汇添富可转换债券债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012年第2号）

基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证监会证监许可[2010]1202号文核准募集。本基金合同于2010年12月3日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、公面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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财产，但对于证券投资基金中的风险因素，基金管理人应当在本招募说明书所载内容范围内采取必要措施予以防范或控制，但基金管理人对于证券投资基金中的风险因素的揭示或采取的措施，并不构成对本基金合同项下任何义务的承诺，也不构成对本基金投资收益的承诺。

本招募说明书所载内容截止日为2010年10月3日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：汇添富基金管理有限公司

住所：上海市黄浦区大沽路483号

办公地址：上海市嘉城路188号嘉定工业区远景路1号

法定代表人：潘鑫军

成立时间：1998年3月4日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[1998]第03号

注册资本：人民币5亿元

联系人：李文

联系电话：（021）33936888

股东名称及其出资比例：

股东名称	出资比例
东方证券股份有限公司	25%
文汇新民联合报业集团	25%
东航金戎控股有限责任公司	25%

（二）主要人员情况

董事会成员

潘鑫军先生，董事长，国籍：中国，1963年出生，澳门科技大学工商管理硕士，现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长，历任中国工商银行股份有限公司上海分行长宁支行党委书记、行长兼国际机场支行党支部书记，东方证券股份有限公司党委副书记、总裁、党委书记、董事长兼总裁。

肖顺喜先生，董事，国籍：中国，1963年出生，复旦大学EMBA，现任东航金戎控股有限责任公司总经理，东航集团财务有限责任公司董事长、东航国际控股（香港）有限公司董事长。历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理，东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

陈保平先生，董事，国籍：中国，1963年出生，高级编审，海洋交大EMBA，现任新民晚报社总编辑、党委副书记。历任文汇新民联合报业集团副社长、文汇新民联合报业集团投资公司总经理，上海青年报社编辑、记者、部主任、副总编，上海三联书店总编辑、沪港三联副董事长，上海文艺出版总社党委书记、副社长、总社总编辑等。

林利军先生，董事，总经理，国籍：中国，1966年出生，美国哈佛大学商学院工商管理硕士，复旦大学世界经济系硕士，历任上海证券交易所办公室主任助理、上市部总监助理，曾任职于中国证监会创业板筹备工作组，哈佛大学毕业后就职于美国道富金融集团（State Street Corporation），从事投资和风险管理工作。

韦杰夫先生，独立董事，国籍：美国，1946年出生，哈佛大学商学院工商管理硕士，哈佛大学肯尼迪政府学院荣誉访问学者。现任哈佛上海中心董事总经理。历任美国花旗银行香港分行副总裁，台湾美国运通银行台湾分行董事总经理，香港美国运通银行有限公司副总裁，台湾美国运通国际有限公司副总裁，澳门银行台湾分行总裁，深圳发展银行行长。

蔡来兴先生，独立董事，国籍：中国，1946年出生，上海同济大学学士，现任国务院参事室特约研究员，中国国学中心顾问，曾任上海市委、市政府副秘书长，香港上海实业集团董事长，香港上海实业控股有限公司董事长、第九、十、十一届全国政协委员，经济委员会委员。

林燕青女士，独立董事，国籍：中国，1956年出生，复旦大学经济学博士，现任《第一财经日报》副总编辑，中欧陆家嘴国际金融研究院特邀研究员，《第一财经日报》创刊编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学人》栏目创始人和主持人，《社会》栏目资深评论员。曾任《解放日报》主任记者，《第一财经日报》编委，《解放日报》期间受邀成为白皮书《社会加入学习研究者》。

侯俊华会成员

徐晓英先生，监事长，国籍：中国，1956年3月出生，上海财经大学硕士研究生，现任东航金戎控股有限责任公司研发中心总经理，历任东航期货经纪有限责任公司部门经理，副总经理等。

任瑞良先生，监事，国籍：中国，1956年3月出生，大学学历，中国注册会计师。现任文汇新民联合报业集团投资公司副总经理，历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管、文汇新民联合报业集团投资公司财务主管、总经理助理等。

李进安先生，监事，国籍：中国，1966年3月出生，金融学博士，中国注册会计师，律师资格。现任东方证券股份有限公司合规总监，兼任上海东方证券资产管理有限公司合规总监，历任君安证券股份有限公司总经理，国泰君安证券股份有限公司上海证券营业部总经理，总裁办公室、人事部、公司业务部主任，东吴证券有限责任公司总规划师、副总裁等职。

王静女士，职工监事，国籍：中国，1966年3月出生，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理有限公司行政支持部总监，曾任职于中国东方航空集团公司宣传部、东航金戎控股有限责任公司研究发展部。

林旋女士，职工监事，国籍：中国，1976年3月出生，华东政法学院法学硕士，现任汇添富基金管理有限公司稽核监察部高级经理，曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

董事会下设人员

潘鑫军先生，董事长，（简历请参见上述董事会成员介绍）

林利军先生，总经理，（简历请参见上述董事会成员介绍）

李文先生，督察长，国籍：中国，1966年3月出生，厦门大学管理学博士，高级经济师，中国注册会计师。历任中国人民银行厦门市分行稽核监察处科员、中国人民银行杏林支行副行长、中国人民银行厦门中心支行银行管理处处长助理、金融机构监管二处副处长、东方证券股份有限公司稽核总部总经理、资金财务管理总部总经理等。

张晖先生，副总经理，国籍：中国，1966年3月出生，经济学硕士，历任中银万国研究所高级分析师、富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理，曾任职于中国证券报社。

陈旭辉先生，副总经理，国籍：中国，1966年3月出生，金融学博士，中国注册会计师，律师资格。历任东方证券股份有限公司合规总监，兼任上海东方证券资产管理有限公司合规总监，历任君安证券股份有限公司总经理助理、国泰君安证券股份有限公司上海证券营业部总经理，总裁办公室、人事部、公司业务部总经理，总裁办公室、人事部、公司业务部主任，东吴证券有限责任公司总规划师、副总裁等职。

王玉先生，国籍：中国，1966年3月出生，澳门科技大学管理学硕士，1988年证券从业经验，曾任中银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理，1998年3月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管，1998年3月1日至今任汇添富货币市场基金的基金经理，1998年3月1日至1999年3月1日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，1999年3月1日至今任汇添富可转换债券型证券投资基金的基金经理，1999年3月1日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。

各投资决策委员会

主席：林利军先生（总经理）

副主席：张晖先生（副总经理）

成员：韩贤旺先生（研究总监）

以上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年01月01日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币350,640,000,000元

联系电话：（010）66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2010年9月30日，中国工商银行资产托管部共有员工200人，平均年龄36岁，100%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线，拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、政府性资产、境外资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、高收益信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、国际资产管理、人民币理财资产等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2010年9月30日，中国工商银行共托管证券投资基金1000多只，其中封闭式基金1只，自2000年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《环球投资人》、美国《环球金融》、内地《证券时报》等境内外权威财经媒体评选的最佳证券投资基金托管银行大奖，是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

直销机构

汇添富基金管理有限公司

①汇添富基金管理有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区大沽路483号

办公地址：上海市嘉城路188号嘉定工业区远景路1号

法定代表人：潘鑫军

电话：（021）33936888

传真：（021）33936888

联系人：丛琴

客户服务电话：（021）33936888（免长途话费）

网址：www.99fund.com

②汇添富基金管理有限公司网上直销系统

网银销售机构

①中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105799

联系人：刘业伟

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

②中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：www.abc.com.cn

③中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院5号楼

法定代表人：王洪章

电话：（010）67594455

传真：（010）67594454

联系人：王琳

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

④交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：曹裕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

⑤招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

开放式基金咨询电话：95555

开放式基金业务传真：（0755）83195201

联系人：邓炯鹏

网址：www.cmbchina.com

⑥中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：丰润

网址：www.citicbank.com

传真：（010）65557709

⑦上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山一路29号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）63611226

传真：（021）63611226

联系人：倪静云、虞俊云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

⑧深圳发展银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

电话：（0755）82080387

联系人：张青

客服电话：95501

公司网站：www.bankcomm.com

⑨中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门大街2号

法定代表人：董文标

电话：（010）68858029

传真：（010）68858029

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

⑩上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：俞一飞

开放式基金业务传真：（021）68475888

联系人：夏雪

客户服务电话：（021）962888

网址：www.bankofshanghai.com

⑪宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

开放式基金咨询电话：（0574）87050028（上海、北京地区免费）

联系人：胡技勤

联系电话：（0574）87050028

传真：（0574）87080026

网址：www.nbcb.com.cn

⑫上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道981号

办公地址：上海市银城中路501号中融碧玉蓝天大厦

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：（021）38576666

传真：（021）38576666

客服电话：（021）962999

上海农商银行网站：www.shrcb.com

⑬杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

电话：（0571）85108195

传真：（0571）85108195

联系人：严峻

客服电话：（0571）96523（0571）96523

网址：www.hzcbonline.com

⑭济南银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道59号

办公地址：天津市河西区马场道59号

法定代表人：刘宪凤

开放式基金咨询电话：（022）28315000

联系人：王宏

联系电话：（022）28315000

传真：（022）28315000

网址：www.jnbank.com.cn

⑮天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路8号

办公地址：天津市河西区友谊路8号

法定代表人：王金龙

联系人：杨鑫

电话：（022）58314666

传真：（022）58314666

客服电话：（022）96056

天津银行网站：www.tianjinbank.com

⑯厦门国际银行股份有限公司

注册地址：厦门市莲前西路2号

办公地址：厦门市莲前西路2号

法定代表人：吴万善

联系人：程高峰、万鸣

客服电话：（0592）96592

网址：www.gbicbank.com

⑰上海证券有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路138号

办公地址：上海市浦东新区银城中路138号

法定代表人：万建华

客户服务热线：（021）962518

网址：www.shzq.com

⑱国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人：何如

基金业务联系人：齐晓燕

电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133436

全国统一客服热线：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

⑲万联证券有限责任公司

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）63332888

传真：（021）63332888

联系人：金宏、李笑鸣

客服电话：（021）962598

公司网址：www.wanlitongxin.com

⑳国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国际投资大厦

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国际投资大厦

法定代表人：李剑

客服电话：（010）84183333

传真：（010）84183311

联系人：王旭华

网址：www.guodu.com

㉑华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路359号

办公地址：安徽省合肥市阜南路166号

法定代表人：李工

电话：（0551）5272143

传真：（0551）5272087

联系人：汪苏

客户服务电话：（0551）5272143（安徽）、（021）68655008（全国）

网址：www.huaanbank.com

㉒华安证券有限责任公司

注册地址：上海市世纪大道100号

办公地址：上海市世纪大道100号

法定代表人：陈林

联系人：夏天

电话：（021）68775123

传真：（021）68775123

客户服务电话：（021）68775118

网址：www.huaanbank.com

㉓平银证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路66号新天地大厦

办公地址：福州市五四路66号新天地大厦

法定代表人：黄金琳

邮政编码：350003

联系人：张艳

客户服务电话：（0591）96326

业务传真：（0591）87826808

统一客户服务电话：（0591）96326或收费全地营业网点

开放式基金业务传真：（0591）87826808

公司网站：www.pingan.com

㉔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号大都会广场43楼（1101-1110、1201-1216、1301-1316、1401-1416、1501-1516、1601-1616、1701-1716、1801-1816、1901-1916、2001-2016、2101-2116、2201-2216、2301-2316、2401-2416、2501-2516、2601-2616、2701-2716、2801-2816、2901-2916、3001-3016单元）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场43楼（1101-1110、1201-1216、1301-1316、1401-1416、1501-1516、1601-1616、1701-1716、1801-1816、1901-1916、2001-2016、2101-2116、2201-2216、2301-2316、2401-2416、2501-2516、2601-2616、2701-2716、2801-2816、2901-2916、3001-3016单元）

联系人：黄岚

统一客户服务热线：（020）961303或收费全地营业网点

开放式基金业务传真：（020）87557566

公司网站：www.gf.com.cn

㉕广州证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江西路15号广州国际金融中心主塔52层、53层

办公地址：广州市天河区珠江西路15号广州国际金融中心主塔52层、53层

法定代表人：刘东

开放式基金咨询电话：（020）87555888

开放式基金业务传真：（020）87557566

联系人：林洁茹

联系电话：（020）87555888

网址：www.gzs.com.cn

㉖安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心9楼

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心9楼

法定代表人：牟迎水

联系人：刘冠

电话：（0755）82558305

传真：（0755）82558305

业务联系人：谭高丹

传真：（0755）82558305

兴业证券公司网站：www.xyzq.com.cn

㉗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A座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦A座

法定代表人：顾伟国

开放式基金咨询电话：（010）66568888

开放式基金业务传真：（010）66568990

联系人：田薇

联系电话：（010）66568888

传真：（010）66568990

㉘招商证券股份有限公司

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38-45层

法定代表人：宫少林

电话：（0755）83199403

传真：（0755）83199403

联系人：林生迎

客户服务电话：（0755）83199403

公司网址：www.cmschina.com

㉙浙商证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市杭大路15号黄龙世纪广场9幢

办公地址：浙江省杭州市杭大路15号黄龙世纪广场9幢

法定代表人：吴雪

传真：（0571）87901913

联系人：刘虹、谢鸿辉

客户服务电话：（0571）96068

公司网址：www.stocke.com.cn

㉚中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦9楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦9楼

法定代表人：杜航

联系人：熊宇

客户服务电话：（0791）96561

网址：www.avicsec.com

㉛中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心9楼第1单元

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心9楼第1单元

法定代表人：张增来

联系人：刘毅

电话：（0755）83835888

传真：（0755）83835888

客户服务电话：（0755）95548

公司网址：www.citics.com

㉜中信万通证券有限责任公司

法定代表人：杨宝林

注册地址：青岛市崂山区深圳路191号

办公地址：青岛市崂山区深圳路191号

基金业务联系人：吴忠超

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022326

客户服务电话：（0532）96577

公司网址：www.citicwanlong.com

㉝中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7028号时代金融中心17楼

办公地址：深圳市福田区深南大道7028号时代金融中心17楼

法定代表人：张佑君

联系人：毛翔宇

电话：（0755）83026571

传真：（0755）83026571

客户服务电话：（0755）95548

公司网址：www.ecitic.com

㉞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9栋第18层、19层、20层、21层、22层、23层、24层、25层、26层、27层、28层、29层、30层、31层、32层、33层、34层、35层、36层、37层、38层、39层、40层、41层、42层、43层、44层、45层、46层、47层、48层、49层、50层单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心9栋第18层、19层、20层、21层、22层、23层、24层、25层、26层、27层、28层、29层、30层、31层、32层、33层、34层、35层、36层、37层、38层、39层、40层、41层、42层、43层、44层、45层、46层、47层、48层、49层、50层单元

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：（0755）82026539

传真：（0755）82026539

客户服务电话：（0755）95548

网址：www.citicsinfo.com

㉟国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凌顺平

联系人：沈强

电话：（0551）2207951

传真：（0551）2207951

客服电话：（0551）96888（全国）

网址：www.gyzq.com.cn

㊱本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的5%；

㊲本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

㊳本基金任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%；基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

㊴现金或到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%；

㊵本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金应按投资于信用级别评级为AAA级以上（含AAA级）的资产支持证券，基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

㊶本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

㊷本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

㊸本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

㊹除一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十五；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

㊺本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

㊻相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

基金管理人应当自基金合同生效日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督和检查自《基金合同》生效日起开始。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在基金交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率*90%+债综合指数收益率*10%。

天相转债指数是以沪深两市所有可转债的交易价格，按发行公司公告的实际未转股规模加权加权计算，反映两市可转债的总体走势。天相转债指数的基期为2000年1月4日，基准内收早编制的可转债指数。

中债综合指数是中国全市场债券指数，以2002年12月31日为基期，基点为100点，并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、金融债券、央行票据等所有主要债券种类。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，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的业绩基准的指数时，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，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。

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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

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	1,187,328,[illegible]	[illegible]
	其中：股票	1,187,328,[illegible]	[illegible]
2	固定收益投资	2,088,[illegible]	[illegible]
	其中：债券	2,088,[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
6	其他资产	[illegible]	[illegible]
7	合计	[illegible]	[illegible]

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	0.00	0.00
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	[illegible]	[illegible]
C0	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	0.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
C8	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
C9	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	[illegible]	[illegible]
H	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
I	金融、保险业	0.00	0.00
J	房地产业	0.00	0.00
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	[illegible]	[illegible]

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	[illegible]	东阿阿胶	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	中兴通讯	[illegible]	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	云南白药	[illegible]	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	贵州茅台	[illegible]	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	永辉超市	[illegible]	[illegible]	[illegible]
6	[illegible]	双汇发展	[illegible]	[illegible]	[illegible]
7	[illegible]	王府井	[illegible]	[illegible]	[illegible]
8	[illegible]	恒瑞股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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	0.00	0.00
2	央行票据	[illegible]	[illegible]
3	金融债券	0.00	0.00
	其中：政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	[illegible]	[illegible]
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债	[illegible]	[illegible]
8	其他	0.00	0.00
9	合计	[illegible]	[illegible]

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	[illegible]	石化转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	中行转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	国电转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	歌华转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	中最转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]

⑥报告期末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。

⑦报告期末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报告期末其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	[illegible]
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	[illegible]
5	应收申购款	[illegible]
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	[illegible]

⑨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	[illegible]	石化转债	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	中行转债	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	国电转债	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	歌华转债	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	中最转债	[illegible]	[illegible]
6	[illegible]	中海转债	[illegible]	[illegible]
7	[illegible]	新钢转债	[illegible]	[illegible]
8	[illegible]	唐钢转债	[illegible]	[illegible]
9	[illegible]	川投转债	[illegible]	[illegible]
10	[illegible]	海运转债	[illegible]	[illegible]

⑩报告期末前7个交易日内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	[illegible]	双汇发展	[illegible]	[illegible]	重大资产重组

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）本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

汇添富可转换债券

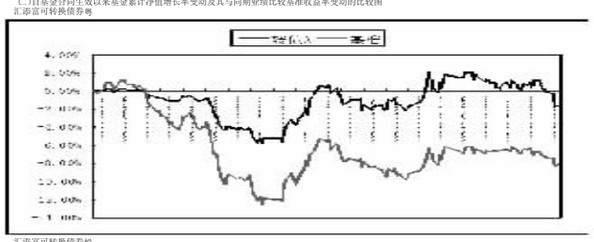
阶段	净值增长率①（%）	净值增长率标准差②（%）	业绩比较基准收益率③（%）	业绩比较基准收益率标准差④（%）	①-③（%）	②-④（%）
[illegible]（基金合同生效日）至[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]年1月1日至[illegible]年12月31日	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]年1月1日至[illegible]年6月30日	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

汇添富可转换债券悦

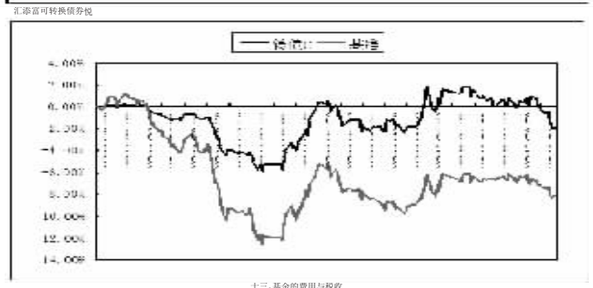
阶段	净值增长率①（%）	净值增长率标准差②（%）	业绩比较基准收益率③（%）	业绩比较基准收益率标准差④（%）	①-③（%）	②-④（%）
[illegible]（基金合同生效日）至[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]年1月1日至[illegible]年12月31日	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]年1月1日至[illegible]年6月30日	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

（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

汇添富可转换债券



汇添富可转换债券悦



十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

从基金资产的种类

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，本基金从[illegible]类基金份额的基金资产中计提的销售服务费；

④[illegible]基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

⑤[illegible]基金合同》生效后与基金相关的会计审费、律师费和诉讼费；

⑥基金份额持有人大会费用；

⑦基金的证券交易费用；

⑧基金的银行汇划费用；

⑨法规国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

②基金费用计提方法、计提标准和支付方式

①基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

[illegible]年天数

②当日应计提的基金托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

[illegible]年天数

③当日应计提的基金销售服务费

本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

[illegible]年天数

④当日应计提的基金份额持有人大会费

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前[illegible]个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述一“基金费用的种类”中第[illegible]款费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

⑤销售服务费

本基金[illegible