

汇添富增强收益债券型证券投资基金 2023 年 第 3 季度报告

2023 年 09 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

送出日期：2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

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 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富增强收益债券
基金主代码	519078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 03 月 06 日
报告期末基金份额总额(份)	164,347,636.29
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	本基金的投资策略主要包括：类属配置、组合构建。其中，组合构建策略包括：货币市场工具、债券投资（不含可转债）组合构建、可转债投资、新股申购。
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(份)	71,460,863.35	92,886,772.94

§ 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(2023年07月01日 - 2023年09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	1,276,305.65	1,043,083.65
2. 本期利润	719,487.26	545,610.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0091	0.0079
4. 期末基金资产净值	90,735,396.03	112,267,390.34
5. 期末基金份额净值	1.2697	1.2086

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

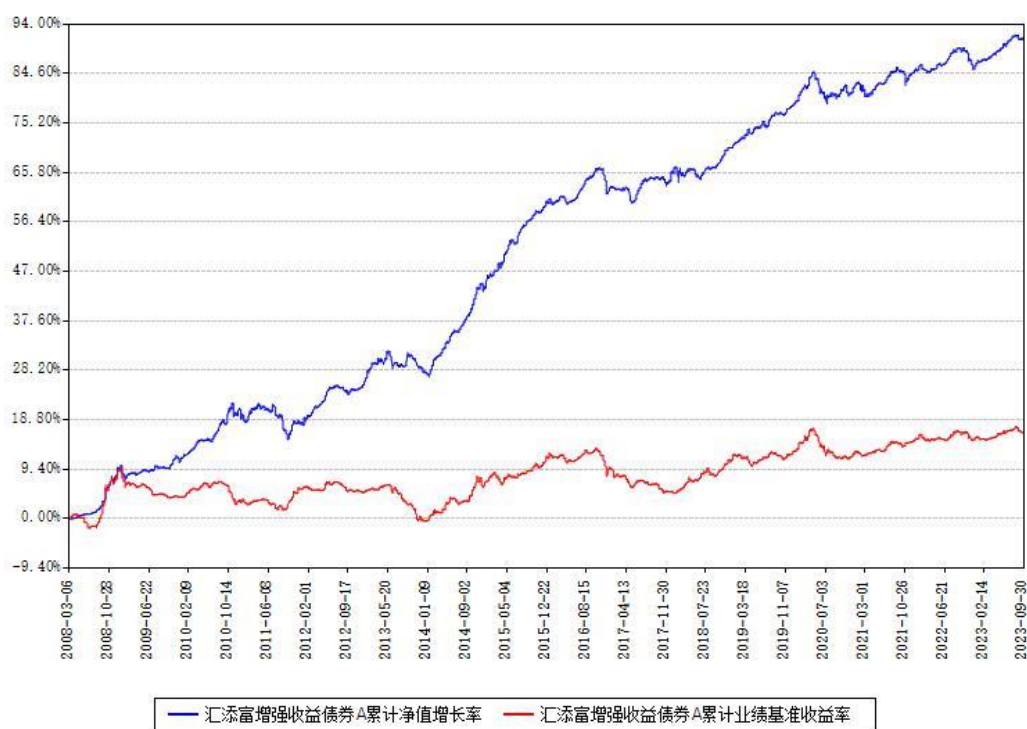
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富增强收益债券 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.67%	0.06%	-0.03%	0.07%	0.70%	-0.01%
过去六	1.93%	0.07%	0.99%	0.07%	0.94%	0.00%

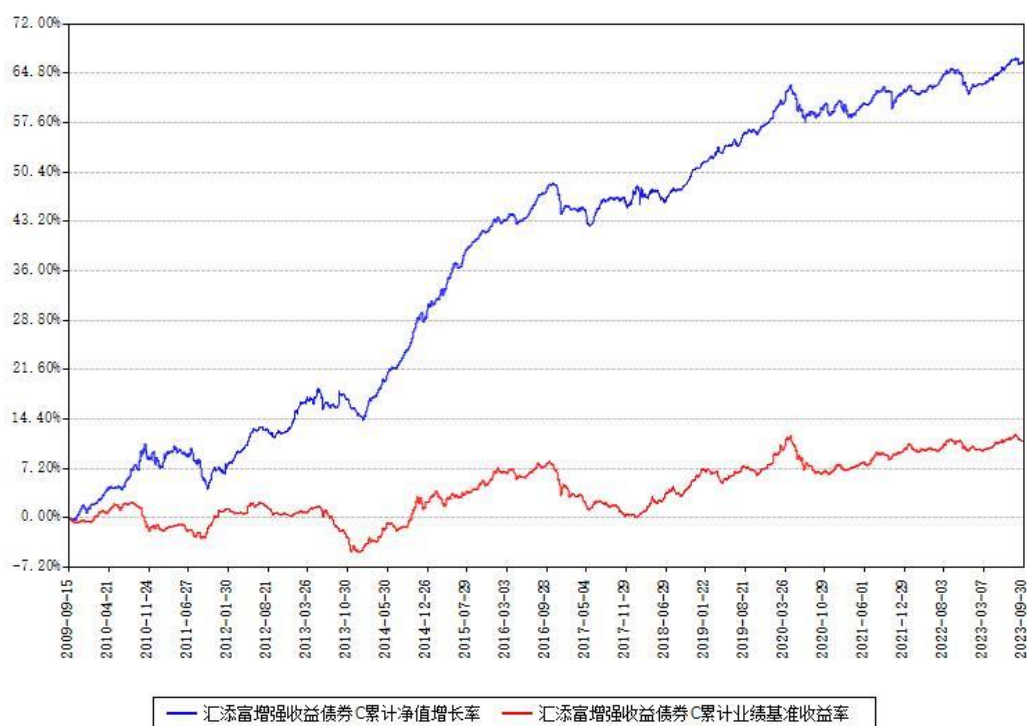
个月						
过去一年	1.45%	0.07%	0.45%	0.08%	1.00%	-0.01%
过去三年	5.90%	0.09%	4.40%	0.08%	1.50%	0.01%
过去五年	14.39%	0.09%	7.33%	0.10%	7.06%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	91.47%	0.13%	16.48%	0.12%	74.99%	0.01%
汇添富增强收益债券 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.57%	0.06%	-0.03%	0.07%	0.60%	-0.01%
过去六个月	1.73%	0.07%	0.99%	0.07%	0.74%	0.00%
过去一年	1.05%	0.07%	0.45%	0.08%	0.60%	-0.01%
过去三年	4.64%	0.10%	4.40%	0.08%	0.24%	0.02%
过去五年	12.25%	0.10%	7.33%	0.10%	4.92%	0.00%
自基金合同生效日起至今	66.51%	0.13%	11.26%	0.11%	55.25%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富增强收益债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2008年03月06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。

本基金于2009年09月15日新增C类份额，新增份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
徐光	本基金的 基金经理	2019 年 03 月 15 日	-	11	国籍：中 国。学历： 美国伊利诺 伊理工学院 金融学硕 士。从业资 格：证券投 资基金从业 资格。从业 经历：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 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2018 年 8 月 21 日至 2020 年 3 月 23 日 任汇添富鑫 泽定期开放 债券型发起 式证券投资 基金的基金 经理。2018 年 9 月 28 日 至今任汇添 富高息债 券型证券投 资基金的基

				<p>金经理。 2018 年 9 月 28 日至今任汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 2018 年 9 月 28 日至 2020 年 9 月 1 日任汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 24 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富丰润中短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月 22 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金的基金经理。 2019 年 3 月 15 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 30 日至 2022 年 1 月 7 日任汇添富鑫福债券型证券投资基金的基金经</p>
--	--	--	--	---

					理。2020 年 4 月 9 日至今任汇添富中短债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 8 日至今任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
甘信宇	本基金的基金经理	2023 年 06 月 14 日	-	7	国籍：中国。学历：南京大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格，法律职业资格。从业经历：2015 年 7 月至 2022 年 2 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益助理分析师、固定收益分析师、固定收益高级分析师，2022 年 3 月至今任汇添富基金管理股份有限公司基金经理助理。2022

				<p>年 3 月 1 日至 2022 年 9 月 15 日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 3 月 1 日至 2022 年 9 月 15 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 3 月 1 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 3 月 15 日至今任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富盛和 66</p>
--	--	--	--	--

				<p>个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2022 年 8 月 8 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 5 月 5 日至今任汇添富短债债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 6 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富鑫裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 9 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富鑫汇债券型证券投资基金的基金经理助理。2022</p>
--	--	--	--	--

					<p>年 10 月 17 日至今任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 17 日至今任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 4 日至今任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 4 日至今任汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 14 日至今任汇添富</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>增强收益债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 8 月 23 日至今任汇添富鑫裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</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“离任日期”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相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3

日内、5 日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本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成交量的 5%的情况有 14 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度,国内经济延续逐月恢复态势,社融和信贷数据改善,房地产政策有所放松,季末制造业 PMI 重回扩张区间,同时仍旧面临着需求偏弱、内生动能不足的问题,物价指数同比增速偏低。三季度货币政策维持宽松,央行调降政策利率,DR007 季度均值较上季度略微下行。债券收益率呈 V 形走势,7 月-8 月上旬,增量政策预期与偏弱基本面的现实相互交织,债市窄幅震荡;8 月中旬,在金融数据走弱、政策利率调降、LPR 非对称调降等多重利好影响下,收益率快速下行;8 月下旬-9 月,随着房地产相关政策出现重大调整,经济扩张预期进一步加强,叠加银行间资金面阶段性偏紧,收益率趋势性上行。受权益及债券市场阶段性回调的影响,转债市场赚钱效应不强,板块分化较大。

报告期内,本基金重视大类资产的切换,纯债资产的久期和杠杆有所降低,转债资产仓位有所增加,并进行了波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富增强收益债券 A 类份额净值增长率为 0.67%,同期业绩比较基准收益率为-0.03%。本报告期汇添富增强收益债券 C 类份额净值增长率为 0.57%,同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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	196,874,269.36	86.29
	其中：债券	196,874,269.36	86.29
	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	5,000,000.00	2.19
	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	26,238,524.01	11.50
8	其他资产	29,045.54	0.01
9	合计	228,141,838.91	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：本基金报告期末未投资境内股票。

5.2.2 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持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	10,644,508.77	5.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	114,479,765.55	56.39
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,600,087.67	10.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,554,404.04	10.13
7	可转债（可交换债）	30,595,503.33	15.07
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	196,874,269.36	96.98

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	2020080	20 长沙银行二级	100,000	10,687,482.19	5.26
2	2028044	20 广发银行二级 01	100,000	10,664,987.95	5.25
3	019694	23 国债 01	105,000	10,644,508.77	5.24
4	2128032	21 兴业	100,000	10,557,253.15	5.20

		银行二 级 01			
5	1920066	19 上海 银行二 级	100,000	10,524,921.10	5.18

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,长沙银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,589.64

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,455.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,045.54

5.11.4 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	110073	国投转债	1,951,928.18	0.96
2	110087	天业转债	1,275,306.45	0.63
3	113043	财通转债	1,256,569.11	0.62
4	113647	禾丰转债	1,058,745.00	0.52
5	113638	台 21 转债	1,049,392.19	0.52
6	113062	常银转债	974,589.35	0.48
7	113066	平煤转债	948,071.73	0.47
8	123107	温氏转债	936,299.64	0.46
9	127045	牧原转债	918,658.98	0.45
10	110045	海澜转债	902,307.65	0.44
11	113059	福莱转债	886,819.04	0.44
12	113044	大秦转债	884,210.94	0.44
13	113050	南银转债	869,925.09	0.43
14	113054	绿动转债	865,040.96	0.43
15	113037	紫银转债	864,844.86	0.43
16	113021	中信转债	864,354.99	0.43

17	127068	顺博转债	843,194.30	0.42
18	127056	中特转债	809,155.49	0.40
19	110067	华安转债	803,505.40	0.40
20	127061	美锦转债	774,591.42	0.38
21	113545	金能转债	754,312.85	0.37
22	113636	甬金转债	739,502.40	0.36
23	123178	花园转债	727,058.65	0.36
24	110093	神马转债	726,503.70	0.36
25	128144	利民转债	703,897.29	0.35
26	127067	恒逸转 2	695,976.23	0.34
27	113627	太平转债	692,606.66	0.34
28	110092	三房转债	692,337.44	0.34
29	110089	兴发转债	683,097.16	0.34
30	110079	杭银转债	629,703.10	0.31
31	113655	欧 22 转债	623,024.82	0.31
32	127073	天赐转债	604,057.93	0.30
33	123128	首华转债	528,937.34	0.26
34	127016	鲁泰转债	518,969.92	0.26
35	127077	华宏转债	513,207.49	0.25
36	127044	蒙娜转债	506,003.78	0.25

5.11.5 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。

§ 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
本报告期期初基金份额总额	97,653,967.41	71,172,628.38
本报告期基金总申购	2,264,122.76	30,350,114.65

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	28,457,226.82	8,635,970.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	71,460,863.35	92,886,772.94

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

9.3 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

2023 年 10 月 25 日