

(上接 D26 版)

18)中信证券股份有限公司
地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 座
法定代表人:王东明
联系电话:0755-82588305
传真:010-84865560

26)汇添富基金管理股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 166 号未来资产大厦 27 层
法定代表人:林海
联系电话:021-63406788
网址:www.htfund.com

本基金将定量和定性研究相结合的研究方法体系,对于有数据证明,能够进行模型分析的因素,本基金力求进行定量研究,以加强对数据的把握能力,目前本基金使用的定量工具和技术主要有:
● 宏观经济指标预测模型,涵盖主要宏观经济指标的预测(如 GDP、CPI、固定资产投资、工业增加值、存款、贷款)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(亿), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 090310, 090213, 019711, 019914, 1081194.

6. 报告期内未兑付公允价值占基金资产净值比例大小排名前十名的资产支持证券明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7. 报告期内未兑付公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名的权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 存出保证金, 应收清算款项, 应收股利, 应收利息, 其他应收款.

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Row 1: 110003 新钢转债.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Rows include 000277 同仁堂, 000422 万科B, etc.

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

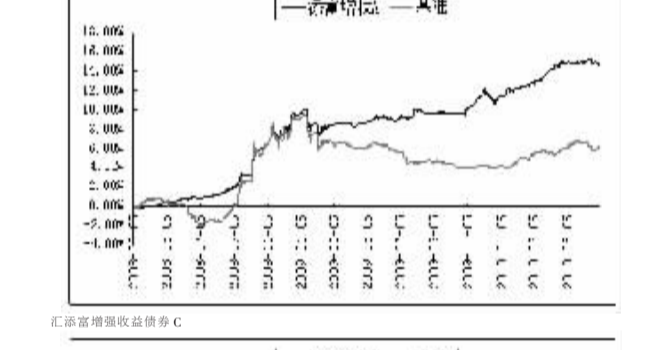
(一)基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:
汇添富增强收益债券 A

Table with 7 columns: 阶段, 净值增长率(%), 净值增长率标准差(%), 业绩比较基准收益率(%), 业绩比较基准收益率标准差(%), 0-1, 0-1. Rows for 2008年3月6日, 2009年1月1日至2009年12月31日, etc.

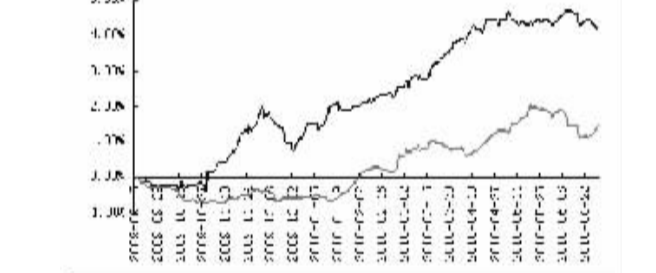
汇添富增强收益债券 C

Table with 7 columns: 阶段, 净值增长率(%), 净值增长率标准差(%), 业绩比较基准收益率(%), 业绩比较基准收益率标准差(%), 0-1, 0-1. Rows for 2009年9月15日, 2010年1月1日至2010年6月30日, etc.

(二)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图
汇添富增强收益债券 A



汇添富增强收益债券 C



十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用
1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 销售服务费;
4. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;