# 汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

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2015年10月23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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富蓝筹稳健混合 |
| 交易代码 | 519066 |
| 前端交易代码 | 519066 |
| 后端交易代码 | 519067 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年7月8日 |
| 报告期末基金份额总额 | 375,532,670.19份 |
| 投资目标 | 通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -50,196,082.06 |
| 2.本期利润 | -252,568,659.36 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.6433 |
| 4.期末基金资产净值 | 665,718,806.88 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.773 |

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

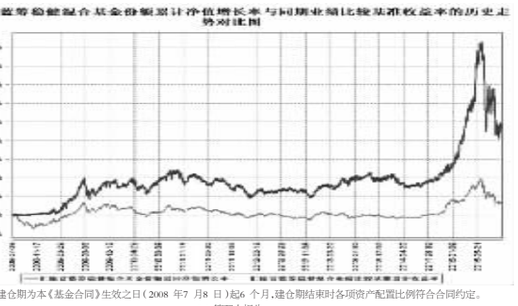
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -23.68% | 3.64% | -16.51% | 2.01% | -7.17% | 1.63% |

3.2.2 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




注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2008年7月8日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 叶从飞 | 汇添富均衡增长混合基金、汇添富蓝筹稳健混合基金、汇添富环保行业股票的基金经理。 | 2013年11月22日 | 2015年7月30日 | 11年 | 国籍:中国。学历:南京大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任中原证券股份有限公司资产管理部交易员、投资经理助理。2005年10月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任交易主管、基金经理助理。2012年3月2日至今任汇添富均衡增长混合基金的基金经理。2013年11月22日至2015年7月30日任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理。2014年9月16日至今任汇添富环保行业股票基金的基金经理。 |
| 雷鸣 | 汇添富成长焦点混合基金、汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理。 | 2015年1月6日 | - | 8年 | 国籍:中国。学历:华中科技大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2007年6月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业分析师、高级行业分析师。2014年3月27日至今任汇添富成长焦点混合基金的基金经理。2015年1月6日至今任汇添富蓝筹稳健混合股票基金的基金经理。 |

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场等各投资市场、债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿立项权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为1次,是由于合规控制原因调整导致,经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度,债市顺利打破"三季度魔咒",继续演绎牛市行情。受益于股市暴跌、IPO暂停,以及货币政策持续放松,资金宽松程度较前两个季度明显改善,加上机构对债券需求强劲,债券收益率再下台阶,其中10年金融债至9月底已经突破3.7%,较二季末下行40BP。信用债交投活跃,收益率降幅与金融债基本一致,但是一年期债券相对弱势,收益率窄幅波动,收益率曲线平坦化显著,表现出"牛平"特征。

与上季末相比,本基金规模继续缩水,受制于规模较小的影响,组合收益率难以明显提高。今年债券市场信用风险事件频发,并伴随大面积的债券评级下调,因此本基金在债券配置上更为谨慎,组合持仓以AA-AA+等中高等级品种为主,提高了组合的流动性和安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为0.4844%,B级净值增长率为0.5477%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

8月份金球金融市场剧烈动荡,美联储也因此决定延缓加息时点,没有选择9月份加息。但是在全球步入经济衰退的寒流中,唯独美国基本面稳健复苏,劳动力继续改善,预计年内加息仍是大概率事件,美元中期走强,加上大宗商品疲软,对新兴市场的打击可谓雪上加霜,也使我国进出口贸易受到较大冲击;投资方面,固定投资继续下滑,基建投资难以独唱大梁,房地产行业去库存压力仍大,房地产销量较之前两个季度已经开始回落,一线市场土地出让持续低迷,新开工难有显著回升,预计年内房地产投资对经济增长的贡献较小,四季度经济环比负增长可能性较大,货币政策的放松有必要保持连贯性。预计四季度债市仍有下行的空间,考虑到整体收益率已经处于低位,债市波动性大的特征仍会贯穿始终。此外,经济下行过程中,企业违约风险会显著增大,08二重债的实质性违约也给我们敲响了警钟。

由于本基金规模持续保持在1个亿以下,组合流动性管理难度有所增强,我们将持续跟踪每一个运作周期的特点,分析本基金的份额变动规律,提前做好债券与存款之间的配置计划,合理搭配回购、同业存款、短融、金融债等品种,力争在注重流动性的同时提高组合收益,同时会针对债券市场风险频发的现状,做好债券资质的筛查,避免出现所投债券评级下调、到期无法兑现的情况。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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 | 497,489,758.65 | 74.32 |
| | 其中:股票 | 497,489,758.65 | 74.32 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 10,022,000.00 | 1.50 |
| | 其中:债券 | 10,022,000.00 | 1.50 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 159,472,121.10 | 23.82 |
| 8 | 其他资产 | 2,416,160.16 | 0.36 |
| 9 | 合计 | 669,400,039.91 | 100.00 |

5.2 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 | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 165,935,059.45 | 24.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 120,399,000.00 | 18.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 98,834,960.96 | 14.85 |
| J | 金融业 | 45,728,131.04 | 6.87 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 43,393,471.20 | 6.52 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 23,199,136.00 | 3.48 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 497,489,758.65 | 74.73 |

5.3 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 | 002018 | 华信国际 | 3,200,000 | 69,248,000.00 | 10.40 |
| 2 | 002589 | 瑞康医药 | 1,920,000 | 61,152,000.00 | 9.19 |
| 3 | 600180 | 瑞茂通 | 2,900,000 | 59,247,000.00 | 8.90 |
| 4 | 002183 | 怡 亚 通 | 1,000,080 | 43,393,471.20 | 6.52 |
| 5 | 300383 | 光环新网 | 900,000 | 41,274,000.00 | 6.20 |
| 6 | 002037 | 久联发展 | 1,398,187 | 33,388,705.56 | 5.02 |
| 7 | 300359 | 全通教育 | 400,000 | 31,352,000.00 | 4.71 |
| 8 | 002390 | 信邦制药 | 2,641,101 | 27,441,039.39 | 4.12 |
| 9 | 600570 | 恒生电子 | 600,022 | 26,208,960.96 | 3.94 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 800,000 | 23,888,000.00 | 3.59 |

注:本基金持有的华信国际处于停牌状态,受基金净值波动影响,华信国际占基金资产净值比被动超过10%。本基金管理人将在该股票复牌后,按照法律法规及基金合同的相关规定及时做出调整。

5.4 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 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,022,000.00 | 1.51 |
| | 其中:政策性金融债 | 10,022,000.00 | 1.51 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 10,022,000.00 | 1.51 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 | 140230 | 14国开30 | 100,000 | 10,022,000.00 | 1.51 |

5.6 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,503,178.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 339,549.86 |
| 5 | 应收申购款 | 573,431.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,416,160.16 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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 | 002018 | 华信国际 | 69,248,000.00 | 10.40 | 重大资产重组停牌 |
| 2 | 002589 | 瑞康医药 | 61,152,000.00 | 9.19 | 重大事项停牌 |
| 3 | 002183 | 怡 亚 通 | 43,393,471.20 | 6.52 | 重大事项停牌 |
| 4 | 300383 | 光环新网 | 41,274,000.00 | 6.20 | 重大事项停牌 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期初基金份额总额 | 432,301,659.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 283,956,035.80 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 340,725,024.61 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 375,532,670.19 |

注:其中"总申购份额"含红利再投、转换入份额;"总赎回份额"含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 5,207,812.50 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 5,207,812.50 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 1.39 |

注:1、其中"申购/买入"含红利再投、转换入份额;"赎回/卖出"含转换出份额。

2、本基金于2008年7月8日成立。本公司于2015年7月6日用固有资金10,000,000.00元申购本基金份额5,207,812.50份,申购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的申购费率。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申购 | 2015年7月6日 | 5,207,812.50 | 10,000,000.00 | 0.01% |
| 合计 | | | 5,207,812.50 | 10,000,000.00 | |

注:该笔申购金额为10,000,000.00元,适用费率为1000元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 查阅方式

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.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年10月27日

# 汇添富可转换债券债券型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

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2015年10月23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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 汇添富可转换债券 | | |
| 交易代码 | 470058 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2011年6月17日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 164,960,706.43份 | | |
| 投资目标 | 本基金重点投资于可转换债券(包可分离交易可转债),努力在控制投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳健增值。 | | |
| 投资策略 | 本基金80%以上的基金资产投资于固定收益类金融工具,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展、包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机力争为基金资产获取稳健回报。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、不同类属债券利差水平研究,判断不同类属债券的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。 | | |
| 业绩比较基准 | 天相转债指数收益率×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10% | | |
| 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。 | | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富可转换债券A | 汇添富可转换债券C | |
| 下属分级基金的交易代码 | 470058 | 470059 | |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 74,518,060.84份 | 90,442,645.59份 | |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 汇添富可转换债券A | 汇添富可转换债券C |
| 1.本期已实现收益 | -23,021,744.06 | -27,863,427.36 |
| 2.本期利润 | -46,964,563.87 | -57,767,368.81 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.5760 | -0.5796 |
| 4.期末基金资产净值 | 97,906,605.93 | 116,893,830.77 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.314 | 1.292 |

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

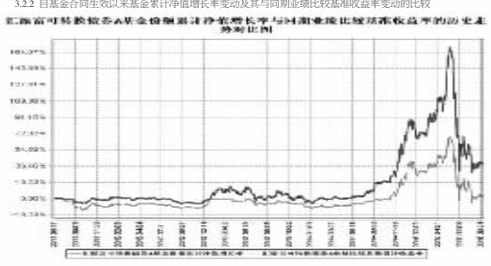
汇添富可转换债券A

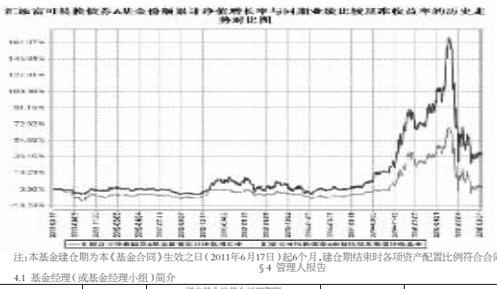
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -26.88% | 4.17% | -17.13% | 3.33% | -9.75% | 0.84% |

汇添富可转换债券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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -27.01% | 4.17% | -17.13% | 3.33% | -9.88% | 0.84% |

3.2.2 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




注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年6月17日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 曾刚 | 汇添富多元收益债券基金、可转换债券基金、实业债债券基金的基金经理,汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。 | 2013年2月7日 | - | 14年 | 国籍:中国。学历:中国科技大学经济学硕士、MBA。业务资格:基金从业资格。从业经历:曾在红塔证券、汉唐证券、华宝兴业基金由贵至高经济和债券的研究。2008年5月15日至2010年2月5日任华富货币基金的基金经理。2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理。2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、基金经理助理。现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理。2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理。2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理。2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理。2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理。2013年2月7日至今任汇添富多元收益债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理助理。2013年3月28日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理。2013年12月31日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理。 |
| 梁珂 | 汇添富可转换债券基金的基金经理。 | 2013年3月28日 | 2015年7月22日 | 7年 | 国籍:中国。学历:北京大学概率论及数理统计学学士、硕士,经济学双学位。相关业务资格:基金从业资格、特许金融分析师(CFA)。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。2012年11月加入汇添富基金管理股份有限公司从事固定收益研究。2013年3月28日至2015年7月22日任汇添富可转换债券基金的基金经理。2013年12月10日至2015年1月15日任汇添富新收益债券基金的基金经理。 |
| 吴江宏 | 汇添富可转换债券基金的基金经理。 | 2015年7月17日 | - | 4年 | 国籍:中国。学历:厦门大学金融工程硕士。4年证券从业经验。2011年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015年7月17日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理。 |

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场等各投资市场、债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿立项权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为1次,是由于合规控制原因调整导致,经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度,债市顺利打破"三季度魔咒",继续演绎牛市行情。受益于股市暴跌、IPO暂停,以及货币政策持续放松,资金宽松程度较前两个季度明显改善,加上机构对债券需求强劲,债券收益率再下台阶,其中10年金融债至9月底已经突破3.7%,较二季末下行40BP。信用债交投活跃,收益率降幅与金融债基本一致,但是一年期债券相对弱势,收益率窄幅波动,收益率曲线平坦化显著,表现出"牛平"特征。

与上季末相比,本基金规模继续缩水,受制于规模较小的影响,组合收益率难以明显提高。今年债券市场信用风险事件频发,并伴随大面积的债券评级下调,因此本基金在债券配置上更为谨慎,组合持仓以AA-AA+等中高等级品种为主,提高了组合的流动性和安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为0.4844%,B级净值增长率为0.5477%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

8月份金球金融市场剧烈动荡,美联储也因此决定延缓加息时点,没有选择9月份加息。但是在全球步入经济衰退的寒流中,唯独美国基本面稳健复苏,劳动力继续改善,预计年内加息仍是大概率事件,美元中期走强,加上大宗商品疲软,对新兴市场的打击可谓雪上加霜,也使我国进出口贸易受到较大冲击;投资方面,固定投资继续下滑,基建投资难以独唱大梁,房地产行业去库存压力仍大,房地产销量较之前两个季度已经开始回落,一线市场土地出让持续低迷,新开工难有显著回升,预计年内房地产投资对经济增长的贡献较小,四季度经济环比负增长可能性较大,货币政策的放松有必要保持连贯性。预计四季度债市仍有下行的空间,考虑到整体收益率已经处于低位,债市波动性大的特征仍会贯穿始终。此外,经济下行过程中,企业违约风险会显著增大,08二重债的实质性违约也给我们敲响了警钟。

由于本基金规模持续保持在1个亿以下,组合流动性管理难度有所增强,我们将持续跟踪每一个运作周期的特点,分析本基金的份额变动规律,提前做好债券与存款之间的配置计划,合理搭配回购、同业存款、短融、金融债等品种,力争在注重流动性的同时提高组合收益,同时会针对债券市场风险频发的现状,做好债券资质的筛查,避免出现所投债券评级下调、到期无法兑现的情况。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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 | 固定收益投资 | 20,004,440.50 | 38.45 |
| | 其中:债券 | 20,004,440.50 | 38.45 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 31,640,053.59 | 60.82 |
| 4 | 其他资产 | 380,663.19 | 0.73 |
| 5 | 合计 | 52,025,157.28 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 4.09 |
| | 其中:买断式回购融资 | 0.00 |
| 序号 | 项目 | 金额 / 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 1,999,877.00 / 4.04 |
| | 其中:买断式回购融资 | - / - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:"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40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 90 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 95 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 23 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过134天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 47.75 | 4.04 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 10.15 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 16.16 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 10.07 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 20.19 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 104.32 | 4.04 |

5.4 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 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,096,000.00 | 9.36 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,096,000.00 | 9.36 |
| 4 | 企业债券 | 65,864,828.90 | 30.66 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 88,949,934.36 | 41.41 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 33,871,492.00 | 15.77 |
| 10 | 合计 | 208,782,255.26 | 97.20 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 | 126018 | 08江铜债 | 669,290 | 65,864,828.90 | 30.66 |
| 2 | 128009 | 歌尔转债 | 335,422 | 43,363,356.16 | 20.19 |
| 3 | 113008 | 电气转债 | 280,000 | 36,722,000.00 | 17.10 |
| 4 | 132001 | 14宝钢EB | 250,760 | 30,517,492.00 | 14.21 |
| 5 | 130342 | 13进出42 | 200,000 | 20,096,000.00 | 9.36 |

5.6 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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、处罚的情况。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序