

海富通添鑫收益债券型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 23 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	50
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.11 投资组合报告附注.....	50
8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动	55
10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件	57
11 影响投资者决策的其他重要信息	58
12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通添鑫收益债券型证券投资基金	
基金简称	海富通添鑫收益债券	
基金主代码	008610	
交易代码	008610	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 23 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	597,014,658.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C
下属分级基金的交易代码	008611	008610
报告期末下属分级基金的份额总额	418,401,833.90 份	178,612,824.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券的投资比例不低于基金资产的 80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对股票、固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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		海富通基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	罗菲菲
	联系电话	021-38650788	010-58560666
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95568
传真		021-33830166	010-58560798
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石	北京市西城区复兴门内大街2

	桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石 桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	北京市西城区复兴门内大街2 号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	杨仓兵	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号 东亚银行金融大厦 36-37 层

§ 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(2020年4月23日(基金合同生效日)至2020年6月30日)	
	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C
本期已实现收益	873,223.29	240,081.23
本期利润	369,687.14	25,010.25
加权平均基金份额本期利润	0.0009	0.0001
本期加权平均净值利润率	0.09%	0.01%
本期基金份额净值增长率	0.09%	0.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C
期末可供分配利润	369,687.14	25,010.25
期末可供分配基金份额利润	0.0009	0.0001
期末基金资产净值	418,771,521.04	178,637,834.44
期末基金份额净值	1.0009	1.0001
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C

基金份额累计净值增长率	0.09%	0.01%
-------------	-------	-------

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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同生效日为 2020 年 4 月 23 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

海富通添鑫收益债券 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
过去一个月	0.42%	0.10%	0.17%	0.13%	0.25%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.09%	0.08%	-0.30%	0.11%	0.39%	-0.03%

海富通添鑫收益债券 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
过去一个月	0.38%	0.10%	0.17%	0.13%	0.21%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.01%	0.08%	-0.30%	0.11%	0.31%	-0.03%

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

海富通添鑫收益债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 4 月 23 日至 2020 年 6 月 30 日)

海富通添鑫收益债券 A



海富通添鑫收益债券 C



注：1、本基金合同于 2020 年 4 月 23 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 74 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债

交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
杜晓海	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通研究精选混合基金经理；海富通安益对冲	2020-04-23	-	20 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通新内需混合和海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海

	混合基金经理；海富通中证 500 增强基金经理；海富通富盈混合基金经理；海富通富泽混合基金经理；量化投资部总监。				富通创业板增强、海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。
陈轶平	本基金的基金经理；海富通弘丰定开债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通瑞利债券基金经理；海富通上清所短融债券基金经理；海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理；海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理；海富通上证城投债 ETF 基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通上证周期产业债 ETF 基金经理；海富通恒丰定开债券基金经理；固定收益投资副总	2020-04-23	-	11 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资副总监。2013 年 8 月起任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF(现为海富通上证城投债 ETF)基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券(现为海富通瑞丰债券)基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债(QDII)

	监。			<p>基金经理。2017 年 1 月起兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深 300 指数增强)基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券(现为海富通瑞福债券)、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月起兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。</p>
--	----	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资

组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2020 年上半年，全球各大经济体均显著受到新冠疫情的巨大冲击。目前看，中国采取了及时、得力的防控举措，在较短时间内抑制住了疫情发展并在二季度有效地推动复工复产。欧美等发达经济体、印度巴西等发展中国家的疫情防控相对滞后一些，经济运行的恢复时间、速度也比中国慢一些。为了应对疫情的巨大冲击，全球主要经济体的央行资产负债表明显扩张，全球呈现较显著的流动性宽松态势。目前看，整体宽松、低利率的环境还将持续一段时间。

先有疫情剧烈冲击、随后流动性显著宽松，全球资本市场基本呈现出剧烈波动、先大跌后大涨的态势，中国 A 股由于疫情防控得力、经济恢复相对较好而表现更好一些。上半年 A 股主要指数方面，上证指数下跌 2.15%，沪深 300 上涨 1.64%，中证 800 上涨 3.94%，中小板指上涨 20.85%，创业板指上涨 35.60%。分行业看，医药泛消费和科技成长行业领涨，医药、消费者服务、食品饮料、电子元器件、计算机分别上涨 41.54%、26.32%、25.41%、24.22% 和 22.92%；大金融、周期品显著落后，石油石化、煤炭、银行、非银行金融、房地产分别下跌 17.47%、15.53%、13.02%、10.67% 和 8.54%。

从上半年市场内部的结构看，业绩高确定和较高增长的资产获得了市场的追捧。内需类的医药、食品饮料、免税等板块是机构投资者看好和投资的主要方向，代表未来成长方向的新能源车产业链、消费电子、自主可控和半导体、新基建的 IDC 数据中心等也是机构投资者重要的布局领域，金融地产和部分传统行业短期受经济冲击影响较大，上半年明显跑输其他板块。

本报告期，本基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

债市方面，从国内经济基本面来看，在新冠疫情的扰动下，1-6 月工业增加值、固定资产投资和

社会消费品零售总额累计同比下跌 1.3%、3.1%和 11.4%，跌幅较去年全年走阔了 7.0、8.5 和 19.4 个百分点，实际 GDP 增速由一季度的-6.8%回升至第二季度的 3.2%，上半年累计增速落在-1.6%。今年以来猪肉等食品价格和原油等主要工业品价格均有所下跌，整体通胀水平呈逐步回落的走势，上半年 CPI 和 PPI 的中枢分别落在 3.8%和-1.9%。在上述背景下，上半年国内货币政策边际上先松后紧，1-4 月央行三次降准释放资金 1.75 万亿元，两次调降逆回购操作利率和 MLF 利率累计达 30BP，并调降超储率至 0.35%，而随着经济逐步企稳，5-6 月货币政策更强调适度可逆，央行并未进一步降准降息；上半年银行间质押式回购加权利率呈先下后上的走势，整体中枢落在 1.6%，较去年全年中枢下行约 50BP。由此，2020 年上半年债市呈先涨后跌的走势。具体来看，1-4 月，疫情相继对国内外经济造成巨大冲击，宽松政策密集落地，短端品种收益率下行幅度超过长端品种，债市呈现牛陡行情；5-6 月，债市面临一万亿专项债发行、特别国债市场化发行造成的流动性冲击，但央行未通过降准降息操作进行配合，资金面波动加大，带动各期限利率出现大幅调整，绝对收益率基本回到临近春节时的水平。整体看，上半年 10 年期国债收益率累计下行 31BP，1 年期国债收益率累计下行 19BP。信用债方面，上半年信用债收益率跟随利率债先下后上，半年末各主要品种和期限的信用债绝对收益率均回到历史 20%分位数以内。可转债方面，上半年转债市场先扬后抑，而转债整体估值水平先上后下，上半年中证转债指数累计下跌 1.84%。

本管理人在上半年稳步建仓信用债，并参与利率债波段机会。同时，本管理人上半年根据市场情况动态调整了可转债资产，以在控制波动的同时获取权益上涨收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金处于建仓期，海富通添鑫收益 A 成立以来净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.39 个百分点。海富通添鑫收益 C 净值增长率为 0.01%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.31 个百分点。

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，虽然疫情可能有一定反复，但总体应该不会改变中国及全球经济逐步恢复的趋势。国内社融短期仍维持宽松，但后续货币条件正常化将纳入监管层考量。本质上，我们相信疫情对国内外经济的冲击是一次外生冲击，未来半年至一年的经济及各行业不断修复、走向正常是相对确定的，节奏、结构则需要自下而上的密切跟踪和把握。

3 月下旬国内股市触底后，资本市场短期对于疫情走势、经济与各行业受到的冲击情况尚不清晰，同时国内外流动性较为充裕，因此二季度市场结构聚焦在长期看好、短期经营和业绩风险也不大的医药泛消费、科技成长的优质个股。展望下半年，随着经济及各行业继续向正常状态修复（2020

年上半年又是低基数），与宏观经济正相关的很多行业将迎来企业基本面的逐步好转，因此整体市场仍有不错的投资机会；预计下半年市场风格将相对均衡，大金融、周期品、制造业也开始涌现一些投资机会，而长期看好的医药泛消费、科技成长更需关注行业、个股的景气能否超预期。

本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

债市方面，展望下半年，国内经济有望延续修复态势，通胀大概率呈分化格局。从基本面来看，地产政策维稳主基调难改，依然坚持房住不炒的基本原则，房地产投资增长幅度或有限；企业盈利有所改善但行业有所分化，在总需求偏弱的背景下，行业收入与利润或仍将承压，制造业投资难有起色；在政策加码下基建投资增速大概率延续回升；消费或有一定回暖，但居民收入大概率下滑，叠加国内疫情有所反复，可选消费短期内或仍将承压；随着海外复工复产的推进，外需回升对出口或有一定支撑。通胀方面，在基数和疫情的影响下，下半年 CPI 中枢或有所回落；基建和复工复产大概率推动 PPI 跌幅收窄。整体看下半年国内或仍将处于疫情未完全消退、经济逐步修复的阶段，货币政策尚不具备转向的条件，但超预期宽松的空间有限。在上述判断下，我们认为下半年利率或将呈现震荡格局，且波动性较大，可择机参与波段交易，但需密切关注货币政策的边际变化，并逐步警惕风险偏好回升以及下半年经济企稳与通胀预期升温的可能性。信用债方面，前期信用债调整幅度不及利率债，或存在一定补调和估值波动风险，建议适度控制久期；同时，货币市场中枢和波动性预期均有所抬升，杠杆套息空间收窄。因此下半年推荐短久期高票息的信用策略，行业上建议对城投、地产适度下沉，同时自上而下地挖掘经营及融资修复的产业债。可转债方面，下半年或将呈现债市偏弱、股市偏强的格局，可适当布局绝对价格不高、低估值的转债标的、以及转股溢价率较低的核心标的。

本组合在下半年将继续根据市场情况灵活配置各类债券资产，努力获取稳定收益。

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》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、

会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红相互独立、互不影响。

本基金报告期内未进行过利润分配，但符合基金合同规定。

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

本基金本报告期无需要说明的情形。

§ 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：海富通添鑫收益债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	112,650,874.00
结算备付金		5,471,367.95
存出保证金		16,442.39
交易性金融资产	6.4.7.2	485,279,951.95
其中：股票投资		52,424,279.50
基金投资		-
债券投资		432,855,672.45
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	104,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	2,761,302.55
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		710,179,938.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		112,201,142.86
应付赎回款		-
应付管理人报酬		341,614.46
应付托管费		73,203.05
应付销售服务费		58,378.26
应付交易费用	6.4.7.7	40,929.41
应交税费		14,406.60

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	40,908.72
负债合计		112,770,583.36
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	597,014,658.09
未分配利润	6.4.7.10	394,697.39
所有者权益合计		597,409,355.48
负债和所有者权益总计		710,179,938.84

注：1、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 597,014,658.09 份，其中海富通添鑫收益债券 A 类份额 418,401,833.90 份，海富通添鑫收益债券 C 类份额 178,612,824.19 份。A 类份额净值 1.0009 元，C 类份额净值 1.0001 元。

2、基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.2 利润表

会计主体：海富通添鑫收益债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,583,101.13
1.利息收入	6.4.7.11	1,699,231.66
其中：存款利息收入		350,621.23
债券利息收入		929,150.94
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		419,459.49
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		602,476.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,010.10
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-18,603.05
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	627,089.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-718,607.13

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		1,188,403.74
1. 管理人报酬		775,144.10
2. 托管费		166,102.27
3. 销售服务费		132,483.15
4. 交易费用	6.4.7.19	47,627.45
5. 利息支出		20,554.28
其中：卖出回购金融资产支出		20,554.28
6.税金及附加		2,148.77
7. 其他费用	6.4.7.20	44,343.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		394,697.39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		394,697.39

注：本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通添鑫收益债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2020 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）	597,014,658.09	-	597,014,658.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	394,697.39	394,697.39
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	597,014,658.09	394,697.39	597,409,355.48

注：本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

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：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通添鑫收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]第 2355 号《关于准予海富通添鑫收益债券型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 596,891,401.84 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0330 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 597,014,658.09 份，其中认购资金利息折合 123,256.25 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同》和《海富通添鑫收益债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含可分离型可转换债券的纯债部分）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款等）、货币市场工具、股票（包括创业板、中小板以及其他依法发行上市的股票）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金对股票

资产的投资比例不超过基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2020 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有

能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为股指期货投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充

足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支

持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	112,650,874.00
定期存款	-
其他存款	-
合计	112,650,874.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	49,297,604.87	52,424,279.50	3,126,674.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	164,323,406.83	161,411,672.45
	银行间市场	272,377,547.38	271,444,000.00
	合计	436,700,954.21	432,855,672.45
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	485,998,559.08	485,279,951.95	-718,607.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产 / 负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	104,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	104,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,198.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,462.10
应收债券利息	2,756,634.67
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	7.40
合计	2,761,302.55

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	38,004.41
银行间市场应付交易费用	2,925.00
合计	40,929.41

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	40,908.72

合计	40,908.72
----	-----------

6.4.7.9 实收基金

海富通添鑫收益债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	418,401,833.90	418,401,833.90
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	418,401,833.90	418,401,833.90

海富通添鑫收益债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	178,612,824.19	178,612,824.19
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	178,612,824.19	178,612,824.19

注：1. 本基金自 2020 年 4 月 7 日至 2020 年 4 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 596,891,401.84 元，其中海富通添鑫收益债券 A 类净认购资金为 418,301,305.95 元，海富通添鑫收益债券 C 类净认购资金为 178,590,095.89 元。根据《海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 123,256.25 元在本基金成立后，折算为 123,256.25 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《海富通添鑫收益债券型证券投资基金招募说明书》和《海富通添鑫收益债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2020 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 7 月 21 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2020 年 7 月 22 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

海富通添鑫收益债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	873,223.29	-503,536.15	369,687.14
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	873,223.29	-503,536.15	369,687.14

海富通添鑫收益债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	240,081.23	-215,070.98	25,010.25
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	240,081.23	-215,070.98	25,010.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
活期存款利息收入	76,610.10
定期存款利息收入	265,222.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,765.75
其他	23.16
合计	350,621.23

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出股票成交总额	1,536,266.83
减：卖出股票成本总额	1,542,276.93
买卖股票差价收入	-6,010.10

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	344,706.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	362,430.06
减：应收利息总额	879.75
买卖债券差价收入	-18,603.05

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	627,089.75
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	627,089.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-718,607.13
——股票投资	3,126,674.63
——债券投资	-3,845,281.76
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-718,607.13

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	44,702.45
银行间市场交易费用	2,925.00
合计	47,627.45

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	16,363.35
信息披露费	24,545.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,435.00
合计	44,343.72

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	52,376,148.63	100.00%

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	45,053,414.26	100.00%

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	1,678,100,000.00	100.00%

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	38,004.41	100.00%	38,004.41	100.00%

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	60,117.82

注：1、支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

2、基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：1、支付基金托管人民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

2、基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关	本期

关联方名称	2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C	合计
民生银行	-	46,607.51	46,607.51
海通证券	-	93.11	93.11
海富通基金	-	14,836.56	14,836.56
合计	-	61,537.18	61,537.18

注：1、支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 X 0.4% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期间基金管理人未运用自有资金投资本基金，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.6 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 2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	112,650,874.00	76,610.10

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期间无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002555	三七互娱	2020-05-12	2020-11-12	大宗交易	33.57	43.56	60,000	2,014,200.00	2,613,600.00	-
002602	世纪华通	2020-06-15	2020-12-15	大宗交易	13.02	14.10	160,000	2,083,200.00	2,256,000.00	-
300607	拓斯达	2020-06-23	2020-12-23	大宗交易	62.40	37.26	59,400	2,059,200.00	2,213,244.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型						
12305 5	晨光 转债	2020-0 6-17	2020-0 7-13	老股 东配 债	100.00	100.00	100	10,000 .00	10,000 .00	-
12811 5	巨星 转债	2020-0 6-24	2020-0 7-16	老股 东配 债	100.00	100.00	70	7,000. 00	7,000. 00	-

注：1.基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2.[300607]拓斯达于 2020-6-23 买入数量 33,000 股，成本 2,059,200.00 元；于 2020-6-29 送股，数量 26,400 股，因此总数量 59,400 股，平均认购单价：34.67 元/股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币

市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值，力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 50.76%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	119,496,000.00
合计	119,496,000.00

注：1.未评级部分为国债和超短期融资券。

2.基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日
AAA	187,194,660.20
AAA 以下	26,281,560.25
未评级	99,883,452.00
合计	313,359,672.45

注：1.未评级部分为政策性金融债。

2.基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.19%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	112,650,874.00	-	-	-	112,650,874.00
结算备付金	5,471,367.95	-	-	-	5,471,367.95
存出保证金	16,442.39	-	-	-	16,442.39
交易性金融资产	122,695,391.00	201,488,201.56	108,672,079.89	52,424,279.50	485,279,951.95
买入返售金融资产	104,000,000.00	-	-	-	104,000,000.00
应收利息	-	-	-	2,761,302.55	2,761,302.55
资产总计	344,834,075.34	201,488,201.56	108,672,079.89	55,185,582.05	710,179,938.84
负债					
应付证券清算款	-	-	-	112,201,142.86	112,201,142.86
应付管理人报酬	-	-	-	341,614.46	341,614.46
应付托管费	-	-	-	73,203.05	73,203.05
应付销售服务费	-	-	-	58,378.26	58,378.26
应付交易费用	-	-	-	40,929.41	40,929.41
应交税费	-	-	-	14,406.60	14,406.60
其他负债	-	-	-	40,908.72	40,908.72
负债总计	-	-	-	112,770,583.36	112,770,583.36
利率敏感度缺口	344,834,075.34	201,488,201.56	108,672,079.89	-57,585,001.31	597,409,355.4

					8
--	--	--	--	--	---

注：1.表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

2.基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2020 年 6 月 30 日
	市场利率上升 25 个基点	-3,736,595.50
	市场利率下降 25 个基点	3,803,950.74

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末

	2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	52,424,279.50	8.78
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	52,424,279.50	8.78

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 2020 年 6 月 30 日
	业绩比较基准 (附注 6.4.1)上升 5%	2,531,657.10
	业绩比较基准 (附注 6.4.1)下降 5%	-2,531,657.10

注：基金合同成立于 2020 年 4 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.14 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	52,424,279.50	7.38
	其中：股票	52,424,279.50	7.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	432,855,672.45	60.95

	其中：债券	432,855,672.45	60.95
	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	104,000,000.00	14.64
	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	118,122,241.95	16.63
8	其他各项资产	2,777,744.94	0.39
9	合计	710,179,938.84	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

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	527,356.00	0.09
C	制造业	25,152,105.10	4.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	344,773.00	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,284,585.40	0.38
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	7,151,067.00	1.20
J	金融业	13,902,759.00	2.33
K	房地产业	2,326,830.00	0.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	614,784.00	0.10
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	120,020.00	0.02

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,424,279.50	8.78

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	980,300	4,881,894.00	0.82
2	600036	招商银行	119,000	4,012,680.00	0.67
3	002555	三七互娱	60,000	2,613,600.00	0.44
4	002602	世纪华通	166,200	2,350,922.00	0.39
5	300607	拓斯达	61,560	2,301,134.40	0.39
6	000895	双汇发展	45,600	2,101,704.00	0.35
7	601166	兴业银行	124,200	1,959,876.00	0.33
8	601012	隆基股份	34,000	1,384,820.00	0.23
9	600048	保利地产	91,500	1,352,370.00	0.23
10	600585	海螺水泥	25,000	1,322,750.00	0.22
11	600803	新奥股份	113,100	1,169,454.00	0.20
12	000568	泸州老窖	12,400	1,129,888.00	0.19
13	002001	新和成	37,000	1,076,700.00	0.18
14	600031	三一重工	56,500	1,059,940.00	0.18
15	600030	中信证券	43,000	1,036,730.00	0.17
16	601318	中国平安	13,500	963,900.00	0.16
17	601966	玲珑轮胎	47,600	961,520.00	0.16
18	600183	生益科技	32,475	950,543.25	0.16
19	600406	国电南瑞	45,900	929,475.00	0.16
20	603583	捷昌驱动	12,800	875,264.00	0.15
21	002475	立讯精密	16,639	854,412.65	0.14
22	000338	潍柴动力	62,000	850,640.00	0.14
23	600998	九州通	43,200	804,384.00	0.13
24	603678	火炬电子	23,600	661,272.00	0.11
25	601877	正泰电器	24,600	648,210.00	0.11
26	300760	迈瑞医疗	1,900	580,830.00	0.10
27	601688	华泰证券	28,200	530,160.00	0.09
28	000661	长春高新	1,200	522,360.00	0.09
29	002142	宁波银行	19,700	517,519.00	0.09

30	600383	金地集团	37,600	515,120.00	0.09
31	000651	格力电器	8,800	497,816.00	0.08
32	603883	老百姓	4,900	490,196.00	0.08
33	603259	药明康德	5,040	486,864.00	0.08
34	601088	中国神华	30,500	437,980.00	0.07
35	000656	金科股份	45,400	370,464.00	0.06
36	601933	永辉超市	36,800	345,184.00	0.06
37	002841	视源股份	3,300	328,416.00	0.05
38	600887	伊利股份	10,200	317,526.00	0.05
39	002697	红旗连锁	28,200	307,944.00	0.05
40	002415	海康威视	9,300	282,255.00	0.05
41	300383	光环新网	10,600	276,342.00	0.05
42	603444	吉比特	500	274,505.00	0.05
43	600521	华海药业	7,920	268,725.60	0.04
44	601139	深圳燃气	40,400	262,600.00	0.04
45	002007	华兰生物	5,200	260,572.00	0.04
46	300014	亿纬锂能	5,132	245,566.20	0.04
47	601231	环旭电子	10,500	229,320.00	0.04
48	000513	丽珠集团	4,700	225,647.00	0.04
49	603538	美诺华	4,000	203,920.00	0.03
50	002223	鱼跃医疗	5,500	200,200.00	0.03
51	600486	扬农化工	2,000	165,000.00	0.03
52	002271	东方雨虹	3,600	146,268.00	0.02
53	000063	中兴通讯	3,400	136,442.00	0.02
54	300003	乐普医疗	3,700	135,124.00	0.02
55	002727	一心堂	3,500	129,885.00	0.02
56	300759	康龙化成	1,300	127,920.00	0.02
57	603233	大参林	1,520	123,454.40	0.02
58	300244	迪安诊断	3,400	120,020.00	0.02
59	002624	完美世界	2,000	115,280.00	0.02
60	300770	新媒股份	500	111,830.00	0.02
61	002459	晶澳科技	5,900	110,802.00	0.02
62	002938	鹏鼎控股	2,200	110,132.00	0.02
63	600438	通威股份	6,300	109,494.00	0.02
64	600055	万东医疗	6,800	108,868.00	0.02
65	300702	天宇股份	1,000	106,320.00	0.02
66	300750	宁德时代	600	104,616.00	0.02
67	300454	深信服	500	102,980.00	0.02
68	002511	中顺洁柔	4,600	102,580.00	0.02
69	000581	威孚高科	4,900	101,332.00	0.02
70	002600	领益智造	9,500	100,985.00	0.02
71	002831	裕同科技	3,600	99,036.00	0.02
72	002444	巨星科技	8,300	98,604.00	0.02
73	002028	思源电气	4,800	98,208.00	0.02

74	300138	晨光生物	8,000	97,120.00	0.02
75	300316	晶盛机电	3,900	96,486.00	0.02
76	300476	胜宏科技	4,000	96,200.00	0.02
77	300036	超图软件	3,800	95,684.00	0.02
78	002595	豪迈科技	4,900	95,354.00	0.02
79	300572	安车检测	1,500	95,325.00	0.02
80	300226	上海钢联	1,200	94,320.00	0.02
81	000708	中信特钢	5,500	93,995.00	0.02
82	002230	科大讯飞	2,500	93,575.00	0.02
83	002439	启明星辰	2,200	92,554.00	0.02
84	603228	景旺电子	2,600	91,494.00	0.02
85	300114	中航电测	8,000	91,280.00	0.02
86	002332	仙琚制药	5,400	90,936.00	0.02
87	300146	汤臣倍健	4,600	90,574.00	0.02
88	000157	中联重科	14,000	90,020.00	0.02
89	000333	美的集团	1,500	89,685.00	0.02
90	000975	银泰黄金	5,700	89,376.00	0.01
91	000002	万科A	3,400	88,876.00	0.01
92	600745	闻泰科技	700	88,165.00	0.01
93	000425	徐工机械	14,800	87,468.00	0.01
94	002605	姚记科技	2,300	87,400.00	0.01
95	002557	洽洽食品	1,600	86,704.00	0.01
96	000977	浪潮信息	2,200	86,196.00	0.01
97	603368	柳药股份	3,640	83,538.00	0.01
98	600741	华域汽车	4,000	83,160.00	0.01
99	600461	洪城水业	12,900	82,173.00	0.01
100	002643	万润股份	2,800	48,076.00	0.01
101	002463	沪电股份	1,800	44,964.00	0.01
102	300628	亿联网络	600	40,956.00	0.01
103	002396	星网锐捷	1,000	35,330.00	0.01

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	4,999,530.00	0.84
2	600036	招商银行	4,002,043.00	0.67
3	002602	世纪华通	2,171,984.00	0.36
4	300607	拓斯达	2,143,471.00	0.36
5	002555	三七互娱	2,014,200.00	0.34

6	601166	兴业银行	2,007,577.00	0.34
7	000895	双汇发展	1,968,258.00	0.33
8	600048	保利地产	1,482,105.00	0.25
9	600585	海螺水泥	1,366,744.00	0.23
10	600803	新奥股份	1,129,145.00	0.19
11	600031	三一重工	1,116,007.00	0.19
12	601012	隆基股份	1,027,442.00	0.17
13	000568	泸州老窖	1,020,367.00	0.17
14	601966	玲珑轮胎	1,019,592.00	0.17
15	600030	中信证券	1,001,900.00	0.17
16	002001	新和成	998,958.00	0.17
17	601318	中国平安	998,325.00	0.17
18	600183	生益科技	994,333.00	0.17
19	600406	国电南瑞	918,508.00	0.15
20	000338	潍柴动力	879,093.00	0.15

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601899	紫金矿业	598,805.00	0.10
2	002396	星网锐捷	291,640.00	0.05
3	000581	威孚高科	175,247.83	0.03
4	000063	中兴通讯	127,435.00	0.02
5	603233	大参林	123,026.00	0.02
6	002382	蓝帆医疗	114,404.00	0.02
7	600055	万东医疗	105,709.00	0.02

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	50,839,881.80
卖出股票的收入（成交）总额	1,536,266.83

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	129,598,452.00	21.69
	其中：政策性金融债	129,598,452.00	21.69
4	企业债券	117,657,000.00	19.69
5	企业短期融资券	89,781,000.00	15.03
6	中期票据	60,521,000.00	10.13
7	可转债（可交换债）	35,298,220.45	5.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	432,855,672.45	72.46

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	190210	19 国开 10	500,000	51,095,000.00	8.55
2	190205	19 国开 05	400,000	40,332,000.00	6.75
3	012000750	20 南航股 SCP010	300,000	30,003,000.00	5.02
4	012001184	20 东航股 SCP014	300,000	29,901,000.00	5.01
5	012001806	20 航天电 子 SCP005	300,000	29,877,000.00	5.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

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

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股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	16,442.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,761,302.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,777,744.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123029	英科转债	359,842.50	0.06
2	113551	福特转债	316,075.20	0.05
3	128074	游族转债	302,380.50	0.05
4	113509	新泉转债	289,908.60	0.05
5	128030	天康转债	276,466.50	0.05
6	110055	伊力转债	275,441.80	0.05
7	123022	长信转债	275,441.40	0.05
8	128067	一心转债	275,203.60	0.05
9	128088	深南转债	267,376.00	0.04
10	113521	科森转债	266,546.40	0.04
11	128059	视源转债	265,680.00	0.04
12	113545	金能转债	265,603.80	0.04
13	113558	日月转债	265,280.00	0.04
14	128084	木森转债	264,448.80	0.04
15	128080	顺丰转债	262,287.00	0.04
16	128029	太阳转债	262,206.90	0.04
17	128028	赣锋转债	260,977.20	0.04
18	113504	艾华转债	258,627.60	0.04
19	110038	济川转债	257,846.40	0.04
20	123036	先导转债	257,790.10	0.04
21	127005	长证转债	257,774.40	0.04
22	128065	雅化转债	257,014.00	0.04
23	123025	精测转债	254,712.50	0.04
24	132018	G 三峡 EB1	254,098.40	0.04
25	113019	玲珑转债	253,626.00	0.04
26	113013	国君转债	253,573.30	0.04
27	128051	光华转债	253,568.00	0.04
28	113029	明阳转债	252,978.70	0.04
29	113008	电气转债	252,601.60	0.04
30	110062	烽火转债	251,914.20	0.04
31	128035	大族转债	251,591.00	0.04
32	110057	现代转债	251,357.10	0.04
33	113526	联泰转债	250,823.00	0.04
34	128048	张行转债	250,674.30	0.04

35	113554	仙鹤转债	250,660.80	0.04
36	132013	17 宝武 EB	250,463.50	0.04
37	132007	16 凤凰 EB	249,900.00	0.04
38	113022	浙商转债	249,502.50	0.04
39	128025	特一转债	249,426.50	0.04
40	132005	15 国资 EB	249,400.00	0.04
41	132004	15 国盛 EB	249,199.20	0.04
42	128046	利尔转债	249,102.13	0.04
43	127013	创维转债	248,892.00	0.04
44	132009	17 中油 EB	248,768.80	0.04
45	110033	国贸转债	248,653.00	0.04
46	113011	光大转债	248,650.80	0.04
47	132006	16 皖新 EB	248,630.00	0.04
48	113518	顾家转债	248,544.00	0.04
49	127006	敖东转债	248,464.40	0.04
50	110061	川投转债	248,404.00	0.04
51	128010	顺昌转债	248,368.80	0.04
52	113020	桐昆转债	248,178.20	0.04
53	113012	骆驼转债	248,013.10	0.04
54	132015	18 中油 EB	248,000.00	0.04
55	132017	19 新钢 EB	247,904.00	0.04
56	128087	孚日转债	247,479.20	0.04
57	113519	长久转债	247,358.40	0.04
58	128021	兄弟转债	247,276.80	0.04
59	123002	国祯转债	247,212.80	0.04
60	128018	时达转债	247,184.80	0.04
61	128075	远东转债	246,640.90	0.04
62	110034	九州转债	246,271.20	0.04
63	128039	三力转债	246,231.00	0.04
64	128071	合兴转债	246,217.20	0.04
65	128019	久立转 2	246,037.50	0.04
66	113516	苏农转债	245,868.20	0.04
67	113026	核能转债	245,852.40	0.04
68	128058	拓邦转债	245,595.90	0.04
69	113016	小康转债	245,590.50	0.04
70	110056	亨通转债	245,119.40	0.04
71	128022	众信转债	245,084.80	0.04
72	113021	中信转债	244,974.60	0.04
73	110045	海澜转债	244,802.80	0.04
74	110047	山鹰转债	244,728.70	0.04
75	110059	浦发转债	244,440.00	0.04
76	113530	大丰转债	244,422.20	0.04
77	110048	福能转债	244,138.50	0.04
78	113024	核建转债	244,122.00	0.04

79	110063	鹰 19 转债	244,045.30	0.04
80	110051	中天转债	244,023.90	0.04
81	128045	机电转债	243,868.00	0.04
82	128034	江银转债	243,858.80	0.04
83	127012	招路转债	243,766.60	0.04
84	110065	淮矿转债	243,635.70	0.04
85	110053	苏银转债	243,616.00	0.04
86	113532	海环转债	243,576.00	0.04
87	123023	迪森转债	243,550.00	0.04
88	113014	林洋转债	243,510.30	0.04
89	110042	航电转债	243,165.00	0.04
90	128032	双环转债	243,154.80	0.04
91	128033	迪龙转债	243,115.53	0.04
92	128081	海亮转债	243,055.80	0.04
93	113017	吉视转债	242,868.50	0.04
94	113543	欧派转债	242,560.50	0.04
95	113534	鼎胜转债	242,179.80	0.04
96	113025	明泰转债	242,065.20	0.04
97	128064	司尔转债	242,040.00	0.04
98	113508	新风转债	241,988.10	0.04
99	127011	中鼎转 2	241,947.20	0.04
100	113547	索发转债	241,506.90	0.04
101	110043	无锡转债	241,415.50	0.04
102	113527	维格转债	240,883.20	0.04
103	113009	广汽转债	240,328.80	0.04
104	123004	铁汉转债	239,268.90	0.04
105	110064	建工转债	239,042.00	0.04
106	110052	贵广转债	238,878.90	0.04
107	127007	湖广转债	238,797.20	0.04
108	110031	航信转债	238,392.70	0.04
109	113505	杭电转债	237,538.00	0.04
110	128085	鸿达转债	236,829.10	0.04
111	110041	蒙电转债	236,607.60	0.04
112	128044	岭南转债	235,388.40	0.04
113	128083	新北转债	167,135.76	0.03
114	113520	百合转债	131,264.00	0.02
115	132012	17 巨化 EB	112,665.00	0.02
116	132011	17 浙报 EB	111,720.00	0.02
117	113525	台华转债	111,657.00	0.02
118	132008	17 山高 EB	111,067.20	0.02
119	113030	东风转债	110,069.80	0.02
120	132014	18 中化 EB	105,872.00	0.02
121	127003	海印转债	99,459.00	0.02
122	128017	金禾转债	99,002.40	0.02

123	128037	岩土转债	94,245.20	0.02
-----	--------	------	-----------	------

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	002555	三七互娱	2,613,600.00	0.44	大宗交易
2	002602	世纪华通	2,256,000.00	0.38	大宗交易
3	300607	拓斯达	2,213,244.00	0.37	大宗交易

§ 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
海富通添鑫收益 债券 A	3,018	138,635.47	40,147,443.12	9.60%	378,254,390.78	90.40%
海富通添鑫收益 债券 C	1,210	147,613.90	23,180,130.50	12.98%	155,432,693.69	87.02%
合计	4,228	141,204.98	63,327,573.62	10.61%	533,687,084.47	89.39%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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	海富通添鑫收益债券 A	994.63	0.0002%
	海富通添鑫收益债券 C	5,134.15	0.0029%
	合计	6,128.78	0.0010%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通添鑫收益债券 A	0
	海富通添鑫收益债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通添鑫收益债券 A	0
	海富通添鑫收益债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 23 日）基金份额总额	418,401,833.90	178,612,824.19
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	418,401,833.90	178,612,824.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

1、2020 年 5 月 26 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，陶网雄先生由公司副总经理转任首席信息官。

2、2020 年 6 月 24 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，聘请王智慧先生担任公司副总经理职务。

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内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

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。

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

报告期内，本基金的管理人、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	
海通证券	2	52,376,148.63	100.00%	38,004.41	100.00%	-

注：1、本基金本报告期内租用券商交易单元没有发生变更。

2、（1）交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

（2）交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

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		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

海通证券	45,053,414.26	100.00%	1,678,100,000.00	100.00%	-	-
------	---------------	---------	------------------	---------	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通添鑫收益债券型证券投资基金份额发售公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-26
2	海富通基金管理有限公司关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金 A 类份额参加部分销售机构认购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-02
3	海富通基金管理有限公司关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-02
4	海富通基金管理有限公司关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金 A 类份额参加上海天天基金销售有限公司认购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-03
5	海富通基金管理有限公司关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金新增平安银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-03
6	海富通基金管理有限公司关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金新增销售机构并参加其认购费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-14
7	海富通基金管理有限公司关于海富通添鑫收益债券型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-15
8	海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
10	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
11	海富通基金管理有限公司关于延迟和耕传承基金销售有限公司代销旗下基金的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
12	海富通基金管理有限公司关于变更直销中心	证券时报、基金管理人网	2020-06-06

	交易传真号码的公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
13	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 83 只公募基金。截至 2020 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1338 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立海富通添鑫收益债券型证券投资基金的文件
- (二) 海富通添鑫收益债券型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通添鑫收益债券型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通添鑫收益债券型证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日