

汇添富可转换债券债券型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监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约定，于2015年7月15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数据，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务数据未经审计。

报告期末(2015年4月1日起至6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 471058

基金运作方式 约定定期开放式

报告期起始日 2011年7月1日

报告期结束日 2013年6月30日

报告期末基金份额总额 223,495,374.27份

报告期末基金份额净值 1.23495元/份

报告期末基金资产净值 273,495,374.27元

报告期末基金份额净值增长率 20.0%+/-

报告期末基金份额净值增长率标准差 3.0%

报告期末基金资产配置情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 65,251,432.61 9.96

其中:股票 65,251,432.61 9.96

2 固定收益投资 522,429,425.16 79.71

其中:债券 522,429,425.16 79.71

3 货币市场工具 - -

4 其他 - -

5 投资组合报告

6 报告期末基金持有人数或基金资产净值暂无数据

7 报告期内基金利润分配情况

8 合计 655,384,964.88 100.00

9 报告期末行业分类的基金资产配置

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 制造业 5,830,968.80 1.41

C 建筑业 28,990,307.81 7.28

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 钢铁业 12,529,722.24 3.15

F 犬类和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 食品和饮料业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 14,926,433.76 3.75

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 3,168,000.00 0.80

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 文化、体育和娱乐业 - -

R 中国金融服务 - -

S 综合 - -

9.1 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组合

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 600085 信达地产 483,671 17,368,625.61 4.36

2 601929 吉电股份 987,198 14,926,433.76 3.75

3 600820 通葡股份 932,271 12,529,722.24 3.15

4 601989 中国重工 568,776 8,417,884.80 2.11

5 600993 洛阳钼业 455,580 5,630,968.80 1.41

6 600138 中青旅 150,000 3,168,000.00 0.80

7 002408 齐翔特业 130,910 2,243,797.40 0.56

8 002215 诺普信 56,000 966,000.00 0.24

9 合计 522,429,425.16 131.17

9.2 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 14国债01 14国债01 790,100 146,113,030.00 36.69

2 113008 电广转债 580,700 106,759,200.00 26.80

3 126019 09中行债 645,410 64,624,826.20 16.18

4 126009 09国开债 345,422 54,846,105.16 13.77

5 128007 16国开01 488,670 80,070,476.90 21.07

9.3 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权证投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 汇添富可转换债券A 166,699,670.70 186,679,873.66

2 汇添富可转换债券B 186,679,061.21 250,870,473.85

3 减持股期间基金总份额的变动比例 248,773,877.21 314,626,847.49

4 汇添富可基金折分变动的份额(份额减少以“-”填列) - -

5 合计 100,571,874.70 122,923,500.02

9.4 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)

报告期利润 47,005.9

报告期利润总额 47,005.9

报告期净利润 47,005.9

报告期基金份额总额 223,495,374.27份

报告期基金份额净值 1.23495元/份

报告期基金份额净值增长率 20.0%+/-

报告期基金份额净值增长率标准差 3.0%

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

1. 本期已实现收益 6,079,579.64 1.29% 0.0226

2. 本期利润 6,079,579.64 1.29% 0.0226

3. 本期利润总额 6,079,579.64 1.29% 0.0226

4. 本期基金份额净值 1.23495 1.29% 0.0226

5. 期末基金份额净值 1.23495 1.29% 0.0226

6. 期末可供分配基金份额利润 6,079,579.64 1.29% 0.0226

7. 期末可供分配利润 6,079,579.64 1.29% 0.0226

8. 期末可供分配基金份额总额 223,495,374.27份

9. 期末可供分配基金份额净值 1.23495元/份

10. 期末可供分配利润总额 6,079,579.64元

11. 期末可供分配基金份额净额 6,079,579.64元

12. 期末可供分配基金份额比例 2.71%

13. 期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%) 2.71%

14. 期末可供分配利润占期末基金净资产的比例(%) 2.71%

15. 期末可供分配利润占期末可供分配基金份额总额的比例(%) 2.71%

16. 期末可供分配基金份额比例 0.0226

17. 期末可供分配利润与期末基金资产净值的比率(%) 2.71%

18. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

19. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

20. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

21. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

22. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

23. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

24. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

25. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

26. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

27. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

28. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

29. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

30. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

31. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

32. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

33. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

34. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

35. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

36. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

37. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

38. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

39. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

40. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

41. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

42. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

43. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

44. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额总额的比率(%) 2.71%

45. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

46. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

47. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

48. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

49. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

50. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

51. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

52. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

53. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

54. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

55. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

56. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

57. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

58. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

59. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

60. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%

61. 期末可供分配利润与期末可供分配基金份额净值的比率(%) 2.71%