（上接D18版）
传真:022-28451892
联系人:王兆权
网址:www.bhzq.com
客户服务电话:400-6515-988
21 财富证券有限责任公司
住所:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27、28楼
法定代表人:周晖
咨询电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
联系人:郭磊
网址:www.cfzq.com
22 财通证券有限责任公司
法定代表人:沈继宁
联系人:乔骏
电话:0571-87925129
注册地:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
23)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
邮政编码:518034
法定代表人:黄耀华
电话:0755-83516089
传真:0755-83515567
24)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:95579或4008-888-999
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
长江证券客户服务网站:www.95579.com
25)德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
开放式基金咨询电话:4008888128
开放式基金业务传真:021-68767032
联系人:叶蕾
联系电话:021-68761616-8522
网址:www.tebon.com.cn
26)第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
开放式基金咨询电话:4008881888
开放式基金业务传真:0755-82485081
联系人:崔国良
联系电话:075525832852
网址:www.fcsc.cn
27)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人:潘锴
电话:0431-85096709
客户服务电话:4006000686 0431-85096733
网址:www.nesc.cn
28)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务热线:95503
东方证券网站:www.dfzq.com.cn
29)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客服电话:0512-33396288
网址:www.dwzq.com.cn
30)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
公司地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
全国统一客服热线:95571
方正证券网站:www.foundersc.com
31)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨、李芳芳
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788、10108998
公司网址:www.ebscn.com
32)广发证券股份有限公司
法定代表人:林治海
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:020-87555305
公司网站:广发证券网 http://www.gf.com.cn
33)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:刘东
开放式基金咨询电话:020-961303
开放式基金业务传真:020-87325036
联系人:林洁茹
联系电话:020-87322668
34)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
开放式基金咨询电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
35)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
办公地址:深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人:张雅锋
电 话:0755-83709350
传 真:0755-83700205
36)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:金喆
客户服务电话:400-660-0109
网址:www.gjzq.com.cn
37)国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6-8楼
法定代表人:雷建辉
基金业务对外联系人:徐 欣
联系电话:0510-82831662
联系传真:0510-82830162
公司网址:www.glsc.com.cn
客服电话:4008885288
38)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
客户服务热线:4008888666
网址:www.gtja.com
39)海通证券股份有限公司
注册地址: 上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021- 23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:95553
公司网址:www.htsec.com
40)恒泰长财证券有限责任公司
注册地址:吉林省长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段
法定代表人:赵培武
联系人:吴德森
电话:0431-82951765
传真:0431-82946531
网站:www.ccxq.net
客服热线:0431-82951765
41)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
联系人:王旭华
联系电话:0471-4972343
网址:www.cnht.com.cn
42)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
电话:010-88085858
传真:010-88085195
联系人:李巍
客户服务电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
43)红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
邮政编码:650011
法定代表人:况雨林
电 话:0871-3577398
传 真:0871-3578827
44)华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座
法定代表人:李工
电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
联系人:甘霖
客户服务电话:96518(安徽)、400-80-96518(全国)
网址:www.hazq.com
45)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
联系人:毛雪梅
电话:021-50122222
传真:021-50122218
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com
46)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张鹏
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)。
公司网址:www.hfzq.com.cn
47)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
联系人:李昕阳
客服电话:0931-96668、400-689-8888
公司网址:www.hlzqgs.com
48)华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址:深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人:马昭明
基金业务对外联系人:盛宗凌、庞晓芸
联系电话:0755-82492000
联系传真:0755-82492962
公司网址:www.lhzq.com
客服电话:95513
49)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:程高峰、万鸣
客服电话: 95597
网址:www.htsc.com.cn
50)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张宇宏
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务热线:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
51)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)
法定代表人:杨宇翔
全国免费业务咨询电话:95511-8
开放式基金业务传真:0755-82400862
联系人:郑舒丽(zhengshuli001@pingan.com.cn,0755-22626391)
网址:http://www.pingan.com
52)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
53)日信证券有限公司
注册地址: 呼和浩特市新城区锡林南路18号
联络地址: 呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈书杉
联系电话:010-88086830-730
网址:www.rxzq.com.cn
54)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:刘弘
电话:010-5832-8366010-5832-8722
传真:010-5832-8748
联系人:邱培玲、刘慧
客户服务电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com
55)山西证券股份有限公司
办公(注册)地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郝晴
联系电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客服电话:400-666-1618
网址:www.i618.com.cn
56)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
传真:021-54038844
客服电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
网址:www.sywg.com
57)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层
法定代表人:卢长才
联系人:方文
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网站: www.csco.com.cn
客服热线:0755-83199511
58)天源证券经纪有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号
办公地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人: 林小明
电 话:0755-33331188
传 真:0755-33329815
59)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
办公地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
法定代表人:张建军
开放式基金咨询电话:400-8888-133
开放式基金接收传真:020-22373718-1013
联系人:罗剑斌
联系电话:020-37865070
邮箱:luoeb@wlzq.com.cn
网址:www.wlzq.com.cn
60)西藏同信证券有限责任公司
注册地址:拉萨市北京中路101号
联系人:刘宇
网址:www.xzsec.com
客户服务电话:400-881-1177
61)西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:王珠林
客户服务电话:4008-096-096
网址:www.swsc.com.cn
62)厦门证券有限公司
地址:厦门市莲前西路2号
客户服务电话:0592-5163588
公司网址:www.xmzq.cn
63)湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地点:湖南省长沙市芙心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:钟瑶 021-68634518-8503
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com
64)信达证券股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
65)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
客服电话:95562
业务联系电话:021-38565785
业务联系人:谢高得
传真:021-38565955
兴业证券公司网站(www.xyzq.com.cn)
66)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:顾伟国
开放式基金咨询电话:4008-888-888
开放式基金业务传真:010-83574078
联系人: 田薇
联系电话:010-66568430
网址:www.chinastock.com.cn
67)英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
联系人:王睿
电话:0755-83007069
传真:0755-83007167
客服电话:4008-698-698
网址:www.ydsc.com.cn
68)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:95565、4008888111
公司网址:www.newone.com.cn
69)浙商证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
电话: 0571-87901908、0571-87901053
传真:0571-87901913
联系人:刘虹、谢项辉
客户服务电话:0571-967777
公司网址:www.stocke.com.cn
70)中航证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
办公地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
电话:0791-6768681
联系人:戴蕾
客户服务电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com
71)中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.cjis.cn
客服电话:400-600-8008
72)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人姓名:王常青
基金业务对外联系人:权唐
联系电话:400-8888-108
联系传真:010-65182261
公司网址:www.csc.com.cn
客服电话:400-8888-108
73)中信证券(浙江)有限责任公司
公司注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
公司办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法人代表:沈强
邮政编码:310052
联系人:丁思聪
联系电话:0571-96598
公司网站:www.bigsun.com.cn
74)中信万通证券有限责任公司
法定代表人:杨宝林
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
基金业务联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn
75)中信证券股份有限公司
住址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人:王东明
电话:010-84588888
传真:010-84865560
联系人:陈忠
公司网址:www.ecitic.com
76)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
联系人:李丹
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务电话:021-68604866
公司网址:www.bocichina.com
77)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:石保上
联系人:程月艳、耿铭
联系电话:0371—65585670
联系传真:0371—65585665
客服电话:967218(郑州市外客户需要加拨区号)、400-813-9666
网址:www.ccnew.com
78)天相投资顾问有限公司
注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编:100132
办公地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层 邮编:100133
法定代表人:林义相
联系电话: 010-66045608
客服电话: 010-66045678
传真: 010-66045500
联系人:林爽
天相基金网网址:http://jijin.txsec.com
79)财富里昂证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼
法定代表人:罗浩
电话:021-38784818
传真:021-68775878
联系人:倪丹
客户服务电话:68777877
公司网站:www.cf-clsa.com
80)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
法定代表人:高竹
电 话:0755-82545555
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并及时公告。
(二)基金注册登记机构
1、汇添富增强收益债券型证券投资基金A类的注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:010-58598835
传真:010-58598907
联系人:任瑞新
2、汇添富增强收益债券型证券投资基金C类的注册登记机构
名称:汇添富基金管理有限公司
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼
法定代表人:桂水发
电话:021-28932888
传真:021-28932998
联系人:王小练
(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
负责人:韩炯
经办律师:秦悦民、傅轶
电话:021-68818100
传真:021-68816880
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所
法定代表人:葛明
住所: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
办公地址: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
邮政编码:100738
公司电话:010-58153000
公司传真:010-85188298
签章会计师:徐艳、汤骏
业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金名称:汇添富增强收益债券型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金是契约型、开放式、债券型证券投资基金。

六、基金的投资目标

在严格控制投资风险的基础上,主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种,力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。

七、基金投资方向

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券、资产支持证券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等,以及参与新股申购等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为基金资产的80%-100%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,股票(由新股申购所得,不在二级市场买入)等权益类品种的投资比例为基金资产的0-20%。

八、基金的投资策略

(一)股资策略

1、类属配置

类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。

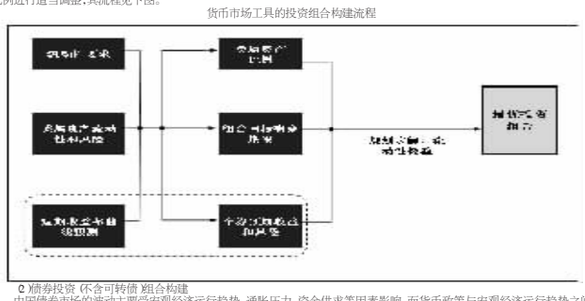
2、组合构建

①)货币市场工具

货币市场工具是指到期期限在1年以内(包括1年)的短期固定收益工具,主要包括回购、到期期限在1年以内的短期国债和金融债、央行票价、短期融资券等等。货币市场工具的功能是进行基金的流动性管理,同时,当中长期债券收益率面临上升风险的情况下,货币市场工具可以起到较好的避险作用。

本基金对货币市场工具的投资策略是:在确定基金总体流动性要求的基础上,结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平,信用水平来确定货币市场工具组合资产配置,并定期对货币市场工具组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整,其流程见下图。

货币市场工具的投资组合构建流程



②)债券投资(不含可转债)组合构建

中国债券市场的波动主要受宏观经济运行趋势、通胀压力、资金供求等因素影响,而货币政策与宏观经济运行趋势之间存在紧密联系,以上因素共同构成债券市收益率的驱动机制。据此,本基金建立了自上而下和自下而上两方面的研究流程,自上而下的研究包含宏观基本面分析、资金技术面分析,自下而上的研究包含信用分析、个券分析、创新金融工具和交易策略分析,由此形成宏观和微观层面相配套的研究决策体系,最后形成具体的投资策略。本基金的债券研究投资流程见下图。

债券研究和投资流程

本基金推行定量和定性研究相结合的研究方法体系,对于有数据保证、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,涵盖主要关键经济指标的预测(如GDP、CPI、固定资产投资、工业增加值、存款、贷款、货币供应量等);

●利率期限结构模型

●组合构建模型

●信用风险评估体系

●VaR风险控制技术

●债券绩效评估体系

对于难以完全量化的影响因素,本基金利用定性研究方法,以便对市场运行趋势进行合理性的推断。

根据本基金的投资理念和对中国债券市场运行方式的理解,本基金建立了债券市场基本要素驱动模型(Fundamental Factors Driving Model,FFD Model),以此作为积极交易策略的基础。

FFD模型按照以下步骤构建:

第一,选择最能反映债券市场基本驱动因素的指标,建立其与债券收益率的历史关系。

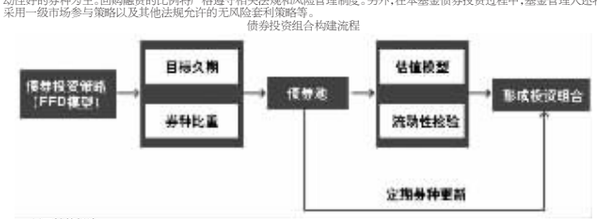
第二,根据久期控制和时机选择的交易策略原则,建立债券组合调整的原则,确定一定期限内组合的目标久期。

第三,滚动配置策略:定期对组合进行滚动配置,以维持组合中债券资产(不包括央票、短期融资券和活期存款等期限在1年以下的资产)必要的久期。

第四,收益率曲线策略和利差策略:在确定债券组合的期限结构后,本基金将主要运用积极的收益率曲线策略和利差策略。通过对不同类别债券的收益率差进行分析,预测其变动趋势,及时发现由于利差变动出现的价值被低估的债券品种,并结合税收差异和信用风险溢价等因素进行分析,综合评判个券的投资价值,以挑选风险收益特征最匹配的券种,建立具体的个券组合。另外,本基金将采用换券利差交易策略、凸性套利交易策略以及骑乘收益率曲线策略等交易策略。

第五,套利策略:当回购利率运行较为平稳的时期,将进行适当的回购融资套利,回购融资套利交易的债券品种主要以流动性好的券种为主。回购融资的比例将严格遵守相关法规和风险管理制度。另外,在本基金债券投资过程中,基金管理人还将采用一级市场参与策略以及其他法规允许的无风险套利策略等。

债券投资组合构建流程



③)可转债投资

对于本基金中可转债的投资,本基金管理人主要采用可转债相对价值分析策略。

由于可转债兼具债性和股性,其投资风险和收益介于股票和债券之间,可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值,把握可转债的价值走向,选择相应券种,从而获取较高投资收益。

其次,在进行可转债筛选时,本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果,对可转债的基础股票的基本面进行分析,形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起,最终确定投资的品种。

④)新股申购

本基金将研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,最终制定相应的新股申购策略。本基金通过参与新股认购所获得的股票,将根据其上市后的二级市场价格相对于其合理内在价值的高低,确定继续持有或者卖出,但最长持有期限不超过半年。

(二)股资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

①)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;

②)国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响;

③)企业信用评级;

④)国家货币政策及债券市场政策;

⑤)商业银行的信贷扩张。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策团队制,强调团队合作,充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合,设立了投资研究部,策略分析师、固定收益分析师、金融工程小组和基金经理立足本职工作,充分发挥主观能动性,渗透到投资研究的关键环节,群策群力,为基金份额持有人谋取中长期稳定的较高投资回报。

3、投资决策程序

本基金具体的投资决策机制与流程为:

①)固定收益分析师根据宏观经济形势、央行货币投放、商业银行信贷扩张以及国际资本的流动等判断市场利率的走向提交策略报告并进行讨论。

②)基金经理在策略报告的基础之上提出资产配置的建议。

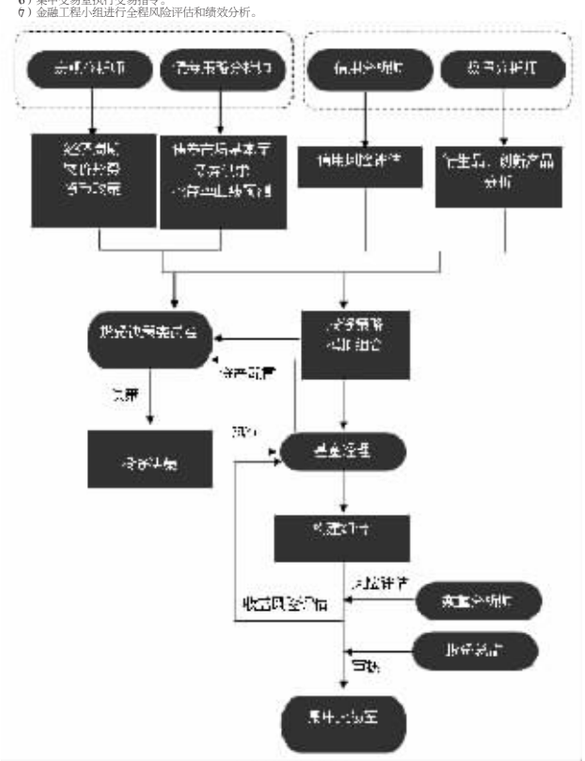
③)投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议,并确定资产配置比例的范围。

④)固定收益分析师对债券品种的收益率、信用风险和流动性风险进行评估,并向基金经理推荐。

⑤)基金经理在考虑资产配置的情况下,挑选合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。

⑥)集中交易室执行交易指令。

⑦)金融工程小组进行全程风险评估和绩效分析。



九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债总指数。

选择中债总指数作为本基金比较基准的依据的主要理由是:第一,该指数由中央国债登记结算公司编制,并在中国债券网(www.chinabond.com.cn)公开发布,具有较强的权威性和市场影响力;第二,该指数的样本券涵盖面广,能较好地反映债券市场的整体收益。

如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

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2012年1月18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。

本报告期自2011年10月1日起至12月31日止。

投资组合报告

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	62,186,887.95	4.73
	其中:股票	62,186,887.95	4.73
2	固定收益投资	1,214,813,806.77	92.46
	其中:债券	1,214,813,806.77	92.46
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	19,337,460.54	1.47
6	其他资产	17,508,111.97	1.33
7	合计	1,313,846,267.23	100.00

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	采掘业	-	-
C	制造业	39,232,872.46	3.00
C0	食品、饮料	21,336,000.00	1.63
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	17,896,872.46	1.37
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,803,394.68	0.14
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,526,174.70	0.19
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	1,949,590.11	0.15
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	16,674,856.00	1.28
M	综合类	-	-
	合计	62,186,887.95	4.76

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	002646	青青稞酒	1,200,000	21,336,000.00	1.63
2	601928	凤凰传媒	1,994,600	16,674,856.00	1.28
3	601100	恒立油缸	785,046	13,118,118.66	1.00
4	601222	林洋电子	303,308	3,212,031.72	0.25
5	002253	川大智胜	107,726	2,526,174.70	0.19
6	601336	新华保险	69,953	1,949,590.11	0.15
7	601886	江河幕墙	129,183	1,803,394.68	0.14
8	601908	京运通	72,668	1,566,722.08	0.12

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	138,124,000.00	10.57
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	478,774,280.45	36.64
5	企业短期融资券	80,574,000.00	6.17
6	中期票据	236,526,000.00	18.10
7	可转债	280,815,526.32	21.49
8	其他	-	-
9	合计	1,214,813,806.77	92.96

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110015	石化转债	1,061,550	106,696,390.50	8.16
2	1182282	11三一MTN2	800,000	83,928,000.00	6.42
3	110003	新钢转债	704,530	70,241,641.00	5.37
4	1101078	11央行票据78	600,000	60,798,000.00	4.65
5	1101088	11央行票据88	600,000	57,978,000.00	4.44

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,115,182.61
5	应收申购款	142,929.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,508,111.97

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	106,696,390.50	8.16
2	110003	新钢转债	70,241,641.00	5.37
3	113001	中行转债	41,982,170.40	3.21
4	110013	国投转债	15,310,093.50	1.17
5	110016	川投转债	9,956,044.80	0.76
6	110012	海运转债	7,998,673.20	0.61
7	126729	燕京转债	5,018,476.42	0.38

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
1	002646	青青稞酒	21,336,000.00	1.63	网下新股锁定
2	601928	凤凰传媒	16,674,856.00	1.28	网下新股锁定
3	601100	恒立油缸	13,118,118.66	1.00	网下新股锁定
4	601336	新华保险	1,949,590.11	0.15	网下新股锁定

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代表其未来表现。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)基金份额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

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)
2008年3月6日(基金合同生效日)至2008年12月31日	9.55%	0.14%	9.03%	0.23%	0.52%	-0.09%
2009年1月1日至2009年12月31日	1.83%	0.12%	-4.44%	0.11%	6.27%	0.01%
2010年1月1日至2010年12月31日	7.14%	0.19%	-0.87%	0.10%	8.01%	0.09%
2011年1月1日至2011年12月31日	-1.33%	0.20%	2.52%	0.11%	-3.85%	0.09%
2008年3月6日(基金合同生效日)至2011年12月31日	17.95%	0.17%	5.88%	0.14%	12.07%	0.03%

汇添富增强收益债券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)
2009年9月15日(按收费模式不同,汇添富增强收益债券增加C类收费模式)至2009年12月31日	1.53%	0.13%	-0.52%	0.04%	2.05%	0.09%
2010年1月1日至2010年12月31日	6.77%	0.19%	-0.87%	0.10%	7.64%	0.09%
2011年1月1日至2011年12月31日	-1.52%	0.20%	2.52%	0.11%	-4.04%	0.09%
2009年9月15日(按收费模式不同,汇添富增强收益债券增加C类收费模式)至2011