

汇添富增强收益债券型证券投资基金

2012 第二季度 报告

一九九二年六月三十日

序号	项目	金额/单位	占基金总资产的比例/百分比
资产	权益投资	权益类证券投资总额	权益类证券投资比例
	其中:股票	权益类证券投资总额	权益类证券投资比例
	固定收益投资	固定收益类证券投资总额	固定收益类证券投资比例
	其中:债券	固定收益类证券投资总额	固定收益类证券投资比例
	资产支持证券	原	原
负债	金融衍生品投资	原	原
资产	买入返售金融资产	原	原
	其中:回购和买断的买入返售金融资产	原	原
负债	银行借款和结算备付金合计	原	原
资产	其他资产	原	原
负债	合计	原	原
按报告期末行业分类的股票投资组合			
代码	行业类别	公允价值/单位	占基金资产净值比例/百分比
医药	化学/生物/医药	原	原
材料	采矿业	原	原
农业	种植业	权益类证券投资总额	权益类证券投资比例
消费品	食品饮料	原	原
消费品	纺织/服装/家纺/毛	权益类证券投资总额	权益类证券投资比例
消费品	木材/造纸	原	原
消费品	造纸/印刷	原	原
消费品	石油/化学/橡胶/塑料	原	原
消费品	电子	原	原
消费品	金属/贵金属	原	原
消费品	机械/设备/仪表	原	原

住宿	医药类、制品	原	原
住宿	其他制造业	原	原
电	电力、燃气及水的生产和供应业	原	原
水	建筑业	建筑业(含水利)	建筑业
云	交通运输、仓储业	原	原
邮	信息技术业	原	原
勾	批发和零售业	原	原
金	金融服务业	原	原
允	房地产业	原	原
运	社会服务业	建筑业(含水利)	建筑业
播	传媒与文化产业	原	原
配	综合类	原	原
	合计	16个行业涉及全部经济类型	16个行业

[illegible]

④ 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 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。

⑥ 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	
5	应收申购款	

远	其他应收款		原
苑	待摊费用		
愿	其他		
怨	合计		1 请填列至报表附表

五、报告期内未有的关于转股期的可转换债明细

序号	债券代码	可转债名称	公允价值(万元)	占基金资产净值比例(%)
员	124004	新钢转债	12,400,400.00	1.00%
圆	124003	川投转债	12,400,300.00	1.00%
猿	124002	石化转债	12,400,200.00	1.00%
源	124001	博林转债	12,400,100.00	1.00%

远	远电转债	远电转债	远电转债	远电转债
远	远电转债	远电转债	远电转债	远电转债
远	远电转债	远电转债	远电转债	远电转债

注：本基金本报告期末前十名股票中不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不存在流通受限的情况

（四）开放式基金资产净值变动情况

项目	正收益/净增值收益信息	负收益/净增值收益信息
本报告期初基金份额总额		
本报告期基金份额总额		
本报告期基金份额总额		
本报告期基金份额总额		

本报告期末基金份额变动份额	份	份
本报告期末基金份额总额	份	份

附备查文件目录

一、备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富增强收益债券型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富增强收益债券型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富增强收益债券型证券投资基金托管协议》；

4、汇添富基金管理人的业务资格批件、营业执照；

5、报告期内，汇添富增强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、对中国证监会要求的其他文件。

二、存放地点

上海市浦东新区世纪大道 1688 号 汇添富基金管理有限公司

投资者可于本基金管理人办公时间查阅,或登录基金管理人网站<http://www.hongshifund.com>查询,还可拨打基金管理人客户服务中心电话;service@hongshifund.com咨询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
四〇二〇年九月

● 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
----	------	------	------	--------	-----------

报告期内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/张数	公允价值/元
1	160408	石化转债	1,000,000	100,000.00

圖2年6月30日

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，为基金份额持有人谋求最大利益。

(四) 投资组合报告附注

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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的各该股票库。

(五) 其他资产构成

序号	名称	金额/净值(元)
1	存出保证金	9,067,810.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,000,000.00
5	应收申购款	1,000,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,067,810.25

本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)	占基金净资产比例(%)
1	121012	石化转债	1,000,000.00	0.01%
2	121015	国电转债	1,000,000.00	0.01%
3	121011	歌华转债	1,000,000.00	0.01%

徐	徐建明先生	中泰证券	《证券发行与承销业务资格》	从业资格
远	远志明先生	中泰证券	《证券发行与承销业务资格》	从业资格
范	范建明先生	仁东证券	《证券发行与承销业务资格》	从业资格
郭	郭建明先生	国信证券	《证券发行与承销业务资格》	从业资格
恩	恩建明先生	川投证券	《证券发行与承销业务资格》	从业资格
洪	洪建明先生	海盈证券	《证券发行与承销业务资格》	从业资格
洪	洪建明先生	新锦程证券	《证券发行与承销业务资格》	从业资格

③截至报告期末前10名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

④开放式基金份额变动

项目	汇添富可转换债券 粤	汇添富可转换债券 沪
本报告期初基金份额总额	《证券发行与承销业务资格》	《证券发行与承销业务资格》
本报告期基金总申购份额	《证券发行与承销业务资格》	《证券发行与承销业务资格》
减：本报告期基金总赎回份额	《证券发行与承销业务资格》	《证券发行与承销业务资格》
本报告期基金净变动份额	原	原
本报告期末基金份额总额	《证券发行与承销业务资格》	《证券发行与承销业务资格》

⑤备查文件目录

①备查文件目录

②中国证监会核准汇添富可转换债券债券型证券投资基金募集的文件。

● 本基金可转换债券型证券投资基金受托管理协议；

● 基金管理人业务资格批复、营业执照；

● 报告期内本基金可转换债券型证券投资基金在指定网站上披露的各项公告；

● 中国证监会要求的其他文件。

（四）存放地点

上海市浦东新区世纪大道国际大厦 26 楼 汇添富基金管理有限公司

（五）调阅方式

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.huttfund.com 查阅点，还可拨打基金管理人客户服务中心电话，或发送邮件至 service@huttfund.com 查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
董事长 刘成刚
