

汇添富可转换债券债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 01 月 24 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 2022 年 1 月 20 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 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富可转换债券
基金主代码	470058
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 06 月 17 日
报告期末基金份额总额(份)	5,334,099,119.66
投资目标	本基金重点投资于可转换债券(含可分离交易可转债)，努力在控制投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：资产配置和类属资产配置策略、可转换债券投资策略、可分离交易可转债投资策略、普通债券投资策略、股票投资策略、资产证券化产品投资策略、权证投资策略、其他衍生工具投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较	中证可转换债券指数收益率*70%+中债综合指数收益率*20%+沪深 300 指数

基准	收益率*10%	
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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富可转换债券 A	汇添富可转换债券 C
下属分级基金的交易代码	470058	470059
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	4,674,973,617.88	659,125,501.78

§ 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(2021 年 10 月 01 日 - 2021 年 12 月 31 日)	
	汇添富可转换债券 A	汇添富可转换债券 C
1. 本期已实现收益	238,306,732.85	33,896,969.11
2. 本期利润	743,436,396.95	107,612,848.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1894	0.1813
4. 期末基金资产净值	10,066,811,188.53	1,354,929,330.84
5. 期末基金份额净值	2.153	2.056

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 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

汇添富可转换债券 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	9.79%	0.72%	5.14%	0.42%	4.65%	0.30%
过去六个月	14.46%	0.81%	9.24%	0.49%	5.22%	0.32%
过去一年	20.62%	0.82%	12.51%	0.48%	8.11%	0.34%
过去三年	94.23%	0.83%	44.68%	0.58%	49.55%	0.25%
过去五年	94.52%	0.77%	42.27%	0.54%	52.25%	0.23%
自基金合同生效日起至今	167.27%	1.19%	43.37%	0.92%	123.90%	0.27%
汇添富可转换债券 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	9.71%	0.73%	5.14%	0.42%	4.57%	0.31%
过去六个月	14.29%	0.81%	9.24%	0.49%	5.05%	0.32%
过去一年	20.23%	0.82%	12.51%	0.48%	7.72%	0.34%
过去三年	91.91%	0.83%	44.68%	0.58%	47.23%	0.25%
过去五年	90.66%	0.77%	42.27%	0.54%	48.39%	0.23%
自基金合同生效日起至今	156.73%	1.19%	43.37%	0.92%	113.36%	0.27%

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

汇添富可转换债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富可转换债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2011 年 06 月 17 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。

§ 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		
吴江宏	本基金的基金经理, 股债混合部主管	2015 年 07 月 17 日		10	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，现任股债混合部主管。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 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。 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。 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。 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。 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。
胡奕	本基金的基金经理	2021 年 02 月 03 日		7	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 日至今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。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。2019 年 9 月 1 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助理。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。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 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 日至今任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资
--	--	--	--	--	--

					资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至今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 日至今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 日至今任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 7 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。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 日至今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。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。
--	--	--	--	--	----

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 11 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

四季度经济基本面总体延续下行态势，其中消费复苏受到疫情反复的冲击，地产投资在严格调控的影响下增速转负，制造业投资尽管出现回升，但在基建发力不明显的情况下，整体投资需求低迷，出口依然保持较高增速，但价格因素的贡献要明显大于数量因素。12 月中央经济工作会议定调当前经济面临“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力，要求加大跨周期调节力度，预计后续总量政策将继续保持积极态势。流动性方面，继 7 月份降准之后，12 月央行再次下调存款准备金率，同时下调了 1 年期 LPR 利率，货币政策偏宽松的取向较为确定，在进一步降低社会融资成本的要求下，预计后续政策利率亦存在下调空间。

在经济下行、流动性宽松的背景下股票市场结构性行情延续，全市场指数层面变动不大，但行业内部分化明显，军工、通讯、新能源车等行业涨幅靠前，周期、金融、地产板块跌幅靠前，市场成交量有所萎缩。可转债指数四季度上涨明显，资金推动的结构性泡沫加剧，股性转债估值溢价靠近历史极值。

报告期内，我们认为转债估值呈现结构性泡沫，组合超配股票，低配转债。结构上减持明显泡沫化的个券，增持估值合理的个券。组合管理上，坚持自下而上挑选基本面相对优质且估值合理的可转债。股票投资聚焦于具有长期竞争优势、业绩持续动力强的龙头公司，主要配置品牌消费品、新能源、高端制造等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 9.79%;C 类基金份额净值增长率为 9.71%。同期业绩比较基准收益率为 5.14%。

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	2,038,798,504.13	17.19
	其中：股票	2,038,798,504.13	17.19
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,611,807,904.12	81.03
	其中：债券	9,611,807,904.12	81.03
	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	142,504,489.45	1.20
8	其他资产	68,736,748.82	0.58
9	合计	11,861,847,646.52	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

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	采矿业	—	—
C	制造业	1,762,413,111.77	15.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,279,892.36	0.65
J	金融业	57,832,000.00	0.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	84,983,500.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	59,290,000.00	0.52
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,038,798,504.13	17.85

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

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	600519	贵州茅台	100,000	205,000,000.00	1.79
2	300750	宁德时代	310,000	182,280,000.00	1.60
3	300274	阳光电源	780,000	113,724,000.00	1.00

4	000568	泸州老窖	430,000	109,164,100.00	0.96
5	600809	山西汾酒	300,000	94,734,000.00	0.83
6	002415	海康威视	1,708,524	89,389,975.68	0.78
7	002049	紫光国微	350,000	78,750,000.00	0.69
8	603501	韦尔股份	250,000	77,692,500.00	0.68
9	601888	中国中免	350,000	76,793,500.00	0.67
10	002475	立讯精密	1,399,977	68,878,868.40	0.60

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	586,436,856.90	5.13
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	9,025,371,047.22	79.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,611,807,904.	84.15

		12	
--	--	----	--

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	123111	东财转 3	6,865,724	1,154,677,462.32	10.11
2	127045	牧原转债	4,106,281	569,705,425.94	4.99
3	113050	南银转债	4,237,800	501,416,496.00	4.39
4	110081	闻泰转债	3,081,830	485,942,954.40	4.25
5	113025	明泰转债	875,920	392,298,290.40	3.43

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，南京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	1,099,309.54
2	应收证券清算款	17,640,790.26
3	应收股利	—
4	应收利息	19,063,352.69
5	应收申购款	30,933,296.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	68,736,748.82

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	123111	东财转 3	1,154,677,462.32	10.11
2	113050	南银转债	501,416,496.00	4.39
3	113025	明泰转债	392,298,290.40	3.43
4	132018	G 三峡 EB1	373,951,301.00	3.27

5	110075	南航转债	361,429,630.50	3.16
6	110079	杭银转债	325,720,670.60	2.85
7	128109	楚江转债	284,572,078.32	2.49
8	127011	中鼎转 2	170,070,966.40	1.49
9	127032	苏行转债	158,083,126.08	1.38
10	128035	大族转债	154,305,139.66	1.35
11	110045	海澜转债	152,216,715.60	1.33
12	110053	苏银转债	140,758,446.40	1.23
13	127024	盈峰转债	126,490,076.90	1.11
14	127025	冀东转债	124,768,172.76	1.09
15	113046	金田转债	122,615,494.40	1.07
16	110077	洪城转债	105,057,456.00	0.92
17	128135	洽洽转债	102,351,447.00	0.90
18	110072	广汇转债	100,410,242.40	0.88
19	128131	崇达转 2	92,580,893.72	0.81
20	113043	财通转债	80,869,818.50	0.71
21	127036	三花转债	73,661,811.93	0.64
22	127006	敖东转债	73,265,714.19	0.64
23	127016	鲁泰转债	72,270,486.75	0.63
24	113623	风 21 转债	69,389,613.60	0.61
25	113026	核能转债	66,708,804.90	0.58
26	113599	嘉友转债	64,778,824.00	0.57
27	123073	同和转债	63,613,012.32	0.56
28	123114	三角转债	63,447,522.40	0.56
29	110076	华海转债	62,072,415.60	0.54
30	127018	本钢转债	59,376,643.56	0.52
31	113606	荣泰转债	57,857,710.50	0.51
32	110062	烽火转债	57,775,000.00	0.51
33	110074	精达转债	56,324,658.70	0.49

34	113605	大参转债	54,299,360.90	0.48
35	123109	昌红转债	51,845,075.64	0.45
36	113568	新春转债	50,780,367.00	0.44
37	113618	美诺转债	50,350,559.60	0.44
38	127027	靖远转债	49,804,483.20	0.44
39	123099	普利转债	48,961,181.40	0.43
40	113045	环旭转债	48,562,997.00	0.43
41	123108	乐普转 2	48,509,921.92	0.42
42	132014	18 中化 EB	44,255,196.60	0.39
43	113550	常汽转债	43,684,619.30	0.38
44	128121	宏川转债	43,233,505.50	0.38
45	123078	飞凯转债	42,416,114.00	0.37
46	128134	鸿路转债	39,910,089.57	0.35
47	123090	三诺转债	38,034,588.24	0.33
48	110056	亨通转债	37,488,854.70	0.33
49	127005	长证转债	35,565,712.50	0.31
50	128125	华阳转债	34,938,000.00	0.31
51	113596	城地转债	32,822,304.00	0.29
52	128137	洁美转债	31,820,000.00	0.28
53	123076	强力转债	31,199,242.88	0.27
54	123096	思创转债	29,848,872.50	0.26
55	113537	文灿转债	29,456,240.00	0.26
56	128023	亚太转债	28,694,272.08	0.25
57	113602	景 20 转债	28,670,000.00	0.25
58	128108	蓝帆转债	28,557,612.50	0.25
59	123101	拓斯转债	26,740,217.40	0.23
60	123091	长海转债	25,835,646.14	0.23
61	113584	家悦转债	24,807,006.00	0.22
62	113624	正川转债	23,843,873.20	0.21

63	123071	天能转债	23,018,613.60	0.20
64	123113	仙乐转债	22,018,516.80	0.19
65	123077	汉得转债	19,547,334.25	0.17
66	127033	中装转 2	19,542,409.92	0.17
67	118000	嘉元转债	17,116,199.10	0.15
68	123070	鹏辉转债	17,090,461.44	0.15
69	128116	瑞达转债	16,869,052.80	0.15
70	123044	红相转债	16,162,846.52	0.14
71	128042	凯中转债	10,641,564.60	0.09
72	128136	立讯转债	10,239,525.14	0.09
73	127037	银轮转债	7,544,792.64	0.07
74	113622	杭叉转债	5,930,987.20	0.05

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富可转换债券 A	汇添富可转换债券 C
本报告期期初基金份额总额	4,053,782,739.27	514,842,888.57
本报告期基金总申购份额	3,279,436,417.56	299,549,756.43
减：本报告期基金总赎回份额	2,658,245,538.95	155,267,143.22
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	4,674,973,617.88	659,125,501.78

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可转换债券债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富可转换债券债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富可转换债券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、报告期内汇添富可转换债券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

2022 年 01 月 24 日