

汇添富可转换债券债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 03 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：2021 年 04 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 2021 年 4 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 01 月 01 日起至 2021 年 03 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)	3,736,671,631.82
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
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)	3,070,207,110.27	666,464,521.55

§ 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 01 月 01 日 - 2021 年 03 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	414,897,253.82	81,652,629.93
2. 本期利润	46,263,566.31	-907,384.09
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0136	-0.0012
4. 期末基金资产净值	5,460,832,756.18	1,134,945,370.52
5. 期末基金份额净值	1.779	1.703

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	-0.34%	1.05%	-0.53%	0.57%	0.19%	0.48%

个月						
过去六个月	3.67%	0.87%	2.62%	0.51%	1.05%	0.36%
过去一年	18.84%	0.89%	6.35%	0.58%	12.49%	0.31%
过去三年	44.87%	0.83%	21.29%	0.59%	23.58%	0.24%
过去五年	56.04%	0.74%	22.03%	0.53%	34.01%	0.21%
自基金合同生效日起至今	120.84%	1.22%	26.75%	0.95%	94.09%	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	-0.41%	1.05%	-0.53%	0.57%	0.12%	0.48%
过去六个月	3.46%	0.87%	2.62%	0.51%	0.84%	0.36%
过去一年	18.35%	0.89%	6.35%	0.58%	12.00%	0.31%
过去三年	43.06%	0.83%	21.29%	0.59%	21.77%	0.24%
过去五年	52.87%	0.74%	22.03%	0.53%	30.84%	0.21%
自基金合同生效日起至今	112.65%	1.22%	26.75%	0.95%	85.90%	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，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 日至今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 日至今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。
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 日至今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 日至今任汇添富熙
--	--	--	--	--	--

					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嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司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、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

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，本公司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 9 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，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

2021 年一季度国内经济延续复苏态势，生产、消费、投资表现向好，经济整体景气度处于较高水平，与此同时工业品价格出现了明显上涨，PPI 在年初转正之后快速拉升，通胀压力开始显现；货币政策方面，在“不急转弯”的基调下总体维持相对中性，信用方面社融下行的态势已经较为明朗。

一季度股票市场大幅波动。春节前，以消费、医药和新能源汽车等为代表的核心资产在资金推动下快速上涨。春节后，受美债收益率大幅上行及国内货币边际收紧预期影响，估值较高的核心资产出现系统性快速下跌，而以银行、钢铁、化工等为代表低估值资产相对收益

明显。一季度可转债表现强于股票，春节后低估值转债估值修复明显。

报告期内，随着转债估值的回落，组合可转债仓位有所提高。组合管理上，坚持自下而上挑选基本面相对优质的可转债。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，行业相对分散。

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-0.34%;C 类基金份额净值增长率为-0.41%。同期业绩比较基准收益率为-0.53%。

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	1,172,129,846.47	16.76
	其中：股票	1,172,129,846.47	16.76
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	5,594,945,235.83	80.02
	其中：债券	5,594,945,235.83	80.02
	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	121,651,989.68	1.74
8	其他资产	103,561,582.76	1.48
9	合计	6,992,288,654.74	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	100,030,000.00	1.52
B	采矿业	—	—
C	制造业	835,929,386.47	12.67
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	75,041,000.00	1.14
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	85,800,000.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	75,329,460.00	1.14
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	1,172,129,846.47	17.77

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 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	80,000	160,720,000.00	2.44
2	000858	五粮液	393,900	105,557,322.00	1.60
3	002714	牧原股份	1,000,000	100,030,000.00	1.52
4	002415	海康威视	1,580,000	88,322,000.00	1.34
5	300124	汇川技术	900,000	76,959,000.00	1.17
6	601888	中国中免	250,000	76,520,000.00	1.16
7	603259	药明康德	537,300	75,329,460.00	1.14
8	300760	迈瑞医疗	184,117	73,482,935.87	1.11
9	300274	阳光电源	1,016,100	72,935,658.00	1.11
10	000538	云南白药	600,000	72,306,000.00	1.10

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	349,527,308.90	5.30
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）	5,245,417,926.93	79.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,594,945,235.83	84.83

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	2,501,060	305,329,404.80	4.63
2	113011	光大转债	2,007,740	244,743,506.00	3.71
3	113043	财通转债	1,740,320	189,486,041.60	2.87
4	019640	20 国债 10	1,818,710	181,798,251.60	2.76
5	110059	浦发转债	1,722,180	176,867,886.00	2.68

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

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	1,415,581.30
2	应收证券清算款	67,221,118.96
3	应收股利	—
4	应收利息	12,463,157.17
5	应收申购款	22,461,725.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	103,561,582.76

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	305,329,404.80	4.63
2	113011	光大转债	244,743,506.00	3.71
3	110059	浦发转债	176,867,886.00	2.68
4	110051	中天转债	155,328,962.40	2.35
5	113602	景 20 转债	131,768,553.50	2.00
6	113014	林洋转债	119,469,148.50	1.81
7	127005	长证转债	114,730,000.00	1.74
8	113508	新凤转债	95,153,544.20	1.44
9	128017	金禾转债	88,582,281.42	1.34
10	123035	利德转债	86,579,389.44	1.31
11	128035	大族转债	81,442,615.45	1.23
12	110062	烽火转债	80,512,017.60	1.22
13	128121	宏川转债	72,164,934.17	1.09
14	127006	敖东转债	69,012,404.60	1.05
15	110045	海澜转债	66,093,083.20	1.00
16	128114	正邦转债	65,318,024.25	0.99
17	127016	鲁泰转债	57,426,575.22	0.87
18	113596	城地转债	54,339,533.80	0.82
19	113599	嘉友转债	54,252,153.90	0.82
20	110073	国投转债	52,505,000.00	0.80
21	128131	崇达转 2	49,789,949.26	0.75
22	123058	欣旺转债	48,944,285.61	0.74
23	128064	司尔转债	48,418,919.64	0.73
24	113543	欧派转债	46,739,042.20	0.71
25	127011	中鼎转 2	44,352,836.44	0.67

26	128125	华阳转债	42,776,264.08	0.65
27	127020	中金转债	37,936,500.00	0.58
28	110056	亨通转债	36,440,447.40	0.55
29	128133	奇正转债	36,025,500.00	0.55
30	123064	万孚转债	35,894,618.36	0.54
31	113579	健友转债	35,620,621.30	0.54
32	127012	招路转债	35,206,129.40	0.53
33	113603	东缆转债	35,155,795.20	0.53
34	127017	万青转债	34,842,000.00	0.53
35	113013	国君转债	33,306,000.00	0.50
36	110069	瀚蓝转债	32,889,593.70	0.50
37	128126	赣锋转 2	32,466,000.00	0.49
38	123056	雪榕转债	30,803,917.80	0.47
39	128108	蓝帆转债	28,156,225.00	0.43
40	113012	骆驼转债	25,666,459.20	0.39
41	127013	创维转债	25,180,416.00	0.38
42	128101	联创转债	24,748,321.72	0.38
43	123050	聚飞转债	23,685,041.48	0.36
44	113584	家悦转债	23,015,695.50	0.35
45	123053	宝通转债	22,886,252.62	0.35
46	110067	华安转债	21,804,000.00	0.33
47	113597	佳力转债	19,955,151.90	0.30
48	113542	好客转债	17,646,621.30	0.27
49	128029	太阳转债	17,480,547.00	0.27
50	128032	双环转债	17,183,275.08	0.26
51	113600	新星转债	14,139,000.00	0.21
52	113589	天创转债	10,402,203.60	0.16
53	128042	凯中转债	9,219,545.40	0.14
54	128132	交建转债	9,133,106.40	0.14

55	110055	伊力转债	3,138,652.50	0.05
56	110053	苏银转债	277,340.40	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
本报告期期初基金份额总额	3,846,786,726.38	995,754,699.05
本报告期基金总申购份额	1,923,349,512.89	437,985,098.89
减：本报告期基金总赎回份额	2,699,929,129.00	767,275,276.39
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	3,070,207,110.27	666,464,521.55

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指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

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 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

2021 年 04 月 22 日