

汇添富增强收益债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 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：2016 年 10 月 25 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 2016 年 10 月 21 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富增强收益债券	
交易代码	519078	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 3 月 6 日	
报告期末基金份额总额	1, 293, 053, 780. 81 份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种，力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。	
投资策略	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、不同类别债券利差水平研究，判断不同类别债券类属的相对投资价值，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	中债总指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。	
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	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
下属分级基金的交易代码	519078	470078
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 199, 738, 903. 19 份	93, 314, 877. 62 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（2016年7月1日—2016年9月30日）	
	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
1. 本期已实现收益	17,961,342.84	1,144,311.55
2. 本期利润	38,893,950.36	2,555,011.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0309	0.0284
4. 期末基金资产净值	1,501,999,141.30	114,264,498.21
5. 期末基金份额净值	1.252	1.225

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

汇添富增强收益债券 A

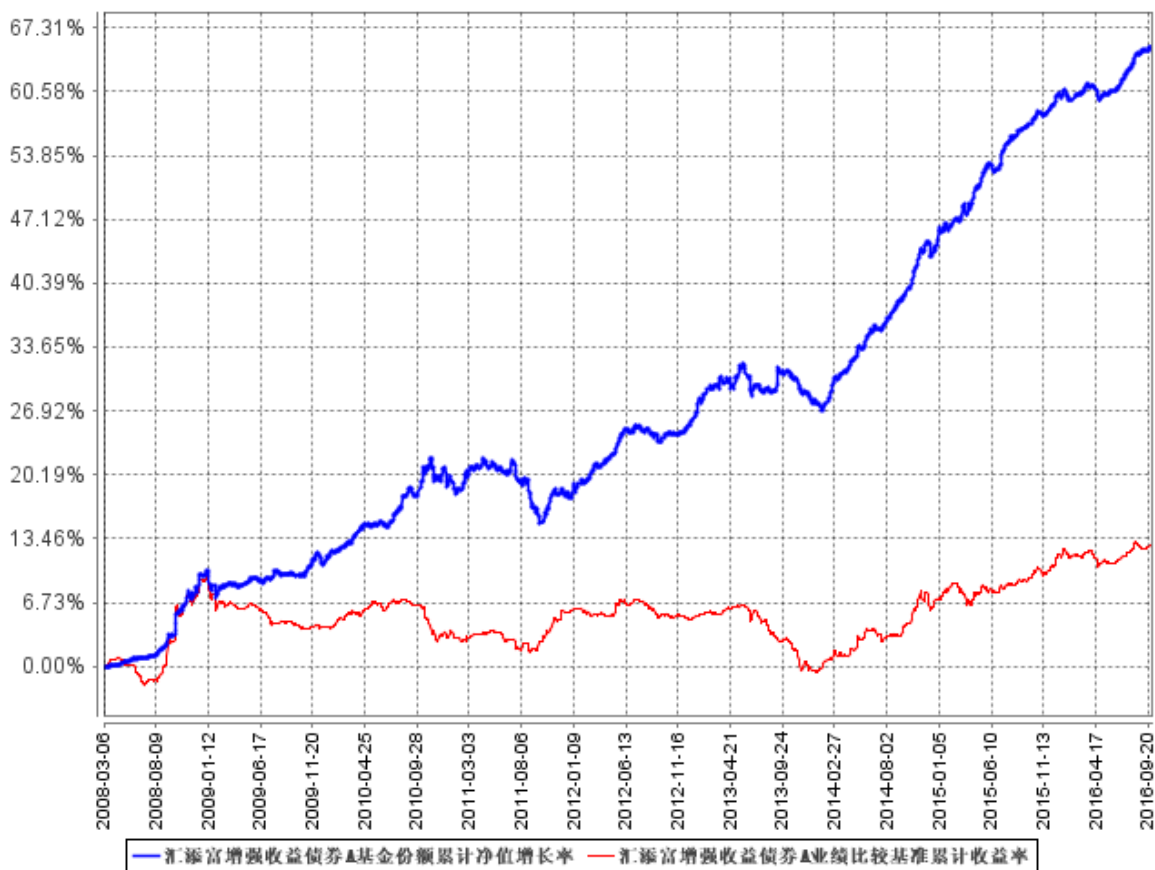
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.54%	0.06%	1.23%	0.06%	1.31%	0.00%

汇添富增强收益债券 C

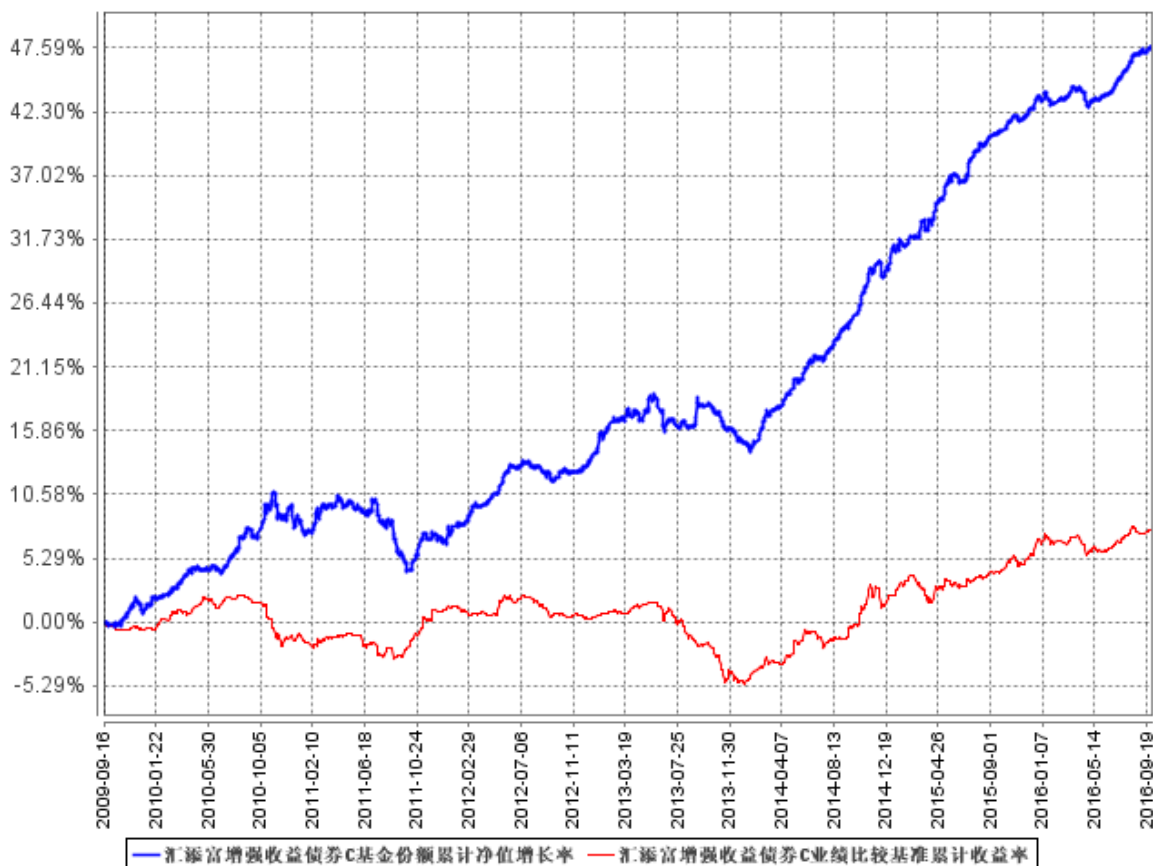
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.51%	0.06%	1.23%	0.06%	1.28%	0.00%

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

汇添富增强收益债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富增强收益债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2008年3月6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。

2、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式，该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

§ 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		
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基	2008年3月6日	-	14年	国籍：中国。学历：华东师范大学金融学博士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任总经理助理、固定

	<p>金、汇添富互利分级债券基金、汇添富收益快线货币基金的基金经理, 固定收益投资总监。</p>			<p>收益投资总监。2008 年 3 月 6 日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理, 2009 年 1 月 21 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富货币基金的基金经理, 2011 年 1 月 26 日至 2013 年 2 月 7 日任汇添富保本混合基金的基金经理, 2012 年 7 月 26 日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理, 2013 年 11 月 6 日至今任汇添富互利分级债券基金的基金经理, 2013 年 12 月 13 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富全额宝货币基金的基金经理, 2014 年 1 月 21 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富收益快线货币基金的基金经理, 2014 年 12 月 23 日至今任汇添富收益快线货币基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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，并贯穿分工授权、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。

4.3.2 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，由于组合投资策略导致。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运作分析

三季度宏观经济基本面依然维持底部徘徊，工业增加值、投资、进口等指标保持弱势，显示内需增长回升乏力。三季度工业品价格指数受供给侧改革和海外大宗商品价格影响出现反弹，但消费价格指数涨幅持续低位，尤其是核心 CPI 持续低位徘徊甚至继续下行。为应对经济、通胀低迷，三季度货币政策尽管因重启 14 天、28 天逆回购以及季末月份资金偏紧影响，市场一度担心货币政策发生转向，但三季度货币政策整体持续保持宽松，稳中趋松的基调依然较为明确。三季度债券市场收益率在基本面、前期估值反弹和银行理财配置压力等综合因素影响下出现明显下行，利率债普遍下行 10-20BP，超长期利率债下行幅度更是超过 40BP，而信用债也普遍下行 30-80BP，低评级下行幅度更大。

三季度债券市场整体走强，组合配置上整体明显加快了债券结构置换，并择机加了转债配置比例，但总体而言，组合杠杆和久期较二季度无明显变化。

4.5 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 2.54%，C 级净值增长率为 2.51%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,680,044,952.09	98.15
	其中：债券	1,680,044,952.09	98.15
	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	1,597,262.76	0.09
8	其他资产	30,055,676.12	1.76
9	合计	1,711,697,890.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未有沪港通股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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	252,755,000.00	15.64
	其中：政策性金融债	252,755,000.00	15.64
4	企业债券	954,495,878.92	59.06
5	企业短期融资券	230,485,000.00	14.26
6	中期票据	51,730,000.00	3.20
7	可转债（可交换债）	190,579,073.17	11.79

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,680,044,952.09	103.95

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	160210	16 国开 10	1,000,000	100,390,000.00	6.21
2	011699897	16 中电投 SCP007	1,000,000	100,200,000.00	6.20
3	160414	16 农发 14	1,000,000	100,170,000.00	6.20
4	150218	15 国开 18	500,000	52,195,000.00	3.23
5	011616003	16 华电股 SCP003	400,000	40,092,000.00	2.48

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：报告期末本基金无国债期货持仓。

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、处罚的情形。

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

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	47,373.18
2	应收证券清算款	276,144.00
3	应收股利	-
4	应收利息	28,909,384.11
5	应收申购款	822,774.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,055,676.12

5.10.4 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	113008	电气转债	20,912,082.50	1.29
2	110033	国贸转债	20,489,455.20	1.27
3	113009	广汽转债	19,262,188.80	1.19
4	110031	航信转债	14,550,991.00	0.90
5	110035	白云转债	12,297,924.00	0.76
6	110032	三一转债	11,574,336.00	0.72
7	128009	歌尔转债	4,922,854.00	0.30
8	110034	九州转债	3,942,900.00	0.24
9	123001	蓝标转债	724,046.00	0.04

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富增强收益债券 A	汇添富增强收益债券 C
报告期期初基金份额总额	1,193,759,633.81	85,460,508.50
报告期期间基金总申购份额	295,202,434.04	29,086,762.87
减：报告期期间基金总赎回份额	289,223,164.66	21,232,393.75
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	1,199,738,903.19	93,314,877.62

注：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

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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、基金管理人业务资格批件、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、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
2016 年 10 月 25 日