

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  
报告送达日期:2014年10月24日  
1.1 重要提示  
基金管理人的董事会及监事保证本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本基金的内容的真实性、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2014年10月22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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金销售机构在销售基金和办理基金份额申购、赎回等业务时,不以任何方式影响基金管理人对基金的投资决策,并不得损害基金持有人的利益。  
基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

5.2 基金产品概况

基金简称 汇添富可转换债券型证券投资基金  
交易代码 470658  
基金运作方式 约定开放式  
基金合同生效日 2011年6月17日  
报告期末基金份额总额 208,648,514.18份

投资目标 本基金主要投资于可转换债券(含分离交易可转债),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。

本基金在90%以上的基金资产投资于可转换债券(含分离交易可转债),并在严格控制风险的基础上,通过对宏观经济形势、中观经济发展(包括宏观经济运行周期、财政政策、货币政策、资金供求情况)、证券市场估值水平的研究,适度对权益类资产配置,适度把股票仓位集中于具有高流动性的品种,获取风险收益水平高于货币市场基金,低于股票基金及债券基金。

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 470658  
470659  
报告期末下属分级基金的份额总额 94,412,687.12份  
114,235,827.06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(2014年7月1日 - 2014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 6,113,512.25  
6,199,972.67

2.本期利润 9,678,292.18  
9,710,198.43

3.加权平均基金份额本期利润 0.1148  
0.1078

4.期末基金资产净值 112,790,020.00  
134,666,004.74

5.期末基金份额净值 1.195  
1.179

注:1.本期利润为收入减去必要的费用后的余额,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.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后即为实际收益水平。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 15.68% 0.76% 5.13% 0.45% 10.55% 0.31%

3.2.2 本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  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 15.59% 0.76% 5.13% 0.45% 10.46% 0.31%

3.2.3 本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  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

注:1.本基金已实现收益指收入(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.本基金业绩标准指持有人认购或交易基金的各费用,计入费用后即为实际收益水平。

3.2.4 本基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各费用,计入费用后即为实际收益水平。

3.2.5 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.6 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.7 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.8 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.9 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.10 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.11 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.12 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.13 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.14 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.15 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.16 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.17 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.18 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.19 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.20 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.21 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.22 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.23 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.24 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.25 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.26 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.27 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.28 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.29 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券C

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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.26% 0.79% 8.37% 0.54% -3.11% 0.25%

3.2.30 本基金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变动的比较  
汇添富可转换债券A