

汇添富增强收益债券型证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2020年6月16日更新)

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

重要提示

汇添富增强收益债券型证券投资基金（基金简称：汇添富增强收益债券；A类份额基金代码：519078；C类份额基金代码：470078；以下简称“本基金”）经2007年12月28日中国证券监督管理委员会证监基金字【2007】[346]号文核准募集。本基金的基金合同于2008年3月6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）基金份额时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（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导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，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。本基金对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；对股票（由新股申购所得，不在二级市场买入）等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不对投资者保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过50%的除外。

本次招募说明书主要涉及基金经理信息的更新，更新所载内容截止日为2020年6月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日。

一、基金管理人

（一）基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室

办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼20楼

法定代表人：李文

成立时间：2005年2月3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[2005]5号

注册资本：人民币132,724,224元

联系人：李鹏

联系电话：021-28932888

股东名称及其出资比例：

| 股东名称 | 股权比例 |
|---------------------|---------|
| 东方证券股份有限公司 | 35.412% |
| 上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙） | 24.656% |
| 上海上报资产管理有限公司 | 19.966% |
| 东航金控有限责任公司 | 19.966% |
| 合计 | 100% |

（二）主要人员情况

1、董事会成员

李文先生，2015年4月16日担任董事长。国籍：中国，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长，汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副局长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生，2016年11月20日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生，2018年3月21日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限责任公司副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金控有限责任公司党

委书记、副总经理。

张晖先生，2015年4月16日担任董事，总经理。国籍：中国，上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生，2015年4月16日担任独立董事。国籍：中国香港，厦门大学经济学博士，加拿大 Saskatchewan 大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计，五大国际会计师事务所 Touche Ross International(现为德勤) 加拿大多伦多分所审计员，厦门大学会计师事务所副主任会计师，厦门大学经济学院讲师、副教授，伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者，美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者，加拿大 Lethbridge 大学管理学院会计学讲师、副教授 (tenured)，香港大学商学院访问教授，香港浸会大学商学院会计与法律系教授，博导，系主任。

杨燕青女士，2011年12月19日担任独立董事，国籍：中国，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，第一财经研究院院长，国家金融与发展实验室特邀高级研究员，上海政协委员，《第一财经日报》创始编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人，《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进 (Shangjin Wei) 先生，2020年1月9日担任独立董事，国籍：美国，加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授，世界银行顾问，国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

2、监事会成员

任瑞良先生，2004年10月20日担任监事，2015年6月30日担任监事会主席。国籍：中国，大学学历，会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。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文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理

等。

王如富先生，2015年9月8日担任监事。国籍：中国，硕士研究生，注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员，金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生，2015年6月30日担任监事，国籍：中国，国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司，东航集团财务有限责任公司。

王静女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013年8月8日担任职工监事，国籍：中国，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015年6月25日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012年3月7日担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013年1月7日担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上

海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015年8月5日担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017年3月3日担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建总行北京开发中心负责人，建总行信息技术管理部副总经理，建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建总行信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生，2015年6月25日担任督察长。国籍：中国，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

（1）现任基金经理

徐光先生，国籍：中国。学历：美国伊利诺伊理工学院金融学硕士。8年证券从业经验。2012年12月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任债券交易员、高级债券交易员。2018年8月21日至今任汇添富季季红定期开放债券的基金经理，2018年8月21日至2020年3月23日任添富鑫泽定开债的基金经理，2018年9月28日至今任汇添富高息债债券、汇添富年年利定期开放债券、添富鑫成定开债的基金经理，2018年12月24日至2020年3月23日任添富丰润中短债的基金经理，2019年2月22日至2020年6月3日任添富AAA级信用纯债的基金经理，2019年3月15日至今任汇添富增强收益债券的基金经理，2020年3月30日至今任汇添富鑫福债的基金经理，2020年4月9日至今任汇添富中短债的基金经理。

（2）历任基金经理

王珏池先生，2008年3月6日至2011年6月21日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。

陆文磊先生，2008年3月6日至2020年6月12日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会

主席：袁建军（副总经理）

成员：韩贤旺（首席经济学家）、王栩（总经理助理，权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究总监）

6、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1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2019年9月，中国工商银行资产托管部共有员工208人，平均年龄33岁，95%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、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 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 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；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）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932893

传真：（021）50199035 或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

网址：www.99fund.com

邮箱：guitai@htffund.com

（2）汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）

2、代销机构

本基金的代销机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并在基金管理人网站公示。

（二）基金注册登记机构

1、汇添富增强收益债券型证券投资基金A类的注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：010-58598835

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

2、汇添富增强收益债券型证券投资基金 C 类的注册登记机构

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：021-28932888

传真：021-28932876

联系人：韩从慧

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：秦悦民、傅轶

联系人：陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

邮政编码：100738

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

业务联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、许培菁

四、基金的名称

本基金名称：汇添富增强收益债券型证券投资基金

基金简称：汇添富增强收益债券

A类份额基金代码：519078

C类份额基金代码：470078

五、基金的类型

本基金是契约型、开放式、债券型证券投资基金。

六、基金的投资目标

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。

七、基金投资方向

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券、资产支持证券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等，以及参与新股申购等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品

种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的 80%，，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，股票（由新股申购所得，不在二级市场买入）等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1、类属配置

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。

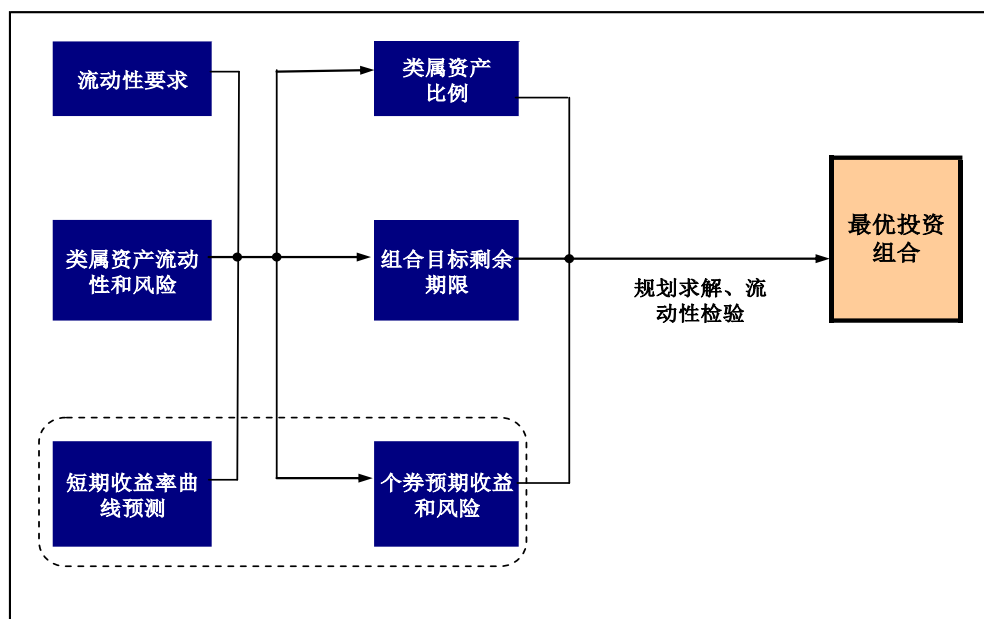
2、组合构建

（1）货币市场工具

货币市场工具是指到期期限在 1 年以内（包括 1 年）的短期固定收益工具，主要包括回购、到期期限在 1 年以内的短期国债和金融债、央行票价、短期融资券等等。货币市场工具的功能是进行基金的流动性管理，同时，当中长期债券收益率面临上升风险的情况下，货币市场工具可以起到较好的避险作用。

本基金对货币市场工具的投资策略是：在确定基金总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、信用水平来确定货币市场工具组合资产配置，并定期对货币市场工具组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整，其流程见下图。

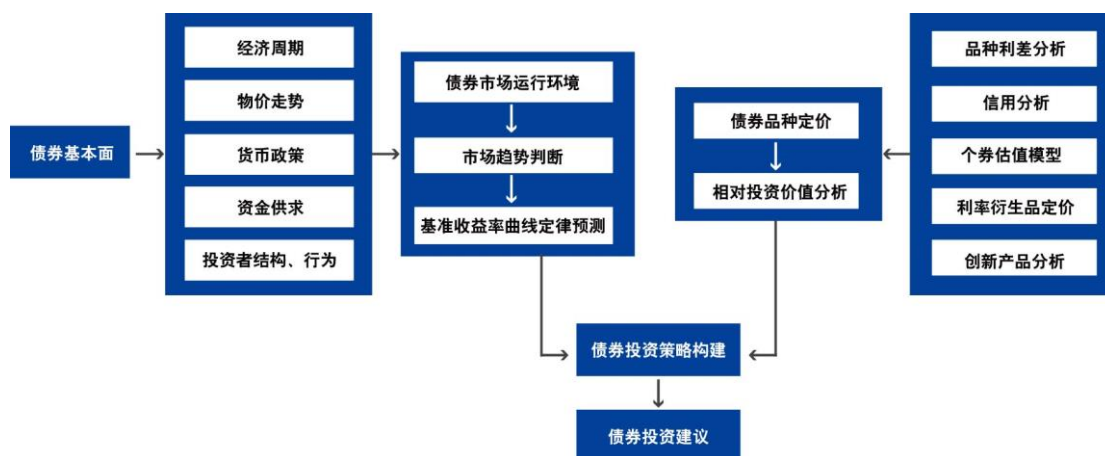
货币市场工具的投资组合构建流程



(2) 债券投资（不含可转债）组合构建

中国债券市场的波动主要受宏观经济运行趋势、通胀压力、资金供求等因素影响，而货币政策与宏观经济运行趋势之间存在紧密联系，以上因素共同构成债券市收益率的驱动机制。据此，本基金建立了自上而下和自下而上两方面的研究流程，自上而下的研究包含宏观基本面分析、资金技术面分析，自下而上的研究包含信用分析、个券分析、创新金融工具和交易策略分析，由此形成宏观和微观层面相配套的研究决策体系，最后形成具体的投资策略。本基金的债券研究投资流程见下图。

债券研究和投资流程



本基金推行定量和定性研究相结合的研究方法体系，对于有数据保证、能够进行模型分析的因素，本基金力求进行定量研究，以加强对数据的把握能力，目

前本基金使用的定量工具和技术主要有：

- 宏观经济指标预测模型，涵盖主要关键经济指标的预测（如 GDP、CPI、固定资产投资、工业增加值、存款、贷款、货币供应量等）；
- 利率期限结构模型
- 组合构建模型
- 信用风险评估体系
- VaR 风险控制技术
- 债券绩效评估体系

对于难以完全量化的影响因素，本基金利用定性研究方法，以便对市场运行趋势进行合理性的推断。

根据本基金的投资理念和对中国债券市场运行方式的理解，本基金建立了债券市场基本要素驱动模型（Fundamental Factors Driving Model, FFD Model），以此作为积极交易策略的基础。

FFD 模型按照以下步骤构建：

第一，选择最能反映债券市场基本驱动因素的指标，建立其与债券收益率的历史关系。

第二，根据久期控制和时机选择的交易策略原则，建立债券组合调整的原则，确定一定期限内组合的目标久期。

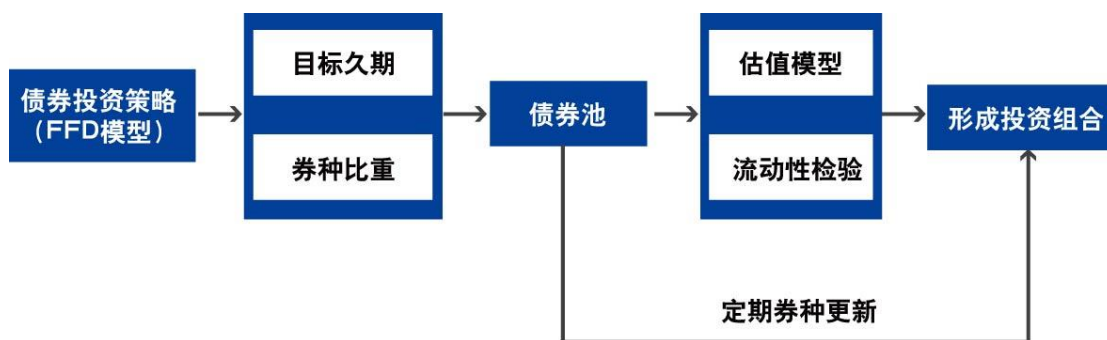
第三，滚动配置策略：定期对组合进行滚动配置，以维持组合中债券资产（不包括央票、短期融资券和活期存款等期限在 1 年以下的资产）必要的久期。

第四，收益率曲线策略和利差策略：在确定债券组合的期限结构后，本基金将主要运用积极的收益率曲线策略和利差策略。通过对不同类别债券的收益率差进行分析，预测其变动趋势，及时发现由于利差变动出现的价值被低估的债券品种，并结合税收差异和信用风险溢价等因素进行分析，综合评判个券的投资价值，以挑选风险收益特征最匹配的券种，建立具体的个券组合。另外，本基金将采用换券利差交易策略、凸性套利交易策略以及骑乘收益率曲线策略等交易策略。

第五，套利策略：当回购利率运行较为平稳的时期，将进行适当的回购融资套利，回购融资套利交易的债券品种主要以流动性好的券种为主。回购融资的比例将严格遵守相关法规和风险管理制度。另外，在本基金债券投资过程中，基金

管理人还将采用一级市场参与策略以及其他法规允许的无风险套利策略等。

债券投资组合构建流程



(3) 可转债投资

对于本基金中可转债的投资，本基金管理人主要采用可转债相对价值分析策略。

由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。

其次，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，最终确定投资的品种。

(4) 新股申购

本基金将研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，最终制定相应的新股申购策略。本基金通过参与新股认购所获得的股票，将根据其上市后的二级市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出，但最长持有期限不超过半年。

(二) 投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

- (2) 国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响；
- (3) 企业信用评级；
- (4) 国家货币政策及债券市场政策；
- (5) 商业银行的信贷扩张。

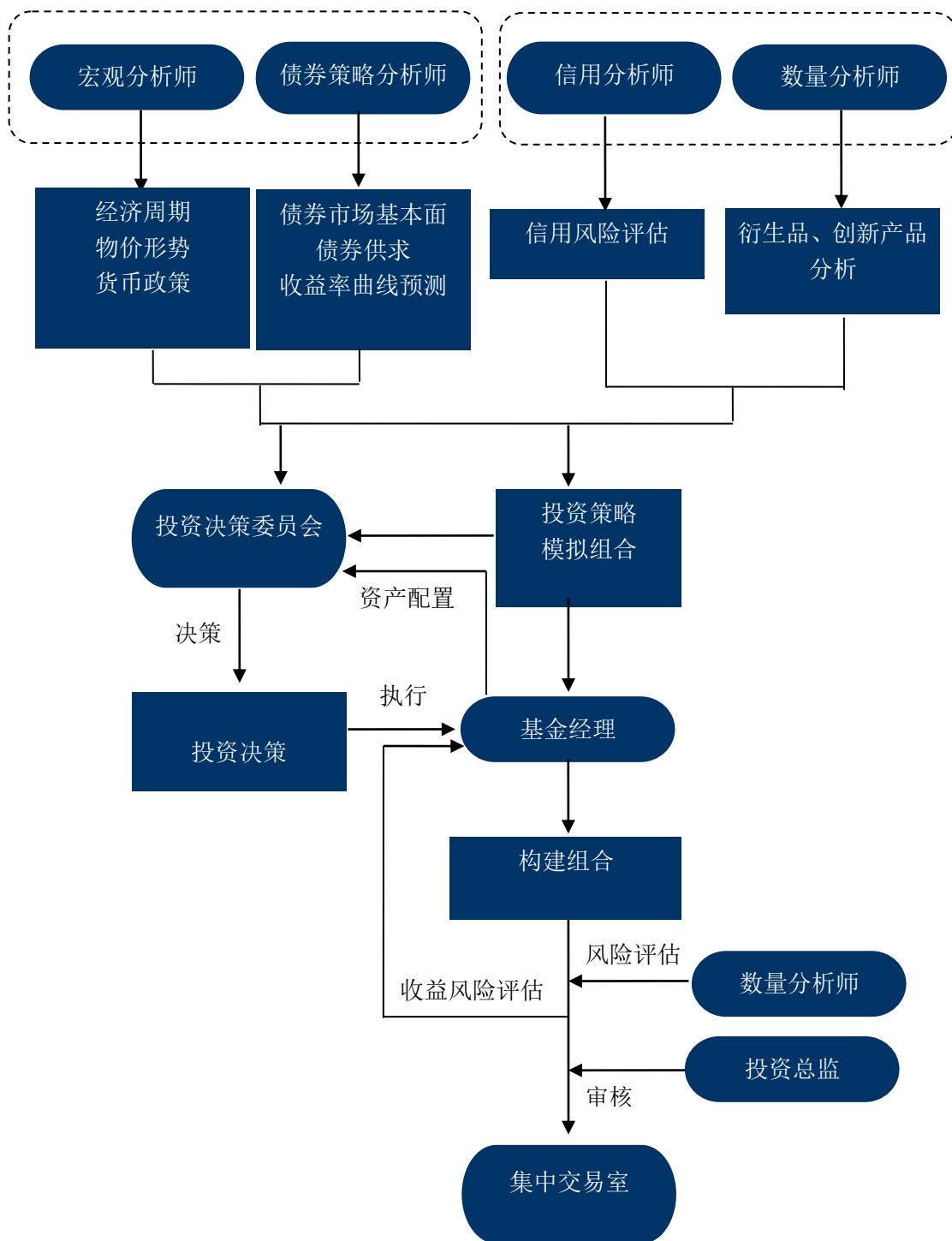
2、投资决策机制

本基金实行投资决策团队制，强调团队合作，充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合，设立了投资研究部，策略分析师、固定收益分析师、金融工程小组和基金经理立足本职工作，充分发挥主观能动性，渗透到投资研究的关键环节，群策群力，为基金份额持有人谋取中长期稳定的较高投资回报。

3、投资决策程序

本基金具体的投资决策机制与流程为：

- (1) 固定收益分析师根据宏观经济形势、央行货币投放、商业银行信贷扩张以及国际资本的流动等判断市场利率的走向提交策略报告并进行讨论。
- (2) 基金经理在策略报告的基础之上提出资产配置的建议。
- (3) 投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议，并确定资产配置比例的范围。
- (4) 固定收益分析师对债券品种的收益率、信用风险和流动性风险进行评估，并向基金经理推荐。
- (5) 基金经理在考虑资产配置的情况下，挑选合适的债券品种，灵活采取各种策略，构建投资组合。
- (6) 集中交易室执行交易指令。
- (7) 金融工程小组进行全程风险评估和绩效分析。



九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债总指数。

选择中债总指数作为本基金比较基准的依据的主要理由是：第一，该指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网（www.chinabond.com.cn）公开发

布，具有较强的权威性和市场影响力；第二，该指数的样本券涵盖面广，能较好地反映债券市场的整体收益。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、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业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，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，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。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

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2020年03月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自2019年01月01日起至12月31日止。

§ 1 投资组合报告

1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 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 | 474,270,819.80 | 80.11 |
| | 其中：债券 | 474,270,819.80 | 80.11 |
| | 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 | 7,204,907.37 | 1.22 |
| 8 | 其他各项资产 | 110,531,448.79 | 18.67 |
| 9 | 合计 | 592,007,175.96 | 100.00 |

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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。

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未有港股通股票投资。

1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末投资股票。

1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末投资股票。

1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未有股票投资。

1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 27,330,386.00 | 5.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 39,323,133.80 | 7.81 |
| | 其中：政策性金融债 | 39,323,133.80 | 7.81 |
| 4 | 企业债券 | 355,514,300.00 | 70.59 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 52,103,000.00 | 10.35 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 474,270,819.80 | 94.17 |

1.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 143891 | 18 疏浚 01 | 300,000 | 30,609,000.00 | 6.08 |
| 2 | 101800193 | 18 吴江经开 MTN002 | 200,000 | 21,746,000.00 | 4.32 |
| 3 | 143500 | 18 公用 01 | 200,000 | 20,526,000.00 | 4.08 |
| 4 | 122402 | 15 城建 01 | 200,000 | 20,502,000.00 | 4.07 |
| 5 | 155054 | 18 国药 01 | 200,000 | 20,220,000.00 | 4.01 |

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

1.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.9 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。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

1.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 14,459.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,207,146.74 |
| 5 | 应收申购款 | 101,309,842.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 110,531,448.79 |

1.11.4 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处于转股期的可转换债券。

1.11.5 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。

十二、基金的业绩

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) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

A 类基金份额

| 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) |
|--|--------------|-----------------|------------------|-------------------------|---------|---------|
| 2008年3月6日(基 金合同生效日)至 2008年12月31日 | 9.55% | 0.14% | 9.03% | 0.23% | 0.52% | -0.09% |
| 2009年1月1日至 2009年12月31日 | 1.83% | 0.12% | -4.44% | 0.11% | 6.27% | 0.01% |

| | | | | | | |
|--|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2010年1月1日至 2010年12月31日 | 7.14% | 0.19% | -0.87% | 0.10% | 8.01% | 0.09% |
| 2011年1月1日至 2011年12月31日 | -1.33% | 0.20% | 2.52% | 0.11% | -3.85% | 0.09% |
| 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 7.00% | 0.12% | -0.67% | 0.07% | 7.67% | 0.05% |
| 2013年1月1日至 2013年12月31日 | 1.34% | 0.17% | -5.28% | 0.11% | 6.62% | 0.06% |
| 2014年1月1日至 2014年12月31日 | 13.33% | 0.12% | 7.48% | 0.15% | 5.85% | -0.03% |
| 2015年1月1日至 2015年12月31日 | 10.60% | 0.12% | 4.51% | 0.12% | 6.09% | 0.00% |
| 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 1.40% | 0.10% | -1.80% | 0.13% | 3.20% | -0.03% |
| 2017年1月1日至 2017年12月31日 | 1.14% | 0.11% | -4.26% | 0.09% | 5.40% | 0.02% |
| 2018年1月1日至 2018年12月31日 | 3.86% | 0.14% | 6.17% | 0.11% | -2.31% | 0.03% |
| 2019年1月1日至 2019年12月31日 | 4.66% | 0.07% | 1.10% | 0.09% | 3.56% | -0.02% |
| 2008年3月6日(基金 合同生效日)至 2019年12月31日 | 78.71% | 0.14% | 12.91% | 0.12% | 65.80% | 0.02% |

C类基金份额

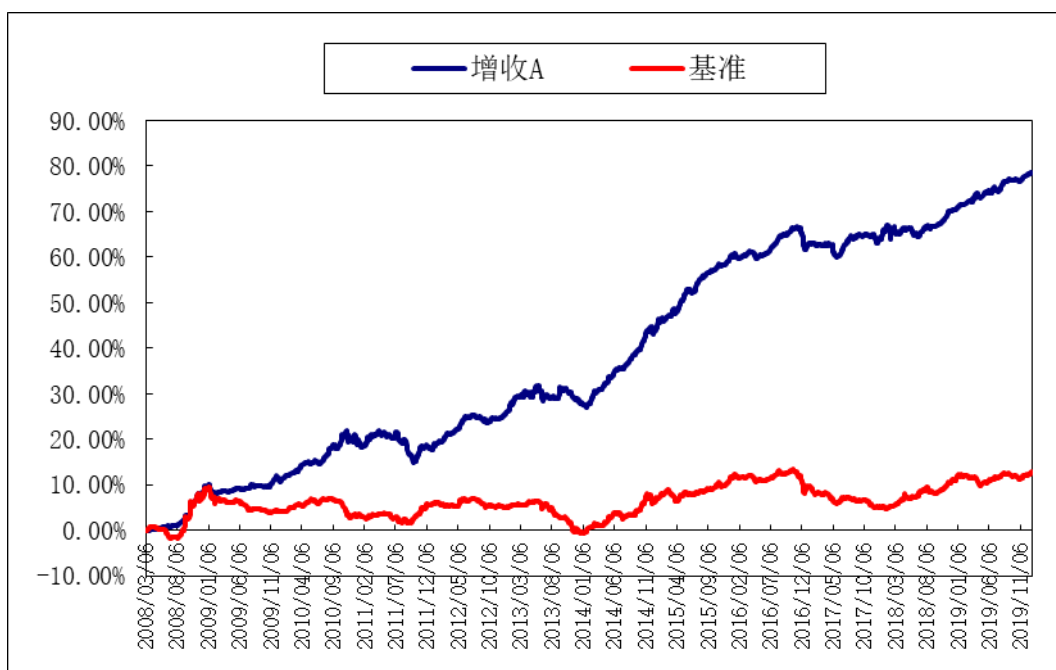
| 阶段 | 净值增长率 (1) | 净值增长率 标准差(2) | 业绩比较基准 收益率(3) | 业绩比较基准 收益率标准差 (4) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|---|--------------|-----------------|------------------|-------------------------|---------|---------|
| 2009年9月15日 (按收费模式不同,汇添富增强收 益债券增加C类收 费模式)至2009年 12月31日 | 1.53% | 0.13% | -0.52% | 0.04% | 2.05% | 0.09% |
| 2010年1月1日至 2010年12月31日 | 6.77% | 0.19% | -0.87% | 0.10% | 7.64% | 0.09% |
| 2011年1月1日至 2011年12月31日 | -1.52% | 0.20% | 2.52% | 0.11% | -4.04% | 0.09% |
| 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 6.75% | 0.12% | -0.67% | 0.07% | 7.42% | 0.05% |
| 2013年1月1日至 2013年12月31日 | 0.97% | 0.17% | -5.28% | 0.11% | 6.25% | 0.06% |
| 2014年1月1日至 2014年12月31日 | 13.12% | 0.12% | 7.48% | 0.15% | 5.64% | -0.03% |

| | | | | | | |
|--|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2015年1月1日至 2015年12月31日 | 10.33% | 0.12% | 4.51% | 0.12% | 5.82% | 0.00% |
| 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 1.01% | 0.10% | -1.80% | 0.13% | 2.81% | -0.03% |
| 2017年1月1日至 2017年12月31日 | 0.83% | 0.10% | -4.26% | 0.09% | 5.09% | 0.01% |
| 2018年1月1日至 2018年12月31日 | 3.45% | 0.14% | 6.17% | 0.11% | -2.72% | 0.03% |
| 2019年1月1日至 2019年12月31日 | 4.28% | 0.08% | 1.10% | 0.09% | 3.18% | -0.01% |
| 2009年9月15日 (按收费模式不同, 汇添富增强收 益债券增加C类收 费模式)至2019年 12月31日 | 57.76% | 0.14% | 7.81% | 0.11% | 49.95% | 0.03% |

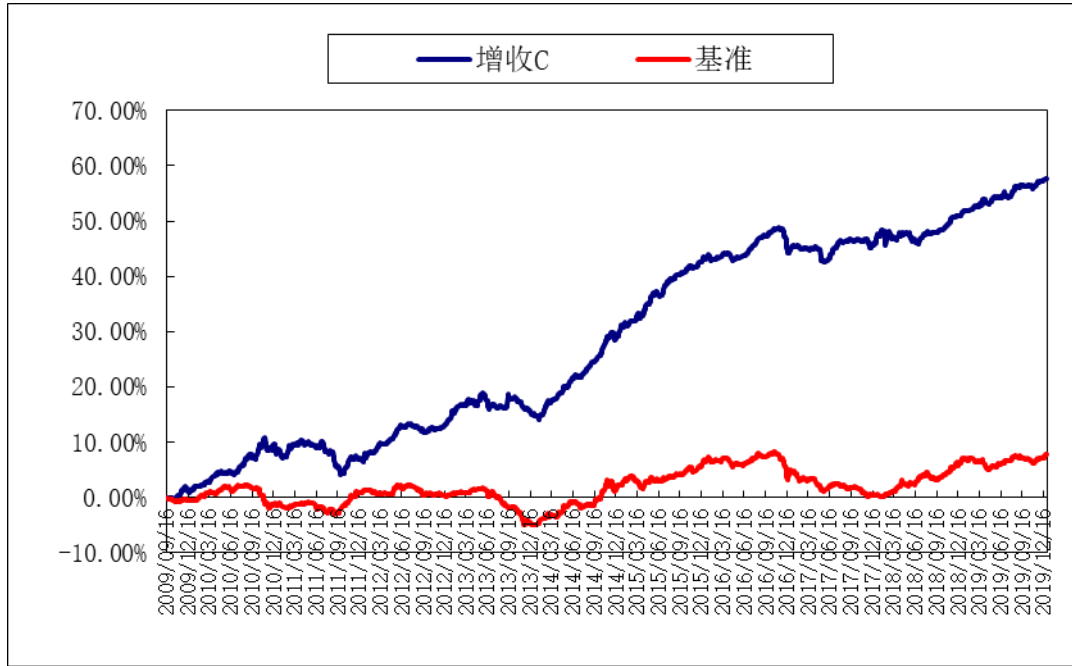
(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

基准收益率变动的比较图

A类基金份额



C类基金份额



十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 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
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 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、按照国家有关规定和《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。

(二) 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 0.6%年费率计提。管理费的计算

方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

汇添富增强收益债券基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额计提的销售服务费年费率最高不超过 0.4%，销售服务费具体费率参见《关于汇添富增强收益债券型证券投资基金增加 C 类收费模式并修改基金合同的公告》或更新后的招募说明书，基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整对 C 类各级基金份额计提的销售服务费率。销售服务费将专门用于汇添富增强收益债券基金 C 类基金份额的销售与 C 类基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中划出，分别支付给各基金销售机构。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 4—8 项费用，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。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率等相关费率。调低基金管理费率或基金托管费率，由基金管理人和基金托管人协商一致，经中国证监会核准后公告，此项调整不需要召开基金份额持有人大会。调高基金管理费率、基金托管费率等相关费率须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒介公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）针对“重要提示”章节：增加了本次招募说明书更新的主要事项和更新截止时间。

(二) 针对“基金管理人”章节：更新了基金管理人的相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2020年6月16日