

汇添富可转换债券债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：2024 年 01 月 22 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 2024 年 1 月 18 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 10 月 01 日起至 2023 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)	2,868,737,518.76
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)	2,358,114,195.70	510,623,323.06

§ 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10月01日 - 2023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	-72,897,100.45	-14,198,826.87
2. 本期利润	-181,169,569.32	-28,915,991.32
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0722	-0.0577
4. 期末基金资产净值	4,026,421,782.86	825,737,324.41
5. 期末基金份额净值	1.7075	1.6171

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	-3.59%	0.52%	-2.84%	0.36%	-0.75%	0.16%
过去六个月	-4.29%	0.47%	-3.59%	0.33%	-0.70%	0.14%
过去一年	-3.15%	0.53%	-1.17%	0.34%	-1.98%	0.19%
过去三年	-4.34%	0.78%	0.95%	0.46%	-5.29%	0.32%
过去五年	54.04%	0.80%	29.81%	0.53%	24.23%	0.27%
自基金合同生效日起至今	111.97%	1.13%	28.64%	0.86%	83.33%	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	-3.69%	0.51%	-2.84%	0.36%	-0.85%	0.15%
过去六个月	-4.48%	0.47%	-3.59%	0.33%	-0.89%	0.14%
过去一年	-3.51%	0.53%	-1.17%	0.34%	-2.34%	0.19%
过去三年	-5.43%	0.78%	0.95%	0.46%	-6.38%	0.32%
过去五年	50.94%	0.80%	29.81%	0.53%	21.13%	0.27%
自基金合同生效日起至今	101.92%	1.13%	28.64%	0.86%	73.28%	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：本基金建仓期为本《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, 稳健收益部总经理	2015 年 07 月 17 日	-	12	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 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

				<p>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</p>
--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

				<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>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。</p>
胡奕	本基金的基金经理	2021 年 02 月 03 日	-	9	<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</p>

				<p>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。</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

				<p>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。</p> <p>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。</p> <p>2019 年 11 月 19 日至今任汇添富稳健增长混合型</p>
--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

				<p>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 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 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 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。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富盈润混合型证券投资基金的</p>
--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>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>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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,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 6 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，中国宏观经济温和筑底有韧性。具体表现为，四季度消费持续恢复，制造业投资较为平稳，出口和基建投资温和回落，地产投资加速下行，物价数据筑底并出现回升迹象，结构上，经济新旧动能的转换趋势正在持续。政策方面，四季度稳增长政策频频出台，稳地产政策加码，增发国债、特殊再融资债等政府债券发行超预期，中央财政加杠杆和提高存量政策有效性等政策思路显现。流动性方面，在汇率因素和财政投放不及预期的影响下，整体呈现紧平衡态势。海外方面，相较三季度的强劲增长，美国四季度经济活动温和放缓，通胀相对回落，美联储的表态发生了明显的“鸽派”调整，暗示本周期加息结束，降息讨论进入视野，美债利率见顶快速下行，美元指数走低，全球风险资产有所提振。

股票市场震荡下行，上证指数下跌 4.36%，创业板指下跌 5.62%。在弱市场情绪、低利率环境下，低估值高股息的稳健型资产更受市场青睐，煤炭、电子、农林牧渔涨幅靠前；和

地产、可选消费相关的行业基本面偏弱，美容护理、房地产、建筑材料跌幅靠前。

报告期内，转债市场下跌 3.22%。具体来看，10 月延续 8 月以来的下跌，至 10 月 23 日中证转债下跌了 4.4%。随后至 11 月 15 日迎来小盘股的反弹，带动中证转债上涨 3.09%。随后至 12 月 26 日，股市带动转债加速下跌，中证转债下跌 3.73%。随后至年末，权益市场强势反弹，带动中证转债上涨 2.16%。综合来看，报告期内，转债的下跌主要是转债溢价率下行贡献，次要是转股平价下跌贡献。

伴随股票市场下跌，部分低价转债呈现“进可攻退可守”的特性，具有较好的配置价值：
1、转债绝对价格处于历史中位数水平，百元溢价率处于中上水平，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逐渐显现，下行风险可控。2、股市估值处于历史低点，如果股市上涨，将带动转股价值上升，同时转债估值有扩张可能。

基于以上逻辑，报告期内组合大幅提升转债仓位，在下行市场中逐渐布局低价转债，精选价格已经接近债底、信用风险较低、且有上涨可能的标的。股票部分，我们认为权益资产处于“赔率较高，胜率逐步提升”的阶段，不少优质公司的估值已经很有吸引力，组合维持中性的权益仓位，核心仓位是估值合理或者低估的优质成长股，结构上，增持了估值较低的消费电子。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富可转换债券 A 类份额净值增长率为-3.59%，同期业绩比较基准收益率为-2.84%。本报告期汇添富可转换债券 C 类份额净值增长率为-3.69%，同期业绩比较基准收益率为-2.84%。

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	836,710,502.69	14.32
	其中：股票	836,710,502.69	14.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,571,581,119.57	78.26

	其中：债券	4,571,581,119.57	78.26
	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	-129.95	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	431,281,769.03	7.38
8	其他资产	2,214,932.70	0.04
9	合计	5,841,788,194.04	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	129,045,735.00	2.66
C	制造业	615,814,366.69	12.69
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	5,351,353.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,108,000.00	0.79
J	金融业	42,120,000.00	0.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,271,048.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	836,710,502.69	17.24

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	73,000	125,998,000.00	2.60
2	601899	紫金矿业	6,500,000	80,990,000.00	1.67
3	000568	泸州老窖	300,000	53,826,000.00	1.11
4	300750	宁德时代	300,000	48,978,000.00	1.01
5	300059	东方财富	3,000,000	42,120,000.00	0.87
6	600256	广汇能源	5,500,000	39,270,000.00	0.81
7	600085	同仁堂	700,000	37,590,000.00	0.77

8	600809	山西汾酒	160,000	36,916,800.00	0.76
9	601689	拓普集团	472,600	34,736,100.00	0.72
10	002270	华明装备	2,000,000	28,240,000.00	0.58

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	254,734,174.09	5.25
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）	4,316,846,945.48	88.97
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	4,571,581,119.57	94.22

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	132018	G 三峡 EB1	2,879,110	445,002,735.17	9.17
2	127045	牧原转 债	3,414,720	387,304,278.28	7.98
3	113052	兴业转 债	3,030,000	308,790,205.47	6.36
4	113641	华友转 债	2,109,460	219,241,783.75	4.52
5	110061	川投转 债	1,142,320	206,361,485.04	4.25

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,兴业银行股份有限公司、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	435,438.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,779,494.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,214,932.70

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	132018	G 三峡 EB1	445,002,735.17	9.17
2	127045	牧原转债	387,304,278.28	7.98
3	113052	兴业转债	308,790,205.47	6.36
4	113641	华友转债	219,241,783.75	4.52
5	110061	川投转债	206,361,485.04	4.25
6	113050	南银转债	198,962,881.29	4.10
7	110075	南航转债	152,568,203.24	3.14
8	110073	国投转债	123,832,867.55	2.55
9	110089	兴发转债	121,418,098.57	2.50
10	113061	拓普转债	113,851,644.90	2.35
11	110079	杭银转债	111,641,580.00	2.30
12	110081	闻泰转债	104,103,578.14	2.15

13	113066	平煤转债	97,613,689.50	2.01
14	127056	中特转债	97,430,004.30	2.01
15	127058	科伦转债	92,949,855.75	1.92
16	113043	财通转债	90,382,080.98	1.86
17	110067	华安转债	89,974,233.50	1.85
18	113655	欧 22 转债	77,155,804.54	1.59
19	113059	福莱转债	56,980,773.43	1.17
20	127032	苏行转债	56,420,800.65	1.16
21	111010	立昂转债	55,723,516.36	1.15
22	127073	天赐转债	54,144,601.82	1.12
23	118031	天 23 转债	52,673,726.40	1.09
24	111004	明新转债	47,521,701.65	0.98
25	113058	友发转债	44,110,954.42	0.91
26	127049	希望转 2	44,048,953.45	0.91
27	110068	龙净转债	41,667,350.33	0.86
28	118022	锂科转债	39,776,469.60	0.82
29	113063	赛轮转债	33,370,961.18	0.69
30	127084	柳工转 2	28,603,013.02	0.59
31	123178	花园转债	27,036,891.09	0.56
32	127050	麒麟转债	26,958,326.76	0.56
33	113060	浙 22 转债	25,021,243.84	0.52
34	113623	凤 21 转债	24,714,937.85	0.51
35	118034	晶能转债	24,227,745.74	0.50
36	113545	金能转债	21,436,136.18	0.44
37	110090	爱迪转债	21,103,256.64	0.43
38	113062	常银转债	21,096,140.36	0.43
39	113661	福 22 转债	20,948,465.51	0.43
40	111005	富春转债	19,552,353.73	0.40
41	113065	齐鲁转债	18,992,152.96	0.39

42	110085	通 22 转债	17,851,790.56	0.37
43	113044	大秦转债	17,797,481.79	0.37
44	127027	能化转债	17,595,908.33	0.36
45	127030	盛虹转债	16,859,190.42	0.35
46	110092	三房转债	16,743,934.54	0.35
47	113662	豪能转债	16,545,129.03	0.34
48	118027	宏图转债	16,050,723.45	0.33
49	128124	科华转债	15,651,785.85	0.32
50	127018	本钢转债	15,575,592.06	0.32
51	113615	金诚转债	15,130,801.22	0.31
52	110088	淮 22 转债	14,981,249.31	0.31
53	110045	海澜转债	14,229,373.31	0.29
54	113652	伟 22 转债	14,042,823.55	0.29
55	118024	冠宇转债	13,004,474.55	0.27
56	132026	G 三峡 EB2	12,822,948.50	0.26
57	113666	爱玛转债	11,037,218.19	0.23
58	110093	神马转债	10,426,169.69	0.21
59	113053	隆 22 转债	10,287,649.32	0.21
60	110048	福能转债	9,183,885.05	0.19
61	127012	招路转债	7,092,970.07	0.15
62	128134	鸿路转债	6,934,127.69	0.14
63	113618	美诺转债	6,797,114.19	0.14
64	123150	九强转债	6,549,088.96	0.13
65	113638	台 21 转债	6,240,556.50	0.13
66	127038	国微转债	5,990,408.87	0.12
67	127016	鲁泰转债	5,848,060.70	0.12
68	123165	回天转债	5,403,170.60	0.11
69	127066	科利转债	5,385,198.63	0.11
70	127022	恒逸转债	5,179,696.50	0.11

71	113045	环旭转债	5,170,095.19	0.11
72	113639	华正转债	4,929,117.69	0.10
73	127059	永东转 2	4,611,063.18	0.10
74	123158	宙邦转债	4,458,557.66	0.09
75	113658	密卫转债	4,142,190.78	0.09
76	127061	美锦转债	2,953,033.15	0.06
77	113064	东材转债	2,600,273.96	0.05
78	110072	广汇转债	2,161,535.36	0.04
79	123090	三诺转债	1,225,061.64	0.03

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
本报告期初基金份额总额	2,834,025,393.13	556,021,608.23
本报告期基金总申购份额	888,333,030.53	112,699,760.01
减：本报告期基金总赎回份额	1,364,244,227.96	158,098,045.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,358,114,195.70	510,623,323.06

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

2024 年 01 月 22 日