汇添富可转换债券债券型证券投资基金 2026 年第 3 季度报告

2026 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：2026 年 10 月 27 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约定，于 2026 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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 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)	851,684,072.17
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。
业绩比较基准	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	汇添富可转换债券 D
下属分级基金的交易代码	470058	470059	025413
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	544,313,468.13	280,802,784.72	26,567,819.32

§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(2026 年 07 月 01 日 - 2026 年 09 月 30 日)		
	汇添富可转换债券 A	汇添富可转换债券 C	汇添富可转换债券 D
1.本期已实现收益	15,609,550.42	5,803,386.89	609,238.28
2.本期利润	-119,077,092.62	-53,726,725.35	-5,141,436.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1941	-0.1852	-0.2130
4.期末基金资产净值	1,203,075,304.91	581,362,144.52	58,729,872.40
5.期末基金份额净值	2.2103	2.0704	2.2106

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	-8.16%	0.68%	-6.08%	0.55%	-2.08%	0.13%
过去六个	-5.03%	0.76%	-2.40%	0.63%	-2.63%	0.13%

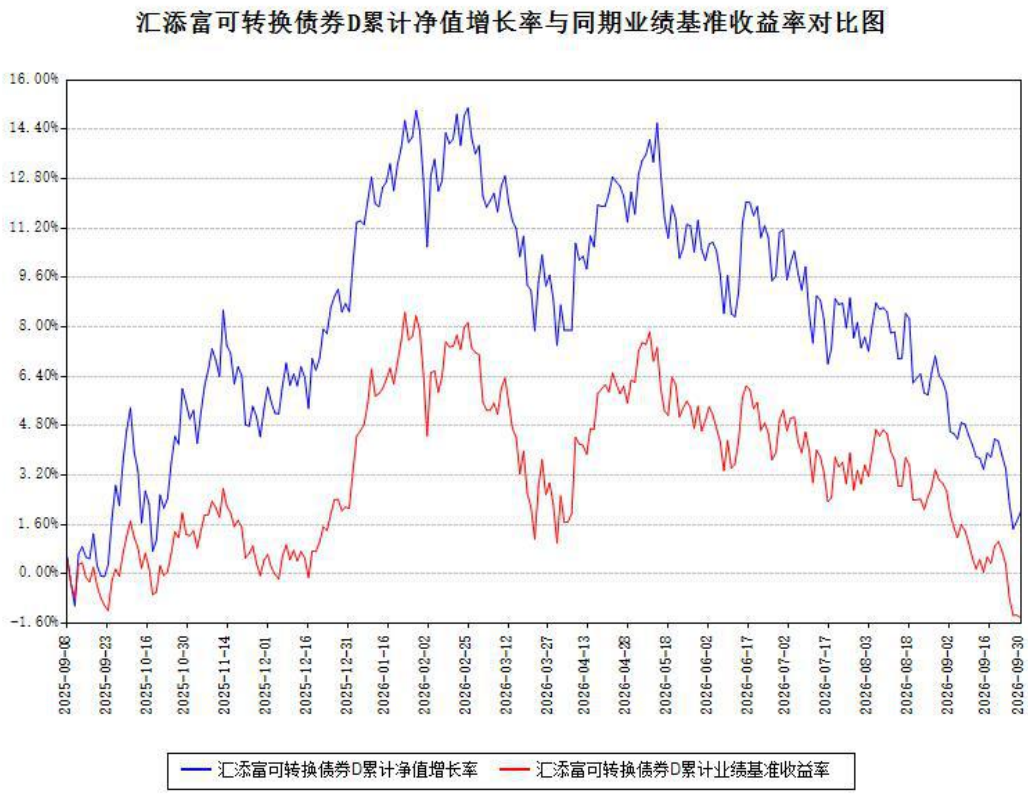
月						
过去一年	-2.54%	0.79%	-2.60%	0.64%	0.06%	0.15%
过去三年	24.81%	0.74%	14.45%	0.56%	10.36%	0.18%
过去五年	12.71%	0.76%	11.13%	0.52%	1.58%	0.24%
过去七年	60.29%	0.78%	33.19%	0.53%	27.10%	0.25%
过去十年	91.86%	0.76%	45.91%	0.53%	45.95%	0.23%
自基金合同生效起至今	174.38%	1.07%	51.53%	0.82%	122.85%	0.25%
汇添富可转换债券 C						
阶段	份额净值增长率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	-8.25%	0.68%	-6.08%	0.55%	-2.17%	0.13%
过去六个月	-5.21%	0.76%	-2.40%	0.63%	-2.81%	0.13%
过去一年	-2.93%	0.79%	-2.60%	0.64%	-0.33%	0.15%
过去三年	23.31%	0.74%	14.45%	0.56%	8.86%	0.18%
过去五年	10.48%	0.76%	11.13%	0.52%	-0.65%	0.24%
过去七年	55.91%	0.78%	33.19%	0.53%	22.72%	0.25%
过去十年	84.31%	0.76%	45.91%	0.53%	38.40%	0.23%
自基金合同生效起至今	158.53%	1.07%	51.53%	0.82%	107.00%	0.25%
汇添富可转换债券 D						
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	-8.16%	0.68%	-6.08%	0.55%	-2.08%	0.13%
过去六个月	-5.03%	0.76%	-2.40%	0.63%	-2.63%	0.13%
过去一年	-2.53%	0.79%	-2.60%	0.64%	0.07%	0.15%
自基金合同生效起至今	2.01%	0.80%	-1.41%	0.63%	3.42%	0.17%

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
222.00%
199.80%
177.60%
155.40%
133.20%
111.00%
88.80%
66.60%
44.40%
22.20%
0.00%
-22.20%
2011-06-17
2012-02-08
2012-09-18
2013-05-16
2014-01-03
2014-08-21
2015-04-16
2015-12-03
2016-07-22
2017-03-14
2017-10-31
2018-06-19
2019-01-29
2019-09-17
2020-05-14
2020-12-30
2021-08-19
2022-04-15
2022-12-05
2023-07-25
2024-03-14
2024-11-04
2025-06-25
2026-02-10
2026-09-30
汇添富可转换债券A累计净值增长率
汇添富可转换债券A累计业绩基准收益率

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
205.00%
184.50%
164.00%
143.50%
123.00%
102.50%
82.00%
61.50%
41.00%
20.50%
0.00%
-20.50%
2011-06-17
2012-02-08
2012-09-18
2013-05-16
2014-01-03
2014-08-21
2015-04-16
2015-12-03
2016-07-22
2017-03-14
2017-10-31
2018-06-19
2019-01-29
2019-09-17
2020-05-14
2020-12-30
2021-08-19
2022-04-15
2022-12-05
2023-07-25
2024-03-14
2024-11-04
2025-06-25
2026-02-10
2026-09-30
汇添富可转换债券C累计净值增长率
汇添富可转换债券C累计业绩基准收益率



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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2025 年 09 月 05 日新增 D 类份额。

§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	-	15	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 2026 年 4 月 21 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。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 2025 年 11 月 13 日

					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 2026 年 4 月 21 日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。2025 年 9 月 29 日至今任汇添富双盈回报一年持有期债券型

					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	-	12	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2026年1月20日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。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 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 2024 年 11 月 19 日任汇添富盈润

					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。2024 年 3 月 22 日至今任汇添富添添乐双鑫债券型证券投资基金的基金经理。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金经理。2025 年 7 月 23 日至今任汇添富增强回报债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月 25 日至今任汇添富稳颐优选债券型

					证券投资基金的基金经理。2026 年 2 月 12 日至今任汇添富增益回报债券型证券投资基金的基金经理。

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，力争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和流程，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中的公平交易模块，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%的次数为 0。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，中国经济延续 K 型分化，一方面，出口、高端制造、AI 相关产业链景气维持较强，对工业生产和企业盈利形成支撑；另一方面，居民端内生需求、地产链条及部分传统消费仍然偏弱。海外方面，10 年期美债利率一度突破 5.3%，创 2002 年以来新高，地缘冲突反复，成为影响市场的核心变量。

报告期内，股票市场主要指数普遍回调，成长和中小市值风格大幅走弱：上证综指-6.2%、沪深 300-12.5%，中证 500-17%，而创业板指-27.8%、科创 50-30.7%。资金从拥挤的科技板块流出，前期超跌的传统价值与资源资产逐步修复。分行业，煤炭、石油石化、银行和医药生物涨幅居前；而电子、通信、建筑材料和电力设备跌幅居前。

报告期内，转债市场跟随股市震荡回调，中证转债指数下跌 7.00%。转债估值仍整体高企、部分高景气行业转债估值存在明显泡沫，一旦强赎转债则会剧烈波动，保持谨慎判断。债券市场方面，报告期内延续低位震荡格局，收益率中枢较上半年进一步下移，长端和超长端表现相对较强，收益率曲线继续平坦化。

报告期内，组合转债仓位维持低位。在转债估值整体偏贵，且分化极致的背景下，组合通过超配高景气科技类股票，替代存在显著估值泡沫的转债，同时配置估值具备比较优势的转债予以应对。

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-8.16%，同期业绩比较基准收益率为-6.08%。本报告期汇添富可转换债券 C 类份额净值增长率为-8.25%，同期业绩比较基准收益率为-6.08%。本报告期汇添富可转换债券 D 类份额净值增长率为-8.16%，同期业绩比较基准收益率为-6.08%。

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	304,896,300.00	16.26
	其中：股票	304,896,300.00	16.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,550,737,627.25	82.69
	其中：债券	1,550,737,627.25	82.69
	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	12,576,429.30	0.67
8	其他资产	7,135,531.02	0.38
9	合计	1,875,345,887.57	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	55,607,000.00	3.02
C	制造业	249,289,300.00	13.53
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	304,896,300.00	16.54

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	601899	紫金矿业	1,300,000	38,727,000.00	2.10
2	300054	鼎龙股份	500,000	33,725,000.00	1.83
3	300308	中际旭创	40,000	32,337,600.00	1.75
4	300750	宁德时代	70,000	20,377,700.00	1.11
5	603067	振华股份	500,000	20,125,000.00	1.09
6	600519	贵州茅台	15,000	18,879,300.00	1.02
7	603993	洛阳钼业	1,000,000	16,880,000.00	0.92
8	688012	中微半导体设备	50,000	15,927,500.00	0.86
9	688627	精智达技术	37,000	15,643,600.00	0.85
10	300502	新易盛	40,000	15,560,000.00	0.84

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	121,038,838.36	6.57
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）	1,429,698,788.89	77.57
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,550,737,627.25	84.13

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	113062	常银转债	2,228,940	282,619,760.23	15.33
2	127045	牧原转债	1,434,000	169,156,997.27	9.18
3	127110	广核转债	1,045,392	142,731,179.00	7.74
4	019827	26 国债 01	1,200,000	121,038,838.36	6.57
5	113052	兴业转债	951,540	107,696,652.82	5.84

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，上海银行股份有限公司、兴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

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	383,719.25
2	应收证券清算款	6,508,003.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	243,808.52
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,135,531.02

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	113062	常银转债	282,619,760.23	15.33
2	127045	牧原转债	169,156,997.27	9.18
3	127110	广核转债	142,731,179.00	7.74
4	113052	兴业转债	107,696,652.82	5.84
5	113682	益丰转债	94,773,873.97	5.14
6	113696	伯 25 转债	63,214,963.32	3.43
7	118024	冠宇转债	51,818,787.14	2.81
8	113666	爱玛转债	40,636,872.10	2.20
9	113042	上银转债	39,582,531.97	2.15
10	113059	福莱转债	31,381,737.53	1.70
11	118058	微导转债	24,923,269.48	1.35
12	113615	金诚转债	24,361,080.37	1.32
13	128136	立讯转债	23,824,975.34	1.29
14	111004	明新转债	23,764,265.75	1.29
15	113067	燃 23 转债	23,402,981.92	1.27
16	127084	柳工转 2	22,864,673.97	1.24
17	127089	晶澳转债	20,555,383.56	1.12
18	113655	欧 22 转债	20,377,029.04	1.11
19	110085	通 22 转债	20,301,120.00	1.10
20	113661	福 22 转债	19,333,356.17	1.05
21	113652	伟 22 转债	19,256,017.53	1.04

22	127056	中特转债	18,150,673.97	0.98
23	113616	韦尔转债	13,507,080.32	0.73
24	113636	甬金转债	13,196,760.00	0.72
25	118034	晶能转债	11,568,917.81	0.63
26	127050	麒麟转债	9,508,659.73	0.52
27	123165	回天转债	9,399,718.60	0.51
28	123253	永贵转债	8,925,496.71	0.48
29	118015	芯海转债	7,815,700.60	0.42
30	123178	花园转债	6,977,856.16	0.38
31	111017	蓝天转债	6,356,726.03	0.34
32	118022	锂科转债	5,829,856.16	0.32
33	132026	G 三峡 EB2	5,462,269.59	0.30
34	113058	友发转债	5,072,394.52	0.28
35	113681	镇洋转债	4,094,518.36	0.22
36	110086	精工转债	3,620,373.70	0.20
37	123124	晶瑞转 2	3,426,777.06	0.19
38	113638	台 21 转债	3,282,283.64	0.18
39	110081	闻泰转债	3,041,547.95	0.17
40	113650	博 22 转债	1,819,489.97	0.10
41	113049	长汽转债	1,291,266.87	0.07
42	123250	嘉益转债	1,282,020.50	0.07
43	123216	科顺转债	373.80	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	汇添富可转换债券 D

本报告期期初基金份额总额	659,023,236.50	297,016,083.36	33,524,756.08
本报告期基金总申购份额	14,477,514.77	10,451,049.55	5,962,294.98
减：本报告期基金总赎回份额	129,187,283.14	26,664,348.19	12,919,231.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	544,313,468.13	280,802,784.72	26,567,819.32

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

2026 年 10 月 27 日