

汇添富实业债债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 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 | 汇添富实业债债券 |
| 基金主代码 | 000122 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 06 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 1,765,280,545.52 |
| 投资目标 | 在严格管理风险和保持资产流动性的基础上，努力实现资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，重点自下而上的深入挖掘价值被低估的实业债标的券种。本基金采取的投资策略主要包括：类属资产配置策略、普通债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。 |

| | | |
|--------------------|---|---------------|
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*60%+中证可转债指数收益率*40% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富实业债债券 A | 汇添富实业债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000122 | 000123 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 1,667,466,769.76 | 97,813,775.76 |

§ 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(2024年07月01日 - 2024年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|----------------|
| | 汇添富实业债债券 A | 汇添富实业债债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | -18,107,613.98 | -1,819,911.37 |
| 2. 本期利润 | -3,074,847.44 | -7,167,435.89 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0018 | -0.0415 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,281,632,852.01 | 127,198,234.13 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.3683 | 1.3004 |

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

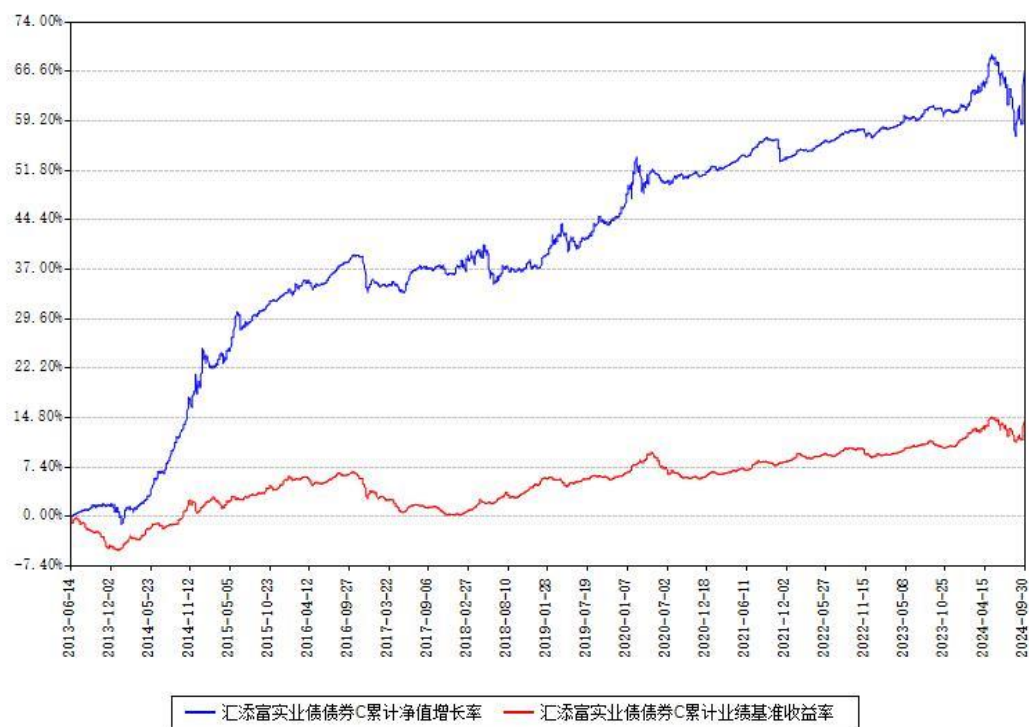
| 汇添富实业债债券 A | | | | | | |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
| 过去三个月 | 0.22% | 0.49% | 0.43% | 0.26% | -0.21% | 0.23% |
| 过去六个月 | 1.93% | 0.40% | 1.38% | 0.22% | 0.55% | 0.18% |
| 过去一年 | 3.82% | 0.30% | 3.45% | 0.16% | 0.37% | 0.14% |
| 过去三年 | 7.91% | 0.18% | 5.89% | 0.10% | 2.02% | 0.08% |
| 过去五年 | 18.16% | 0.18% | 8.06% | 0.09% | 10.10% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 74.78% | 0.19% | 14.40% | 0.09% | 60.38% | 0.10% |
| 汇添富实业债债券 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 | 0.12% | 0.49% | 0.43% | 0.26% | -0.31% | 0.23% |
| 过去六个月 | 1.72% | 0.40% | 1.38% | 0.22% | 0.34% | 0.18% |
| 过去一年 | 3.37% | 0.30% | 3.45% | 0.16% | -0.08% | 0.14% |
| 过去三年 | 6.59% | 0.18% | 5.89% | 0.10% | 0.70% | 0.08% |
| 过去五年 | 15.80% | 0.18% | 8.06% | 0.09% | 7.74% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 66.58% | 0.20% | 14.40% | 0.09% | 52.18% | 0.11% |

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

汇添富实业债债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富实业债债券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（2013年06月14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。

本基金各类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 | | |
| 徐一恒 | 本基金的基金经理, 固收研究部副总经理 | 2020年06月04日 | - | 14 | 国籍：中国。学历：武汉大学金融工程学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年9月至2014年12月任汇添富基金管理股份有限公司债券分析师，2014年12月至2019年8月任汇添富 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>基金管理股份有限公司专户投资经理，现任固收研究部副总经理。2019 年 9 月 4 日至 2021 年 9 月 2 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。2019 年 12 月 4 日至 2021 年 9 月 2 日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 4 日至 2023 年 5 月 12 日任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 4 日至 2022 年 10 月 10 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 4 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 4 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月 5 日至今任汇添富稳健收益混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月 10 日至今任汇添富稳健添盈一年持</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|-----|--------------------|------------------|---|----|--|
| | | | | | <p>有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 9 日至 2023 年 11 月 6 日任汇添富稳进双盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理。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。</p> |
| 吴江宏 | 本基金的基金经理, 稳健收益部总经理 | 2024 年 03 月 04 日 | - | 13 | <p>国籍：中国。学历：厦门大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益分析师，现任稳健收益部总经理。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至 2020</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 日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。</p> <p>2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 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。2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 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。2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 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</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>金经理。2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫盛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 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|----|----------|------------------|---|----|---|
| | | | | | <p>2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 25 日至今任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 10 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 4 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 胡奕 | 本基金的基金经理 | 2024 年 06 月 28 日 | - | 10 | <p>国籍：中国。学历：上海交通大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月至 2016 年 6 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益助理研究员；2016 年 7 月至 2018 年 6 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益研究员；2018 年 7 月至 2019 年 8 月任汇添富基金</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>管理股份有限公司固定收益高级研究员。2019 年 9 月 1 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至 2021 年 1 月 29 日任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至 2021 年 1 月 29 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至 2021 年 1 月 29 日任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至 2022 年 9 月 5 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至 2021 年 1 月 29 日任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理助理。</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>2019 年 9 月 1 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>2019 年 9 月 1 日至 2024 年 6 月 13 日任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>2019 年 10 月 8 日至 2021 年 2 月 3 日任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>2019 年 10 月 8 日至 2021 年 2 月 3 日任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2021 年 1 月 29 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2021 年 1 月 29</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2021 年 1 月 29 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 11 月 19 日至今任汇添富稳健增长混合型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 7 月 1 日至 2022 年 10 月 10 日任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至 2022 年 10 月 21 日任汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至 2024 年 1 月 22 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至 2022 年 3 月 7 日任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 7</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>月 1 日至 2021 年 9 月 3 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 3 日任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至 2022 年 3 月 7 日任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 7 月 1 日至今任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 3 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 3 日至今任汇添富保鑫灵活配置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欣享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 3 月 22 日至今任汇添富添乐双鑫债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 6 月 28 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|------|
| | | | | | 金经理。 |
|--|--|--|--|--|------|

注: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。

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。

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合规守信情况说明

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,保障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,公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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 1 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。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，中国宏观经济总体呈现平稳态势，稳增长政策全面出台。从结构上看，各分项均有所承压，制造业和基建仍是支撑经济的主要动力，但在三季度也面临逐渐放缓的趋势；居民消费意愿和能力不足，消费和服务业有所疲软；出口尚有支撑，但海外经济体衰退预期对中国出口持续性形成隐忧；房地产市场依然面临压力，数据尚未明显回暖。政策方面，货币政策先行，总量层面，九月底发布会央行宣布降准、降息、调降存量房贷利率等一系列货币政策“组合拳”。结构性政策层面，稳定资本市场、提振地产需求、缓解开发商现金流压力等方面均有举措。在随后的重要会议中，财政政策也提出要加大逆周期调节力度，保证必要的财政支出，使用好超长期特别国债和地方政府专项债等各项稳经济政策工具。

报告期内，债券市场收益率以震荡下行为主，季末稳增长政策出台后有所上行。7 月以来，长端利率债主要在降准降息的预期下震荡下行，同时在央行买卖债券的影响下有所波动，而信用债普遍在资金面紧平衡和融资成本抬升的市场环境下震荡走平，利率债与信用债表现明显分化，信用利差和评级利差均有所走扩。9 月下旬，伴随货币政策财政政策等各项重要稳经济政策全面出台，风险情绪快速提升，债券收益率全面上行。

报告期内，股票市场大幅震荡，整体收涨。上证指数 7 月至 9 月下旬持续下跌 8.87%，季末一系列强力稳增长政策落地后快速反弹 13.79%，总体收涨 3.68%。由于市场对经济复苏的预期增强，宏观相关性较大的行业涨幅居前，稳健红利类型的行业下跌较多，具体来看，非银金融、房地产、商贸零售、家用电器涨幅靠前，石油石化、煤炭、公用事业、美容护理跌幅靠前。

报告期内，转债市场大体跟随股票波动先跌后涨，中证转债下跌 3.01%。从 6 月延续到三季度，市场担忧个别转债的退市、信用风险，集中抛售略有瑕疵的转债，同时股票市场下

跌，带动转债大幅调整，后随着稳增长政策推出快速反弹。当前转债市场估值仍然偏低，我们认为在严控信用风险和退市风险的前提下，精选其中被错杀标的，具有较好的配置价值：
1、转债到期收益率处于历史高位，债底溢价率处于历史低位，低价转债的信用替代的安全边际显现，下行风险可控；2、主要股指估值处于历史较点水平，参考过去历史几轮周期，在股票市场拐点出现时，除了转股价值会跟随上涨，同时转债估值也会扩张。

报告期内，组合坚持低价转债策略，在下行中逐渐加仓，提升转债仓位至较高水平。在严格控制信用风险和退市风险的前提下，以 2 年左右的时间维度挑选下行风险可控、期权价值突出的优质低价转债。组合信用债持仓部分以高等级信用债为主。未来，我们将持续优化类属资产与个券结构，通过自下而上的方式深入挖掘转债个券的投资价值以及高等级信用债收益率曲线上的结构性投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富实业债债券 A 类份额净值增长率为 0.22%，同期业绩比较基准收益率为 0.43%。本报告期汇添富实业债债券 C 类份额净值增长率为 0.12%，同期业绩比较基准收益率为 0.43%。

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 | 2,597,872,771.96 | 96.11 |
| | 其中：债券 | 2,597,872,771.96 | 96.11 |
| | 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 | -785.72 | 0.00 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 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 | 64,166,078.93 | 2.37 |
| 8 | 其他资产 | 41,042,111.28 | 1.52 |
| 9 | 合计 | 2,703,080,176.45 | 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 130,327,965.35 | 5.41 |
| | 其中：政策性金融债 | 130,327,965.35 | 5.41 |
| 4 | 企业债券 | 477,185,188.26 | 19.81 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 50,246,684.93 | 2.09 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,940,112,933.42 | 80.54 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 地方政府债 | - | - |
| 10 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------------|--------|
| 11 | 合计 | 2,597,872,771. 96 | 107.85 |
|----|----|----------------------|--------|

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 | 113052 | 兴业转债 | 1,003,810 | 109,876,355.06 | 4.56 |
| 2 | 113661 | 福 22 转债 | 762,230 | 81,448,702.70 | 3.38 |
| 3 | 113059 | 福莱转债 | 711,410 | 73,071,552.34 | 3.03 |
| 4 | 113021 | 中信转债 | 558,760 | 66,989,659.86 | 2.78 |
| 5 | 110059 | 浦发转债 | 470,050 | 52,086,536.70 | 2.16 |

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,甬金科技集团股份有限公司出现在报告期内受监管机构立案调查的情况,兴业银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、上海浦东发展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 | 173,620.02 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 40,868,491.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 41,042,111.28 |

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 | 113052 | 兴业转债 | 109,876,355.06 | 4.56 |
| 2 | 113661 | 福22转债 | 81,448,702.70 | 3.38 |
| 3 | 113059 | 福莱转债 | 73,071,552.34 | 3.03 |

| | | | | |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 4 | 113021 | 中信转债 | 66,989,659.86 | 2.78 |
| 5 | 110059 | 浦发转债 | 52,086,536.70 | 2.16 |
| 6 | 113636 | 甬金转债 | 45,741,363.84 | 1.90 |
| 7 | 127066 | 科利转债 | 43,957,638.61 | 1.82 |
| 8 | 111010 | 立昂转债 | 40,433,332.48 | 1.68 |
| 9 | 123154 | 火星转债 | 35,647,610.43 | 1.48 |
| 10 | 111014 | 李子转债 | 35,571,068.78 | 1.48 |
| 11 | 113050 | 南银转债 | 35,151,881.88 | 1.46 |
| 12 | 113606 | 荣泰转债 | 34,975,138.20 | 1.45 |
| 13 | 113053 | 隆 22 转债 | 34,785,698.89 | 1.44 |
| 14 | 123169 | 正海转债 | 34,102,016.17 | 1.42 |
| 15 | 132026 | G 三峡 EB2 | 34,060,083.93 | 1.41 |
| 16 | 123113 | 仙乐转债 | 32,247,138.24 | 1.34 |
| 17 | 110089 | 兴发转债 | 31,408,029.62 | 1.30 |
| 18 | 128074 | 游族转债 | 31,197,566.42 | 1.30 |
| 19 | 110087 | 天业转债 | 30,847,298.31 | 1.28 |
| 20 | 123233 | 凯盛转债 | 30,719,009.34 | 1.28 |
| 21 | 118035 | 国力转债 | 30,085,339.49 | 1.25 |
| 22 | 128097 | 奥佳转债 | 29,387,068.98 | 1.22 |
| 23 | 118033 | 华特转债 | 29,083,588.14 | 1.21 |
| 24 | 113652 | 伟 22 转债 | 29,001,110.67 | 1.20 |
| 25 | 127018 | 本钢转债 | 28,934,875.43 | 1.20 |
| 26 | 123193 | 海能转债 | 28,718,317.45 | 1.19 |
| 27 | 127073 | 天赐转债 | 27,413,026.63 | 1.14 |
| 28 | 113643 | 风语转债 | 27,216,589.38 | 1.13 |
| 29 | 118005 | 天奈转债 | 26,857,298.60 | 1.11 |
| 30 | 123179 | 立高转债 | 24,836,859.71 | 1.03 |
| 31 | 123210 | 信服转债 | 24,444,939.93 | 1.01 |
| 32 | 113638 | 台 21 转债 | 23,996,626.96 | 1.00 |

| | | | | |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 33 | 113654 | 永 02 转债 | 23,886,953.92 | 0.99 |
| 34 | 113605 | 大参转债 | 23,380,969.19 | 0.97 |
| 35 | 118024 | 冠宇转债 | 22,706,094.16 | 0.94 |
| 36 | 113655 | 欧 22 转债 | 22,503,507.97 | 0.93 |
| 37 | 127041 | 弘亚转债 | 20,925,764.22 | 0.87 |
| 38 | 123165 | 回天转债 | 20,886,385.59 | 0.87 |
| 39 | 113644 | 艾迪转债 | 20,266,049.55 | 0.84 |
| 40 | 123124 | 晶瑞转 2 | 18,757,284.33 | 0.78 |
| 41 | 118030 | 睿创转债 | 17,980,143.13 | 0.75 |
| 42 | 127044 | 蒙娜转债 | 17,566,632.51 | 0.73 |
| 43 | 118034 | 晶能转债 | 17,506,825.40 | 0.73 |
| 44 | 118028 | 会通转债 | 17,465,372.30 | 0.73 |
| 45 | 113047 | 旗滨转债 | 17,145,786.63 | 0.71 |
| 46 | 123115 | 捷捷转债 | 17,010,575.90 | 0.71 |
| 47 | 113650 | 博 22 转债 | 15,325,480.61 | 0.64 |
| 48 | 110090 | 爱迪转债 | 13,694,068.08 | 0.57 |
| 49 | 118011 | 银微转债 | 13,652,217.26 | 0.57 |
| 50 | 118041 | 星球转债 | 13,598,944.22 | 0.56 |
| 51 | 110081 | 闻泰转债 | 13,491,966.37 | 0.56 |
| 52 | 113633 | 科沃转债 | 13,458,395.41 | 0.56 |
| 53 | 127056 | 中特转债 | 12,913,165.90 | 0.54 |
| 54 | 127045 | 牧原转债 | 12,664,816.29 | 0.53 |
| 55 | 118032 | 建龙转债 | 12,558,811.81 | 0.52 |
| 56 | 123114 | 三角转债 | 12,173,123.67 | 0.51 |
| 57 | 127038 | 国微转债 | 12,002,644.93 | 0.50 |
| 58 | 118014 | 高测转债 | 11,860,786.88 | 0.49 |
| 59 | 127046 | 百润转债 | 11,646,283.60 | 0.48 |
| 60 | 128134 | 鸿路转债 | 10,625,936.08 | 0.44 |
| 61 | 123183 | 海顺转债 | 10,029,353.94 | 0.42 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 62 | 113682 | 益丰转债 | 9,939,643.48 | 0.41 |
| 63 | 118009 | 华锐转债 | 9,098,294.95 | 0.38 |
| 64 | 123133 | 佩蒂转债 | 8,449,530.12 | 0.35 |
| 65 | 113584 | 家悦转债 | 8,411,357.48 | 0.35 |
| 66 | 113064 | 东材转债 | 8,408,718.15 | 0.35 |
| 67 | 128135 | 洽洽转债 | 8,278,021.62 | 0.34 |
| 68 | 113641 | 华友转债 | 8,049,094.40 | 0.33 |
| 69 | 123158 | 宙邦转债 | 7,721,308.34 | 0.32 |
| 70 | 123151 | 康医转债 | 7,614,276.77 | 0.32 |
| 71 | 123202 | 祥源转债 | 6,858,716.57 | 0.28 |
| 72 | 123076 | 强力转债 | 6,677,006.87 | 0.28 |
| 73 | 113048 | 晶科转债 | 6,302,276.93 | 0.26 |
| 74 | 127026 | 超声转债 | 6,235,754.92 | 0.26 |
| 75 | 113627 | 太平转债 | 6,058,062.41 | 0.25 |
| 76 | 128131 | 崇达转 2 | 5,791,877.86 | 0.24 |
| 77 | 118000 | 嘉元转债 | 5,435,427.93 | 0.23 |
| 78 | 110085 | 通 22 转债 | 5,321,903.04 | 0.22 |
| 79 | 113663 | 新化转债 | 5,296,973.72 | 0.22 |
| 80 | 123120 | 隆华转债 | 5,242,033.70 | 0.22 |
| 81 | 110079 | 杭银转债 | 4,966,519.95 | 0.21 |
| 82 | 127015 | 希望转债 | 4,770,375.73 | 0.20 |
| 83 | 110082 | 宏发转债 | 4,674,891.14 | 0.19 |
| 84 | 127079 | 华亚转债 | 4,227,058.04 | 0.18 |
| 85 | 123231 | 信测转债 | 4,065,061.68 | 0.17 |
| 86 | 118040 | 宏微转债 | 3,905,242.02 | 0.16 |
| 87 | 113660 | 寿 22 转债 | 3,811,234.92 | 0.16 |
| 88 | 127042 | 嘉美转债 | 3,653,426.08 | 0.15 |
| 89 | 113623 | 凤 21 转债 | 2,955,709.01 | 0.12 |
| 90 | 128063 | 未来转债 | 2,834,814.66 | 0.12 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 91 | 113666 | 爱玛转债 | 2,834,107.22 | 0.12 |
| 92 | 123107 | 温氏转债 | 2,607,078.12 | 0.11 |
| 93 | 127100 | 神码转债 | 2,430,631.60 | 0.10 |
| 94 | 127089 | 晶澳转债 | 2,408,258.21 | 0.10 |
| 95 | 123215 | 铭利转债 | 2,325,907.14 | 0.10 |
| 96 | 128136 | 立讯转债 | 2,307,334.34 | 0.10 |
| 97 | 127031 | 洋丰转债 | 2,199,070.64 | 0.09 |
| 98 | 111004 | 明新转债 | 1,521,083.69 | 0.06 |
| 99 | 128137 | 洁美转债 | 1,509,068.75 | 0.06 |
| 100 | 127088 | 赫达转债 | 1,019,871.03 | 0.04 |
| 101 | 118006 | 阿拉转债 | 734,970.22 | 0.03 |
| 102 | 128121 | 宏川转债 | 643,715.09 | 0.03 |
| 103 | 110093 | 神马转债 | 442,218.84 | 0.02 |
| 104 | 113658 | 密卫转债 | 48,925.15 | 0.00 |
| 105 | 123237 | 佳禾转债 | 2,369.97 | 0.00 |

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 | 汇添富实业债债券 A | 汇添富实业债债券 C |
|---------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,985,929,612.02 | 283,860,029.05 |
| 本报告期基金总申购份额 | 385,980,476.51 | 54,135,140.34 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 704,443,318.77 | 240,181,393.63 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 1,667,466,769.76 | 97,813,775.76 |

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实业债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富实业债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富实业债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、报告期内汇添富实业债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

2024 年 10 月 25 日