

# 汇添富精选美元债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 06 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。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、净值表现和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。

本半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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                   |                    |                    |
|-----------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| 基金简称            | 汇添富精选美元债债券(QDII)  |                   |                    |                    |
| 基金主代码           | 004419            |                   |                    |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                   |                    |                    |
| 基金合同生效日         | 2017年4月20日        |                   |                    |                    |
| 基金管理人           | 汇添富基金管理股份有限公司     |                   |                    |                    |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司        |                   |                    |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 70,003,559.74份    |                   |                    |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                   |                    |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇添富美元债券(QDII)人民币A | 汇添富美元债券(QDII)人民币C | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇A | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇C |
| 下属分级基金的交易代码     | 004419            | 004420            | 004421             | 004422             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 53,004,529.93     | 16,158,208.22     | 617,547.17         | 223,274.42         |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 基金主要投资于全球以美元计价的债券，通过自上而下和自下而上相结合的方式，对组合资产配置及个券选择进行合理布局，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期的稳定增值。   |
| 投资策略   | 本基金将密切关注全球美元债市场的运行状况与风险收益特征，分析全球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国家/地区配置策略、类属资产配置策略、利率类品种投资策略、信用债投资策略等。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 | iBoxx 美元债总回报指数(iBoxx USD Overall Total Return Index)收益率×95%+商业银行活期存款基准利率(税后)×5%   |
| 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，其预期风险及预期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。 |
|--|---------------|

## 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      | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                 | 王永民                  |
|             | 联系电话 | 021-28932888       | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918       | 95566                |
| 传真          |      | 021-28932998       | 010-66594942         |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人                           |
|------|----|-----------------------------------|
| 名称   | 中文 | 中国银行（香港）有限公司                      |
|      | 英文 | Bank of China (Hong Kong) Limited |
| 注册地址 |    | 香港中环花园道1号中银大厦                     |
| 办公地址 |    | 香港中环花园道1号中银大厦                     |

注：本基金无境外投资顾问。

## 2.5 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 |

## § 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<br>期间数<br>据和指<br>标 | 2019年01月01日<br>至2019年06月30<br>日 | 2019年01月01日<br>至2019年06月30<br>日 | 2019年01月01日<br>至2019年06月30<br>日 | 2019年01月01日<br>至2019年06月30<br>日 |
|--------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                          | 汇添富美元债券<br>(QDII) 人民币 A         | 汇添富美元债券<br>(QDII) 人民币 C         | 汇添富美元债券<br>(QDII) 美元现汇 A        | 汇添富美元债券<br>(QDII) 美元现汇 C        |
| 本期已                      | 1,335,212.47                    | 230,715.09                      | 98,930.80                       | 35,502.92                       |

|               |                   |                   |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 实现收益          |                   |                   |                   |                   |
| 本期利润          | 3,621,645.77      | 600,762.23        | 261,450.54        | 99,698.83         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0654            | 0.0585            | 0.4697            | 0.4501            |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.83%             | 6.59%             | 6.62%             | 6.37%             |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年06月30日) | 报告期末(2019年06月30日) | 报告期末(2019年06月30日) | 报告期末(2019年06月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0744           | -0.0784           | -0.4390           | -1.3057           |
| 期末基金资产净值      | 57,142,522.71     | 17,339,957.72     | 4,576,313.79      | 1,638,310.89      |
| 期末基金份额净值      | 1.0781            | 1.0731            | 1.0779            | 1.0673            |

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、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

汇添富美元债券（QDII）人民币 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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      | 0.05%  | 0.13% | 1.40% | 0.19% | -1.35% | -0.06% |
| 过去三个月      | 2.61%  | 0.14% | 3.33% | 0.18% | -0.72% | -0.04% |
| 过去六个月      | 6.83%  | 0.22% | 6.47% | 0.18% | 0.36%  | 0.04%  |
| 过去一年       | 10.90% | 0.26% | 8.12% | 0.17% | 2.78%  | 0.09%  |
| 自基金合同生效起至今 | 7.81%  | 0.22% | 7.96% | 0.17% | -0.15% | 0.05%  |

汇添富美元债券(QDII)人民币C

| 阶段    | 净值增长率① | 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 | 0.01%  | 0.13%     | 1.40%      | 0.19%         | -1.39% | -0.06% |
| 过去三个月 | 2.52%  | 0.14%     | 3.33%      | 0.18%         | -0.81% | -0.04% |

|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去六个月      | 6.59%  | 0.21% | 6.47% | 0.18% | 0.12%  | 0.03% |
| 过去一年       | 10.78% | 0.26% | 8.12% | 0.17% | 2.66%  | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.31%  | 0.22% | 7.96% | 0.17% | -0.65% | 0.05% |

汇添富美元债券（QDII）美元现汇 A

| 阶段    | 净值增长率① | 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 | 0.39%  | 0.06%     | 1.40%      | 0.19%         | -1.01% | -0.13% |
| 过去三个月 | 0.49%  | 0.06%     | 3.33%      | 0.18%         | -2.84% | -0.12% |
| 过去六个月 | 6.62%  | 0.14%     | 6.47%      | 0.18%         | 0.15%  | -0.04% |
| 过去一年  | 6.77%  | 0.17%     | 8.12%      | 0.17%         | -1.35% | 0.00%  |

|            |       |       |       |       |        |        |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 7.79% | 0.13% | 7.96% | 0.17% | -0.17% | -0.04% |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|

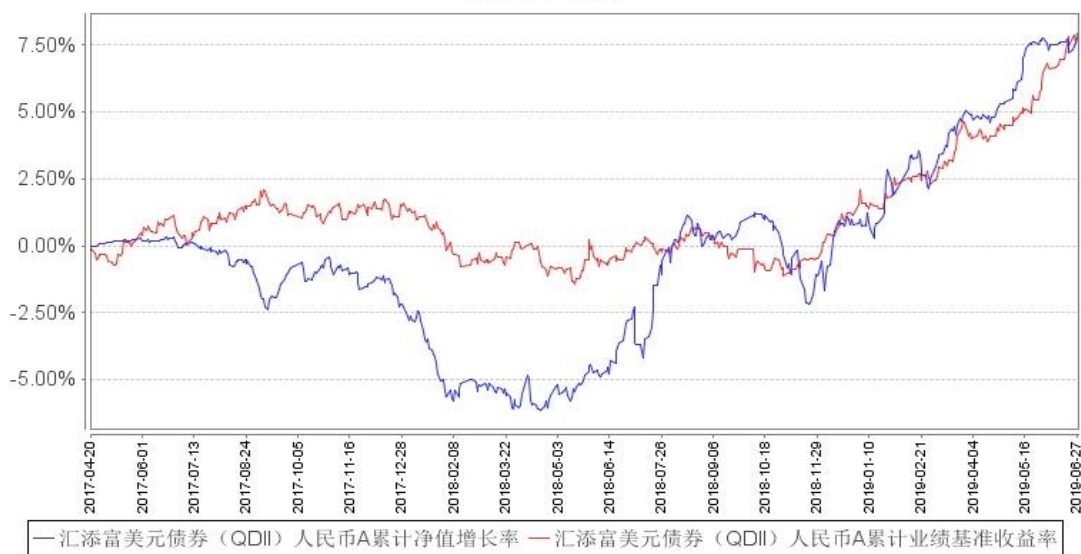
汇添富美元债券(QDII)美元现汇C

| 阶段         | 净值增长率① | 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      | 0.36%  | 0.06%     | 1.40%      | 0.19%         | -1.04% | -0.13% |
| 过去三个月      | 0.36%  | 0.06%     | 3.33%      | 0.18%         | -2.97% | -0.12% |
| 过去六个月      | 6.37%  | 0.14%     | 6.47%      | 0.18%         | -0.10% | -0.04% |
| 过去一年       | 6.19%  | 0.17%     | 8.12%      | 0.17%         | -1.93% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 6.73%  | 0.13%     | 7.96%      | 0.17%         | -1.23% | -0.04% |

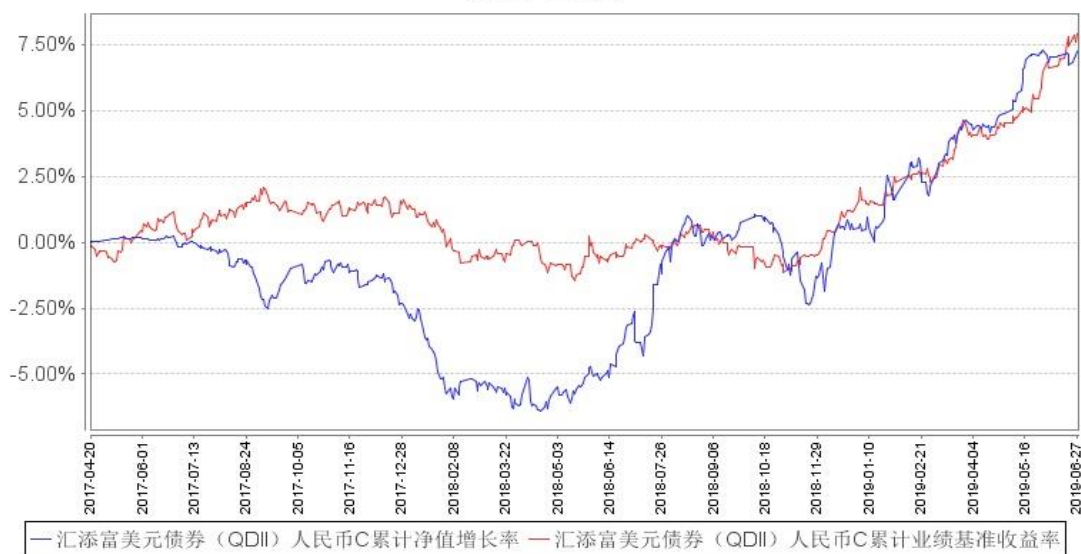
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



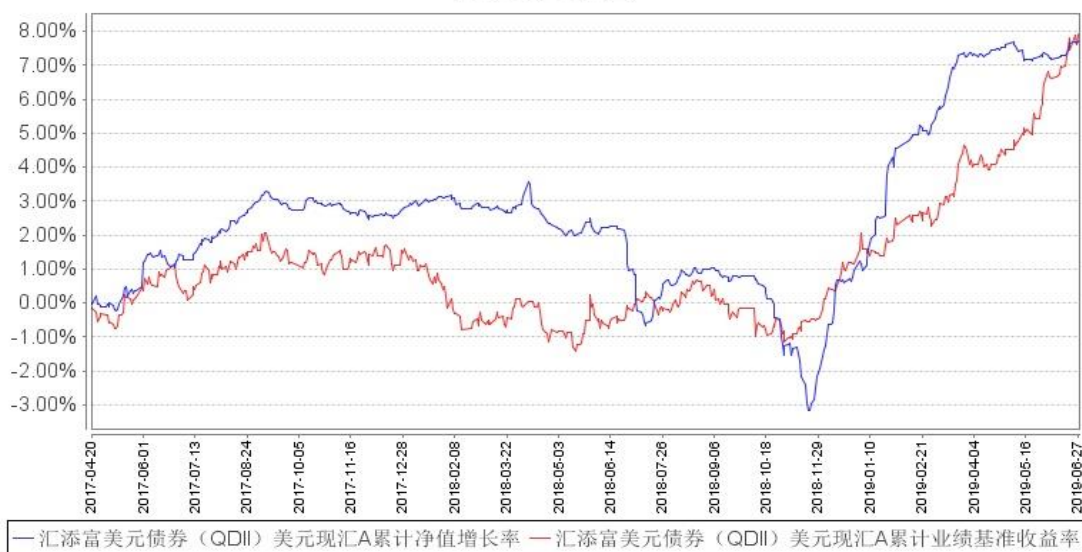
汇添富美元债券（QDII）人民币A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



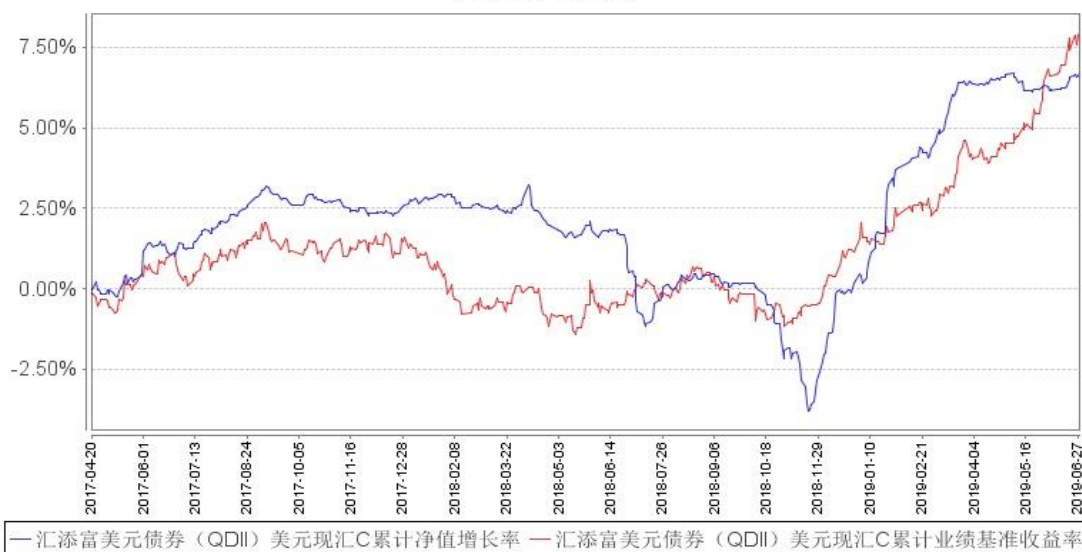
汇添富美元债券（QDII）人民币C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富美元债券（QDII）美元现汇A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富美元债券（QDII）美元现汇C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年4月20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 |        |   |
| 何旻 | 汇添富安心中国债券基金、汇添富 6 月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫混合（原汇添富盈鑫保本混合基金）、汇添富美元债券（QDII）基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安 | 2017 年 4 月 20 日 |      | 21 年   | 国籍：中国。学历：英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格：基金从业资格、特许金融分析师（CFA），财务风险经理（FRM）。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | <p>混合基金、添富3年封闭配售混合(LOF)基金、添富中债1-3年国开债基金、汇添富中债1-3年农发债基金的基金经理。</p> |  |  |  | <p>综合研究小组负责人、基金经理助理，固定收益部负责人；金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理，2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理，2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理，2008</p> |
|--|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>年 9 月 3 日至 2009 年 3 月 10 日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理，2009 年 3 月 29 日至 2010 年 12 月 29 日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011 年 1 月加入汇添富资产管理（香港）有限公司，2012 年 2 月 17 日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2013 年 11 月 22 日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理，2014 年 1 月 21 日至今任汇添</p> |
|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>富 6 月红<br/>定期开放<br/>债券基金<br/>(原汇添<br/>富信用债<br/>债券基金)<br/>的基金经<br/>理, 2016 年 3<br/>月 11 日至<br/>今任汇添<br/>富盈鑫混<br/>合(原汇<br/>添富盈鑫<br/>保本混<br/>合)基金<br/>的基金经<br/>理, 2017<br/>年 4 月 20<br/>日至今任<br/>汇添富美<br/>元债债券<br/>(QDII)<br/>基金的基<br/>金经理,<br/>2017 年 7<br/>月 24 日至<br/>今任添富<br/>添福吉祥<br/>混合基金<br/>的基金经<br/>理, 2017<br/>年 9 月 6<br/>日至今任<br/>添富盈润<br/>混合基金<br/>的基金经<br/>理, 2017<br/>年 9 月 29<br/>日至今任<br/>汇添富弘<br/>安混合基<br/>金的基金<br/>经理, 2018 年 7</p> |
|--|--|--|--|--|

|    |                                 |                        |  |             |  |
|----|---------------------------------|------------------------|--|-------------|--|
|    |                                 |                        |  |             | <p>月 5 日至今任添富 3 年封闭配售混合 (LOF) 基金的基金经理，2019 年 4 月 15 日至今任添富中债 1-3 年国开债基金的基金经理，2019 年 6 月 19 日至今任汇添富中债 1-3 年农发债基金的基金经理。</p>  |
| 高欣 | <p>汇添富美元债债券 (QDII) 基金的基金经理。</p> | <p>2017 年 4 月 20 日</p> |  | <p>10 年</p> | <p>国籍：中国香港；<br/>                     学历：香港大学经济学硕士，香港中文大学电子工程学哲学硕士；<br/>                     相关业务资格：基金从业资格；<br/>                     从业经历：曾任泰康资产管理（香港）有限公司助理投资经理，广发资产管理（香港）</p> |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>有限公司高级分析师。2012年10月加入汇添富资产管理（香港）有限公司，2013年9月2日至今任汇添富港币债券基金（香港公募基金）的基金经理，2017年3月27日至今任汇添富精选美元债券基金（香港公募基金）的基金经理，2017年4月20日至今任汇添富美元债券（QDII）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。

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。



### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，美债利率继续震荡回落，美国 10 年期国债收益率单季度下行 42bp。主要因市场

对于美国经济基本面走弱的一致预期，美国收益率曲线出现长短倒挂，引发市场对经济衰退更深的担忧。数据上看，美国居民消费走弱，代表支撑美国经济增长的动能在消退；加上美联储继续保持鸽派的货币政策，市场对于美联储的降息预期持续升温，美债的收益率大概率仍将继续下行。

中美贸易战仍然处于乐观阶段，双方达成和谈的可能性正在增加，不过我们认为中美的拉锯战将会走向常态化，因贸易战的本质冲突来源于中美两国意识形态和中国崛起带来的两大国利益矛盾显像化，尽管短期达成一致可能性很大，不过未来仍然有出现阶段性矛盾的可能，两国矛盾的常态化对市场的影响在边际减弱。

外汇方面，2 季度人民币对美元震荡贬值，脱离 6.7 区间进入 6.8 区间震荡，随着美国经济下行的兑现和美联储货币政策的转向正在积累美元下跌的力量，人民币大概率会继续保持稳定。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，汇添富美元债债券（QDII）人民币 A 基金份额净值为 1.0781 元，本报告期份额净值增长率为 6.83%；汇添富美元债债券（QDII）人民币 C 基金份额净值为 1.0731 元，本报告期份额净值增长率为 6.59%；汇添富美元债债券（QDII）美元现汇 A 基金份额净值为 1.0779 元，本报告期份额净值增长率为 6.62%；汇添富美元债债券（QDII）美元现汇 C 基金份额净值为 1.0673 元，本报告期份额净值增长率为 6.37%；同期业绩比较基准增长率为 6.47%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于当前市场收益率相对较低，组合将保持当前相对防守的配置，未来如果市场收益率上行，组合有足够的流动性增加久期，加大高收益的配置。如果市场收益率下行，组合相对较短的久期能够保证相对较小的下行风险。此外，我们将继续加强基本面研究，防范信用风险。

#### 4.7 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验，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。

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。人民币基金份额的现金分红币种为人民币，美元基金份额的现金分红币种为美元；不同币种份额红利再投资适用的净值为该币种份额的基金份额净值。

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在汇添富精选美元债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：汇添富精选美元债债券型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2019年06月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |                    |                     |
| 银行存款       | 7,836,799.75       | 6,926,914.40        |
| 结算备付金      | 22,822.72          | -                   |
| 存出保证金      | 351.84             | 1,899.39            |
| 交易性金融资产    | 73,248,459.92      | 85,617,714.68       |
| 其中：股票投资    | -                  | -                   |
| 基金投资       | -                  | -                   |
| 债券投资       | 73,248,459.92      | 85,617,714.68       |
| 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    | 788,388.46         | -                   |
| 应收利息       | 1,356,972.25       | 1,749,315.30        |
| 应收股利       | -                  | -                   |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 应收申购款           | 429,960.19         | 27,290.14          |
| 递延所得税资产         | -                  | -                  |
| 其他资产            | -                  | -                  |
| 资产总计            | 83,683,755.13      | 94,323,133.91      |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2019年06月30日</b> | <b>2018年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |                    |                    |
| 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       | -                  | -                  |
| 应付证券清算款         | -                  | -                  |
| 应付赎回款           | 2,819,869.80       | 337,094.80         |
| 应付管理人报酬         | 53,666.22          | 63,412.12          |
| 应付托管费           | 14,758.18          | 17,438.34          |
| 应付销售服务费         | 6,972.31           | 2,646.06           |
| 应付交易费用          | -                  | -                  |
| 应交税费            | 10,251.21          | 13,899.55          |
| 应付利息            | -                  | -                  |
| 应付利润            | -                  | -                  |
| 递延所得税负债         | -                  | -                  |
| 其他负债            | 81,132.30          | 90,129.44          |
| 负债合计            | 2,986,650.02       | 524,620.31         |
| <b>所有者权益:</b>   |                    |                    |
| 实收基金            | 75,044,954.80      | 93,089,338.29      |
| 未分配利润           | 5,652,150.31       | 709,175.31         |
| 所有者权益合计         | 80,697,105.11      | 93,798,513.60      |
| 负债和所有者权益总计      | 83,683,755.13      | 94,323,133.91      |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金下属人民币 A 类基金份额参考净值人民币 1.0781 元，份额总额 53,004,529.93 份；下属人民币 C 类基金份额参考净值人民币 1.0731 元，份额总额 16,158,208.22 份；下属美元 A 类基金份额参考净值美元 1.0779 元，份额总额 617,547.17 份；下属美元 C 类基金份额参考净值美元 1.0673 元，份额总额 223,274.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富精选美元债债券型证券投资基金

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                   | 上年度可比期间                 |
|-----|----------------------|-------------------------|
|     | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|     |                      |                         |

|                            |              |                |
|----------------------------|--------------|----------------|
| <b>一、收入</b>                | 5,072,520.94 | -3,430,003.43  |
| 1. 利息收入                    | 1,855,723.69 | 2,427,680.59   |
| 其中：存款利息收入                  | 20,376.07    | 37,738.98      |
| 债券利息收入                     | 1,835,267.62 | 2,388,379.62   |
| 资产支持证券利息收入                 | -            | -              |
| 买入返售金融资产收入                 | 80.00        | 1,561.99       |
| 其他利息收入                     | -            | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | 403,014.08   | -10,129,272.27 |
| 其中：股票投资收益                  | -            | -              |
| 基金投资收益                     | -            | -              |
| 债券投资收益                     | 403,014.08   | -10,129,272.27 |
| 资产支持证券投资                   | -            | -              |
| 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）     | 2,883,196.09 | 4,553,744.56   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -87,392.81   | -308,846.65    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 17,979.89    | 26,690.34      |
| <b>减：二、费用</b>              | 488,963.57   | 719,078.55     |
| 1. 管理人报酬                   | 295,267.46   | 416,435.62     |
| 2. 托管费                     | 81,198.56    | 114,519.80     |
| 3. 销售服务费                   | 24,234.98    | 15,392.56      |
| 4. 交易费用                    | 235.39       | 200.45         |
| 5. 利息支出                    | 5.81         | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -            | -              |
| 6. 税金及附加                   | 5,826.80     | 8,320.30       |
| 7. 其他费用                    | 82,194.57    | 164,209.82     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | 4,583,557.37 | -4,149,081.98  |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富精选美元债债券型证券投资基金

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<br>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） | 93,089,338.29              | 709,175.31   | 93,798,513.60 |
| 二、本期经营活动        | -                          | 4,583,557.37 | 4,583,557.37  |

|  |                                    |               |                 |
|--|------------------------------------|---------------|-----------------|
| 产生的基金净值变动数(本期净利润)                      |                                    |               |                 |
| 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)      | -18,044,383.49                     | 359,417.63    | -17,684,965.86  |
| 其中:1.基金申购款                             | 42,778,596.96                      | 2,380,619.62  | 45,159,216.58   |
| 2.基金赎回款                                | -60,822,980.45                     | -2,021,201.99 | -62,844,182.44  |
| 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)                        | 75,044,954.80                      | 5,652,150.31  | 80,697,105.11   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年06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)                        | 166,511,033.08                     | -3,696,094.58 | 162,814,938.50  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -                                  | -4,149,081.98 | -4,149,081.98   |
| 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)      | -93,688,204.79                     | 5,618,966.77  | -88,069,238.02  |
| 其中:1.基金申购款                             | 24,671,338.35                      | -966,477.32   | 23,704,861.03   |
| 2.基金赎回款                                | -118,359,543.14                    | 6,585,444.09  | -111,774,099.05 |
| 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)                        | 72,822,828.29                      | -2,226,209.79 | 70,596,618.50   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| <u>张暉</u> | <u>李骁</u> | <u>雷青松</u> |
| 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

汇添富精选美元债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),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[2017]212号文《关于准予汇添富精选美元债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集,基金合同于2017年4月20日生效,首次设立募集规模为240,067,970.26份人民币基金份额和608,317.88份美元基金份额。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及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外托管人为中国银行(香港)有限公司。

本基金投资于境内境外市场。针对境外投资,本基金可投资于下列金融产品或工具:在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的债券型及货币型公募基金(以下无特别说明,均包括 exchange traded fund,ETF);政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品;与固定收益、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;针对境内投资,本基金可投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款等固定收益类品种,国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金主要投资于以美元计价的债券,通过自上而下和自下而上相结合的方式,对组合资产配置及个券选择进行合理布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期的稳定增值。本基金的业绩比较基准为:iBoxx 美元债总回报指数(iBoxx USD Overall Total Return Index)收益率×95%+商业银行活期存款基准利率(税



后) × 5%。

## 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1月1日至2019年6月30日的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

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

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。

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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.6.1 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司    | 基金托管人                 |
| 中国银行（香港）有限公司  | 基金境外托管人               |
| 东方证券股份有限公司    | 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：基金本报告期未有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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年06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 | 34,574,501.81              | 46.79%       | 26,269,103.84                      | 14.23%       |

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |                  |
|------------|----------------------------|------------------|------------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 1,100,000.00               | 100.00%          | 5,000,000.00                       | 100.00%          |

#### 6.4.8.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.8.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-----------------|----------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 295,267.46                 | 416,435.62                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 58,870.08                  | 36,255.56                          |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$  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 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3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。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间                 |
|----------------|----------------------|-------------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年01月01日至2018年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 81,198.56            | 114,519.80              |

注：本基金的托管费按前一自然日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一自然日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按基金管理人指令于次月首日起2-5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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。基金托管费为包含增值税的含税价款，增值税税率按国家有关规定执行。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                      |                   |                |                |          |
|----------------|-------------------------|-------------------|----------------|----------------|----------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日    |                   |                |                |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |                   |                |                |          |
|                | 汇添富美元债券(QDII)人民币A       | 汇添富美元债券(QDII)人民币C | 汇添富美元现汇(QDII)A | 汇添富美元现汇(QDII)C | 合计       |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -                       | 8,592.08          | -              | -              | 8,592.08 |
| 合计             | -                       | 8,592.08          | -              | -              | 8,592.08 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                 |                   |                |                |          |
|                | 2018年01月01日至2018年06月30日 |                   |                |                |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |                   |                |                |          |

|                   | 汇添富美<br>元债券<br>(QDII)<br>人民币 A | 汇添富美<br>元债券<br>(QDII)<br>人民币 C | 汇添富美<br>元债券<br>(QDII)<br>美元现汇<br>A | 汇添富美<br>元债券<br>(QDII)<br>美元现汇<br>C | 合计       |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|----------|
| 汇添富基金管理股份有限<br>公司 | -                              | 4,073.45                       | -                                  | -                                  | 4,073.45 |
| 合计                | -                              | 4,073.45                       | -                                  | -                                  | 4,073.45 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按基金管理人指令于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中划出，经登记结算机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 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：本基金本报告期末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：本报告期内及上年度可比期间基金管理人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<br>2019年1月1日至2019年6月<br>30日 |           | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |           |
|--------------|--------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                           | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 中国银行股份有限公司   | 2,994,748.55                   | 12,929.22 | 4,844,688.20                       | 33,748.98 |
| 中国银行(香港)有限公司 | 4,842,051.20                   | 6,844.49  | 15,746,060.42                      | -         |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中国银行(香港)有限公司保管，按适用利率计息。

### 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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

### 6.4.9 期末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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 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，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖

出回购证券款余额。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，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：普通股            | -             | -             |
|    | 存托凭证              | -             | -             |
|    | 优先股               | -             | -             |
|    | 房地产信托凭证           | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 73,248,459.92 | 87.53         |
|    | 其中：债券             | 73,248,459.92 | 87.53         |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
|    | 其中：远期             | -             | -             |
|    | 期货                | -             | -             |
|    | 期权                | -             | -             |
|    | 权证                | -             | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 6  | 货币市场工具            | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 7,859,622.47  | 9.39          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,575,672.74  | 3.08          |
| 9  | 合计                | 83,683,755.13 | 100.00        |

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未有投资股票。



## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未有股票投资。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未有股票投资。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期末未有股票投资。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级     | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|------------|---------------|---------------|
| A-至 A+     | 15,345,370.47 | 19.02         |
| BBB-至 BBB+ | 3,866,984.38  | 4.79          |
| BB-至 BB+   | 32,580,618.12 | 40.37         |
| B-至 B+     | 16,841,536.95 | 20.87         |
| 无评级        | 4,613,950.00  | 5.72          |

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

## 7.7 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 | 证券代码       | 证券名称  | 数量 (份) | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------|-------|--------|--------------|---------------|
| 1  | XS12156172 | AGILE | 9      | 5,671,627.50 | 7.03          |

|   |              |                                |       |              |      |
|---|--------------|--------------------------------|-------|--------------|------|
|   | 72           | 05/21/20                       |       |              |      |
| 2 | XS0836465608 | CITLTD 6.8<br>01/17/23<br>Corp | 5,000 | 3,866,984.38 | 4.79 |
| 3 | USG8450LAN40 | CHGRID3.75<br>05/23            | 5,000 | 3,576,253.31 | 4.43 |
| 4 | XS1219965297 | CENCHI 8.75<br>01/21           | 5,000 | 3,572,369.11 | 4.43 |
| 5 | XS1748890230 | BKCOM 3.750<br>23/01/25        | 5,000 | 3,501,972.18 | 4.34 |

## 7.8 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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立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没有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 | 351.84 |

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 788,388.46   |
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | 1,356,972.25 |
| 5 | 应收申购款   | 429,960.19   |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | -            |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 2,575,672.74 |

### 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：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## § 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

| 份额级别               | 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(%) |
| 汇添富美元债券(QDII)人民币A  | 1,013    | 52,324.31 | 533,271.55 | 1.01      | 52,471,258.38 | 98.99     |
| 汇添富美元债券(QDII)人民币C  | 775      | 20,849.30 | 0.00       | 0.00      | 16,158,208.22 | 100.00    |
| 汇添富美元债券(QDII)美元现汇A | 50       | 12,350.94 | 0.00       | 0.00      | 617,547.17    | 100.00    |
| 汇添富美元债券(QDII)美元现汇C | 36       | 6,202.07  | 0.00       | 0.00      | 223,274.42    | 100.00    |

|    |       |           |            |      |               |       |
|----|-------|-----------|------------|------|---------------|-------|
| 合计 | 1,874 | 37,355.15 | 533,271.55 | 0.76 | 69,470,288.19 | 99.24 |
|----|-------|-----------|------------|------|---------------|-------|

注：表内美元现汇 A 和美元现汇 C 的份额以及占比未按汇率进行折算。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                | 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 | 汇添富美元债券（QDII）人民币 A  | 380,845.54 | 0.72        |
|                  | 汇添富美元债券（QDII）人民币 C  | 129.13     | 0.00        |
|                  | 汇添富美元债券（QDII）美元现汇 A | 9.32       | 0.00        |
|                  | 汇添富美元债券（QDII）美元现汇 C | 9,850.28   | 4.41        |
|                  | 合计                  | 390,834.27 | 0.56        |

注：上表美元现汇份额为美元份额。如果将美元份额按照 2019 年 6 月 28 日中国人民银行美元兑换人民币汇率中间价折算为人民币份额后进行计算，美元现汇 A 的管理人所有从业人员持有本基金为 64.07 份，美元现汇 C 的管理人所有从业人员持有本基金为 67,717.72 份；从业人员持有本基金合计份额为 448,756.46 份，合计份额占比为 0.60%。

## 8.3 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的情况

| 项目                                 | 份额级别                | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇添富美元债券（QDII）人民币 A  | 0                 |
|                                    | 汇添富美元债券（QDII）人民币 C  | 0                 |
|                                    | 汇添富美元债券（QDII）美元现汇 A | 0                 |
|                                    | 汇添富美元债券（QDII）美元现汇 C | 0                 |
|                                    | 合计                  | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 汇添富美元债券（QDII）人民币 A  | 0                 |
|                                    | 汇添富美元债券（QDII）人民币 C  | 0                 |
|                                    | 汇添富美元债券（QDII）美元现汇 A | 0                 |
|                                    | 汇添富美元债券（QDII）美元现汇 C | 0                 |
|                                    | 合计                  | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目  | 汇添富美元债券<br>(QDII)人民币 A | 汇添富美元债券<br>(QDII)人民币 C | 汇添富美元债券<br>(QDII)美元现<br>汇 A | 汇添富美元债券<br>(QDII)美元现<br>汇 C |
|---|------------------------|------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 基金合同<br>生效日<br>(2017年<br>4月20日)<br>基金份额<br>总额 | 225,663,207.09         | 14,404,763.17          | 314,116.45                  | 294,201.43                  |
| 本报告期<br>期初基金<br>份额总额                          | 81,859,104.06          | 6,113,164.47           | 499,151.94                  | 227,924.08                  |
| 本报告期<br>基金总申<br>购份额                           | 17,315,313.12          | 24,080,858.42          | 127,465.69                  | 77,621.57                   |
| 减:本报告<br>期基金总<br>赎回份额                         | 46,169,887.25          | 14,035,814.67          | 9,070.46                    | 82,271.23                   |
| 本报告期<br>基金拆分<br>变动份额<br>(份额减<br>少以“-”<br>填列)  | -                      | -                      | -                           | -                           |
| 本报告期<br>期末基金<br>份额总额                          | 53,004,529.93          | 16,158,208.22          | 617,547.17                  | 223,274.42                  |

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，本基金管理人未发生重大人事变动。

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行股票投资。

#### 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 |                  | 基金交易 |                  |
|--------------|---------------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|------|------------------|
|              | 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 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 东方证券         | 34,574,501.81 | 46.79            | -      | -                  | -    | -                | -    | -                |
| Marketaccess | 18,374,379.51 | 24.87            | -      | -                  | -    | -                | -    | -                |

|  |              |      |   |   |   |   |   |
|--|--------------|------|---|---|---|---|---|
| Mizuho Bank Ltd                        | 6,422,179.11 | 8.69 | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley                         | 5,946,690.27 | 8.05 | - | - | - | - | - |
| SC Lowry Financial HK Ltd              | 3,176,035.50 | 4.30 | - | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase & Co.                   | 2,113,384.80 | 2.86 | - | - | - | - | - |
| CITIC Securities International Company | 1,916,166.24 | 2.59 | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs Group, Inc.              | 1,372,042.80 | 1.86 | - | - | - | - | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易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。

2、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

## § 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                 |               |      |               | 报告期末持有基金情况 |          |
|-------|----------------|---------------------------------|---------------|------|---------------|------------|----------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间         | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额          | 持有份额       | 份额占比 (%) |
| 机构    | 1              | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 26 日 | 29,873,538.60 | -    | 29,873,538.60 | -          | 0.00     |
| 个人    | -              | -                               | -             | -    | -             | -          | -        |
| -     | -              | -                               | -             | -    | -             | -          | -        |

#### 产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时,少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高,其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时,更容易触发巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致基金规模较小,基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元,进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



汇添富基金管理股份有限公司  
2019 年 08 月 29 日