汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）
2019年半年度报告摘要

2019年6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：2019年8月29日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富纯债（LOF）
场内简称	添富纯债
基金主代码	164703
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 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
报告期末基金份额总额	2,553,301,973.33 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 4 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理，力争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，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略、可转债投资策略等。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。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，混合基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	36,438,849.81
本期利润	49,775,529.67
加权平均基金份额本期利润	0.0194
本期基金份额净值增长率	2.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1946
期末基金资产净值	2,231,730,414.03
期末基金份额净值	0.874

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、上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(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

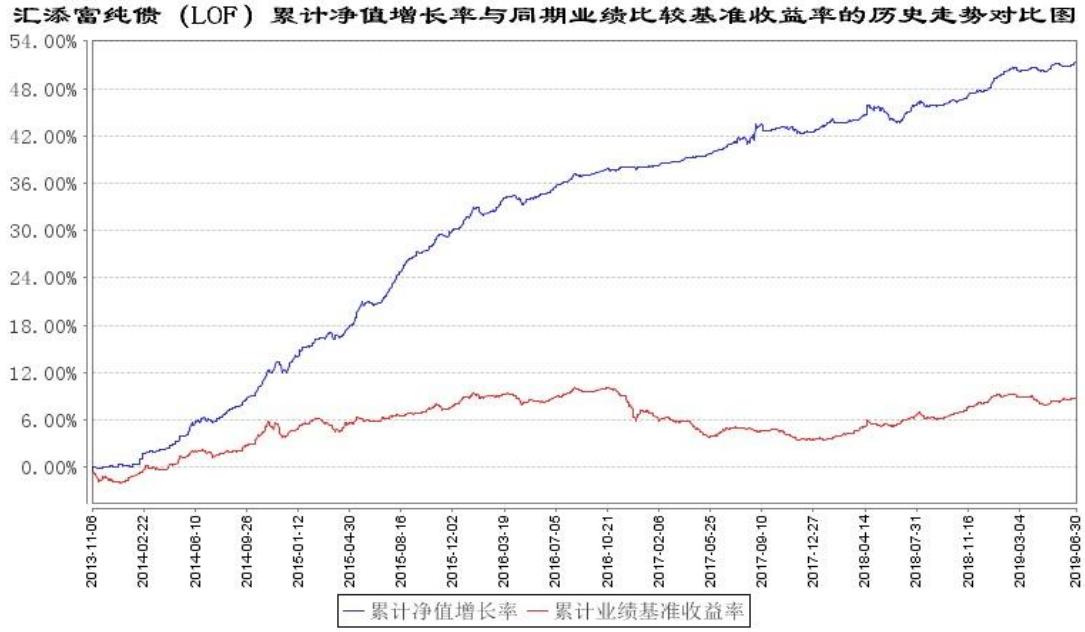
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.23%	0.05%	0.28%	0.03%	-0.05%	0.02%
过去三个月	0.46%	0.07%	-0.24%	0.06%	0.70%	0.01%
过去六个月	2.22%	0.07%	0.24%	0.06%	1.98%	0.01%
过去一年	5.05%	0.07%	2.82%	0.06%	2.23%	0.01%
过去三年	11.94%	0.09%	0.03%	0.08%	11.91%	0.01%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

自基金合同生效日起至今	51.36%	0.11%	8.76%	0.09%	42.60%	0.02%

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



注:自 2016 年 11 月 04 日起，汇添富互利分级债券型证券投资基金转型为汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF），本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 06 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2019 上半年，汇添富基金新成立 13 只公开募集证券投资基金，包括 5 只债券型基金、4 只混合型基金、2 只基金中基金、2 只指数基金联接基金。截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 133 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金、汇添富鑫瑞债券基金、添富年年泰定开混合基金、添富鑫泽定开债基金的基金经理，总经理助理、固定收益投资总监。	2013年11月6日	-	17	国籍：中国。学历：华东师范大学金融学博士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历：曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任总经理助理、固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理，2009 年 1 月 21 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富货币基金的基金经理，2011 年 1 月 26 日至 2013 年 2 月 7 日任汇添富保本混合基金的基金经理，2012 年 7 月 26 日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富纯债(LOF)基金（原汇添富互利分级债券基金）的基金经理，

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富全额宝货币基金的基金经理，2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快线货币基金的基金经理，2014年12月23日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理，2016年12月26日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理，2017年4月14日至今任添富年年泰定开混合基金的基金经理，2018年3月8日至今任添富鑫泽定开债基金的基金经理。
胡娜	添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、添富民安增益定开混合基金、添富鑫盛定开债基金、汇添富纯债（LOF）基金的基金经理。	2018年7月6日	-	10	国籍：中国。学历：西南财经大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009年至2012年期间任职于华泰联合证券固定收益部，担任自营交易员职务；2012年11月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员、基金经理助理职务，自2015年1月29日至2016年10月18日任银华增强收益债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金和银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理。2015年5月14日至

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					2016年10月18日任银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月21日至2016年10月18日任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司任投资经理。2017年4月25日至2017年7月2日任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理助理，2017年7月3日至今任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理，2018年2月13日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理，2018年4月16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理，2018年7月6日至今任汇添富纯债（LOF）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“离职日期”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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《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，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内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总成交量 5%的交易次数为 5 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，全球经济共振回落，美国经济数据下滑明显，减税刺激消退叠加贸易摩擦反复，美国制造业与消费均呈现颓势。中国经济上半年呈现前高后低的态势，中采制造业 PMI 跌至荣枯线以下，工业增加值明显回落。企业盈利继续下滑，制造业投资下滑，地产基建托底经济，但随着房地产融资收紧，销售和开工将面临下滑，地产周期处于下行阶段。另一方面，地方专项债可作为项目资金本，预计未来地方债发行额度有所提升，基建投资有望继续企稳回升，但基建仍是托底，在管控新增地方债务的背景下，难以扭转经济的下滑趋势，下半年经济仍面临较大的

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

下行压力。

上半年，债券收益率整体小幅震荡。10 年国债上行 5bp，10 年国开基本持平，3 年 AAA 中票下行 9bp，5 年 AAA 中票持平，3 年 AA+中票下行 15bp，5 年 AA+中票下行 4bp。上半年股市全面上涨，上证综指上涨 19.45%，深圳成指上涨 26.78%，创业板上涨 20.87%，中小板指上涨 20.75%。

上半年本基金根据行情预判和基金的流动性要求，继续对组合结构进行了调整，并对利率债进行了波动交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.874 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.22%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，主要经济体货币政策转向宽松，国内经济面临下滑压力，基本面对债市形成支撑。政策层面，二季度货币政策例会表明，当前海外不确定性增加，货币政策需适时适度实施逆周期调节，外部环境的变化有利于货币政策保持宽松，流动性维持充裕，而防范化解重大风险特别是金融风险仍是重中之重，预计相关措施仍将渐进式推进，风险处置的过程也需要货币政策的保驾护航。

策略上，维持灵活的久期和杠杆，积极参与利率债的波段交易。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12　次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	479,735.36	3,225,953.00
结算备付金	26,004.92	3,220,454.55
存出保证金	-	3,939.73
交易性金融资产	2,508,009,000.00	2,587,078,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,508,009,000.00	2,587,078,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	49,952,758.41	23,019,702.65
应收股利	-	-
应收申购款	10,482.99	257,926.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,558,477,981.68	2,616,805,976.77
负债和所有者权益	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	325,479,192.53	434,954,587.57
应付证券清算款	123.29	-
应付赎回款	52,925.54	44,066.44
应付管理人报酬	549,137.68	552,869.55
应付托管费	183,045.89	184,289.85
应付销售服务费	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

应付交易费用	21,529.26	35,282.56
应交税费	-	-
应付利息	202,340.92	672,900.16
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	259,272.54	260,000.00
负债合计	326,747,567.65	436,703,996.13
所有者权益：		
实收基金	1,692,585,356.48	1,691,112,315.44
未分配利润	539,145,057.55	488,989,665.20
所有者权益合计	2,231,730,414.03	2,180,101,980.64
负债和所有者权益总计	2,558,477,981.68	2,616,805,976.77

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.874 元，基金份额总额 2,553,301,973.33 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	59,846,749.02	1,950,292.82
1.利息收入	44,163,877.77	1,368,419.60
其中：存款利息收入	20,317.31	26,362.49
债券利息收入	44,143,560.46	1,319,445.11
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	22,612.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,331,053.65	-100,524.27
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,331,053.65	-100,524.27
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	13,336,679.86	681,871.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	15,137.74	525.92
减：二、费用	10,071,219.35	474,648.77

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1．管理人报酬	3,307,053.70	117,778.31
2．托管费	1,102,351.27	39,259.49
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	8,425.00	5,920.74
5．利息支出	5,490,218.27	100,771.38
其中：卖出回购金融资产支出	5,490,218.27	100,771.38
6．税金及附加	-	3,043.89
7．其他费用	163,171.11	207,874.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	49,775,529.67	1,475,644.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,691,112,315.44	488,989,665.20	2,180,101,980.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,775,529.67	49,775,529.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,473,041.04	379,862.68	1,852,903.72
其中：1.基金申购款	19,403,349.29	5,975,854.79	25,379,204.08
2.基金赎回款	-17,930,308.25	-5,595,992.11	-23,526,300.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,692,585,356.48	539,145,057.55	2,231,730,414.03
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	252,193,491.73	61,055,345.69	313,248,837.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,475,644.05	1,475,644.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-210,471,717.24	-51,910,977.98	-262,382,695.22
其中：1.基金申购款	5,165,547.35	1,330,913.71	6,496,461.06
2.基金赎回款	-215,637,264.59	-53,241,891.69	-268,879,156.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	41,721,774.49	10,620,011.76	52,341,786.25

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），原汇添富互利分级债券型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]641 号文《关于核准汇添富互利分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2013 年 11 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 684,640,965.82 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《汇添富互利分级债券型证券投资基金基金合同》的规定，汇添富互利分级债券型证券

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

投资基金的 3 年分级运作期届满后，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）”。于 2016 年 11 月 4 日，即基金合同生效之日起三年，投资者认/申购或通过上市交易购买并持有到期的每一份 A 类基金和 B 类基金，已按照基金合同约定的资产及收益的计算规则分别计算 A 类基金和 B 类基金的基金份额净值，并以各自的份额净值为基础，转换为本基金份额。本基金于 2016 年 12 月 2 日于深圳证券交易所上市交易。

本基金的投资范围为固定收益类品种，国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款），以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证，也不参与一级市场新股申购。因持有可转债转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，应当在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。在严格控制风险的基础上，本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理，力争实现资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1　印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2　增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3　城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4　企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5　个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券股份有限公司	-	-	237,569,631.64	100.00

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
东方证券股份有限公司	11,800,000.00	100.00	600,000,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,307,053.70	117,778.31
其中：支付销售机构的客户维护费	9,544.24	12,498.08

注:自 2013 年 11 月 6 日（基金合同生效日）至 2017 年 5 月 8 日前，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70%年费率计提；于 2017 年 5 月 8 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×R/当年天数

H　为每日应计提的基金管理费

E　为前一日的基金资产净值

R　为基金管理费年费率

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,102,351.27	39,259.49

注:自 2013 年 11 月 6 日（基金合同生效日）至 2017 年 5 月 8 日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%年费率计提；于2017年5月8日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×R/当年天数

H　为每日应计提的基金托管费

E　为前一日的基金资产净值

R　为基金托管费年费率

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	479,735.36	19,029.13	4,111,210.43	20,295.54

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为 324,979,192.53 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180202	18 国开 02	2019 年 7 月 2 日	101.12	100,000	10,112,000.00
180209	18 国开 09	2019 年 7 月 2 日	100.03	400,000	40,012,000.00
180211	18 国开 11	2019 年 7 月 2 日	101.20	500,000	50,600,000.00
180312	18 进出 12	2019 年 7 月 2 日	100.16	700,000	70,112,000.00
1820068	18 南京银行 03	2019 年 7 月 2 日	101.33	684,000	69,309,720.00
190205	19 国开 05	2019 年 7 月 2 日	97.95	500,000	48,975,000.00
190303	19 进出 03	2019 年 7 月 2 日	99.29	500,000	49,645,000.00
合计				3,384,000	338,765,720.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 500,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	2,508,009,000.00	98.03
	其中：债券	2,508,009,000.00	98.03
	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	505,740.28	0.02
8	其他各项资产	49,963,241.40	1.95
9	合计	2,558,477,981.68	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.2 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股票投资。

7.3 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注:本基金本报告期未持有股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注:本基金本报告期未持有股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期未投资股票。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,508,009,000.00	112.38
	其中：政策性金融债	269,456,000.00	12.07
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,508,009,000.00	112.38

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1828016	18 民生银行 01	2,000,000	202,180,000.00	9.06
2	1820077	18 温州银行	2,000,000	200,640,000.00	8.99
3	1820063	18 齐鲁银行绿色金融 01	1,600,000	161,840,000.00	7.25
4	1828005	18 浙商银行 01	1,400,000	143,262,000.00	6.42
5	1820070	18 重庆银行绿色金融 02	1,400,000	141,204,000.00	6.33

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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、证券交易所立

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,952,758.41
5	应收申购款	10,482.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,963,241.40

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 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投资。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
3,726	685,266.23	2,524,605,405.00	98.88	28,696,568.33	1.12

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	1,366,230.00	29.10
2	陈纳新	842,964.00	17.95
3	中国太平保险集团有限责任公司企业年金计划-中国建设银行股	613,242.00	13.06

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	份有限公司		
4	黄贤民	320,184.00	6.82
5	武耀华	282,895.00	6.02
6	太平养老金溢丰债券型养老金产品-中国工商银行股份有限公司	229,003.00	4.88
7	何惠莲	152,668.00	3.25
8	宋熙彬	83,968.00	1.79
9	朱芳	61,067.00	1.30
10	徐兆炎	51,883.00	1.10

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	27,296.79	0.0011

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 11 月 6 日）基金份额总额	684,640,965.80
本报告期期初基金份额总额	2,551,079,560.24
本报告期基金总申购份额	29,269,869.58
减：本报告期基金总赎回份额	27,047,456.49
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,553,301,973.33

注:总申购份额含红利再投份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	3	-	-	-	-	-

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	11,800,000.00	100.00%	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

（8）按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn