净值总计	12,000,000.00	0.17

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	400,402,235.17	14.36
2	固定收益投资	400,402,235.17	14.36
3	其中：债券	2,335,655,500.13	72.84
4	货币市场工具	2,335,655,500.13	72.84
5	银行存款	-	-
6	其他资产	-	-
7	其他负债	-	-
8	资产净值总计	12,000,000.00	0.17

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	400,402,235.17	14.36
2	固定收益投资	400,402,235.17	14.36
3	其中：债券	2,335,655,500.13	72.84
4	货币市场工具	2,335,655,500.13	72.84
5	银行存款	-	-
6	其他资产	-	-
7	其他负债	-	-
8	资产净值总计	12,000,000.00	0.17

G	文、体、卫、广电和旅游业	--	0.00
H	住宿和餐饮业	12,661,600.00	0.60
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,543,948.00	2.20
J	金融业	--	--
K	房地产业	20,601,958.30	0.97
L	租赁和商务服务业	--	--