

**海富通添鑫收益债券型证券投资基金**  
**2022 年第 1 季度报告**  
**2022 年 3 月 31 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：二〇二二年四月二十二日

## §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。

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 2022 年 4 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	44,086,462.72 份
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。
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	
下属两级基金的基金简称	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C
下属两级基金的交易代码	008611	008610
报告期末下属两级基金的份额总额	7,938,793.12 份	36,147,669.60 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日)	
	海富通添鑫收益债券 A	海富通添鑫收益债券 C
1.本期已实现收益	-47,790.43	-296,024.25
2.本期利润	-408,755.84	-1,530,815.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0450	-0.0442
4.期末基金资产净值	8,493,417.81	38,372,653.68
5.期末基金份额净值	1.0699	1.0616

注：（1）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。

（2）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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 1、海富通添鑫收益债券 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
过去三个月	-3.92%	0.35%	-0.85%	0.16%	-3.07%	0.19%
过去六个	-2.24%	0.30%	0.35%	0.13%	-2.59%	0.17%

月						
过去一年	2.48%	0.31%	2.52%	0.12%	-0.04%	0.19%
自基金合同生效起至今	6.99%	0.32%	5.74%	0.13%	1.25%	0.19%

## 2、海富通添鑫收益债券 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
过去三个月	-4.01%	0.35%	-0.85%	0.16%	-3.16%	0.19%
过去六个月	-2.43%	0.30%	0.35%	0.13%	-2.78%	0.17%
过去一年	2.07%	0.31%	2.52%	0.12%	-0.45%	0.19%
自基金合同生效起至今	6.16%	0.32%	5.74%	0.13%	0.42%	0.19%

### 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的历史走势对比图

#### 1. 海富通添鑫收益债券 A

(2020 年 4 月 23 日至 2022 年 3 月 31 日)



## 2. 海富通添鑫收益债券 C

(2020 年 4 月 23 日至 2022 年 3 月 31 日)



注：本基金合同于 2020 年 4 月 23 日生效。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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈林海	本基金的基金经理	2021-04-29	-	10 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任上海从容投资管理有限公司研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、高级研究员。2015 年 9 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师。2020 年 5 月至 2021 年 4 月任量化投资部的基金经理助理。2021 年 4 月起任海富通添鑫收益债券基金经理。
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资总监兼债券基金部总监。	2020-04-23	-	13 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、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月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

				<p>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）基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月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。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转</p>
--	--	--	--	--

					债 ETF 基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。
--	--	--	--	--	---

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：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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年一季度，国内经济总体低位运行，增长压力较大。出口保持较高热度，部分制造业投资也有一些亮点；房地产销售、新开工、土地购置、投资等延续疲弱态势，消费受疫情反复影响也持续低迷，基建投资有所发力但尚不显著。1-2 月份主要经济指标好于市场此前悲观预期，既有财政前置发力影响，也受到低基数及价格因素的影响。2 月金融数据表明，一方面当前稳地产政策效果尚未有明显起色，另一方面企业真实融资需求仍然较弱；加上 3 月以来全国范围疫情的扩散及防疫措施的升级，经济下行压力

依然较大。国内政策仍以稳增长为核心，预计在 5.5% 左右的 GDP 增速目标下，偏弱的需求将带来稳增长政策进一步加码，货币政策、财政政策、产业政策等均在积极储备和出台。

海外社会、经济、金融环境在一季度出现了较大波折变化。欧美经济开始进入疫情后时代，线下活动逐渐恢复，但中上游大宗商品在多年投资不足、全球产业链持续偏紧的背景下维持高位运行，带来了海外通胀不断上行的压力。在这个背景下，美联储开始推动货币政策调整，3 月份第一次加息 25 个基点，目前预期后续还有几次加息的可能，这使得全球金融市场出现了一定幅度的波折。2 月下旬，俄乌局势超预期升级，进一步加剧了大宗商品供应紧张、全球工业产业链动荡、金融市场波折的形势；在“百年未有之大变局”下，整个市场的风险偏好显著回落。

在内滞外胀、俄乌形势压制风险偏好的背景下，一季度国内权益市场持续走弱，上游资源、稳增长、低估值价值等相对较好，而科技成长、泛消费、高估值等跌幅较大。A 股主要指数全面下跌，其中上证指数下跌 10.65%，沪深 300 下跌 14.53%，中证 800 下跌 14.42%，中小 100 下跌 18.64%，创业板指下跌 19.96%。根据中信一级行业分类，仅有 3 个行业收涨，分别是煤炭、房地产、银行，分别上涨 23.43%、6.20%、1.92%；表现最差的五个行业分别是电子、国防军工、汽车、家电、食品饮料，分别下跌 25.17%、23.48%、21.52%、20.29% 和 20.19%。全球经济、金融形势大动荡的背景下，此前被长期看好、相对较高估值的行业短期受冲击更显著一些。

报告期内，本基金权益部分以沪深 300 为基准，适度超配景气度高、估值合理、位置较低的子板块，相对重点布局了新兴产业上游。新兴产业企业的盈利能力在继续提升，由于前期资本开支不足，体现出较为明显的产业内部盈利向上游转移，中下游其他环节的盈利在被压缩，我们预计未来一年，甚至更长的时间，都会呈现这一状态。在当前个股普遍回调的时点，我们将继续努力寻找自身细分行业景气向上，且股价、估值又跌至相对底部的品种进行中长期布局，等待价值回归。一季度是我们挑战较大的一个季度，产品的波动率较大，这段时间我们进行了总结反思及产业链梳理比较，对未来的行业发展方向进行了各种推演、判断。希望在未来一年，我们能够给投资者带来更好的回报。

固定收益方面，一季度国内经济向上反弹，债券收益率总体先下后上。1 月经济下行压力不减，随后央行降息 10bp，为收益率下行打开空间。2 月全国多个省市房地产政策逐渐放松，信贷数据大超预期，市场宽信用预期成为收益率上行的主要力量。3 月上海疫情爆发，PMI 数据回到 50% 以下。投资方面，制造业投资延续 2021 年的高增速，在设备制造业方面表现出色；基建投资相关财政发力，增速强势反弹，成为一季度经济增长的主要力量；地产投资回正，但需求端偏弱仍未修复。一季度消费在疫情政策强调精准防控不得加码的要求下向上恢复。出口方面受到 2021 年高基数的影响同比增速出现下行。通胀方面，一季度猪肉价格下行，CPI 维持弱势；PPI 受到基数的影响同比回落。在此经济环境下，一季度货币政策维持宽松，年初央行调降政策利率 10bp，MLF 超量续作；财政政策托底经济，专项债超前发行。对应债市而言，1 月受到降息的影响，收益率迅速下行，10 年期国债收益率最低降至 2.7% 附近，2 月以地产与信贷为主的宽

信用力量成为主导，收益率再度上行至 2.8% 的水平。3 月初受到股债双杀，理财产品与公募基金遭遇赎回潮的影响收益率先上，随后信贷数据走弱，国内疫情反复，收益率再度小幅下行。整个一季度 10 年期国债收益率上行 0.2bp。

信用债方面，信用债收益率先下后上，1 月受降息落地、宽信用效果有限预期及资金面整体均衡影响，信用债跟随利率债收益率明显下行；2 月受海外央行偏鹰、金融数据显示宽信用有所成效、地产政策边际放松等因素影响，债市走弱；3 月基金赎回压力进一步带动利率调整。当前信用债收益率均在历史 25% 分位数以下，仍处于相对低位；信用利差呈现明显的期限分化，利差曲线较为陡峭。

可转债方面，一季度中证转债指数下跌 8.36%，下跌主要有两方面原因：其一，正股一季度持续走弱，转债跟跌；其二，溢价率一季度大幅压缩。

本组合在一季度根据市场预期调整利率债久期，努力获取波段增厚。同时，根据市场情况主动调整可转债资产仓位，以控制组合净值波动并努力获取绝对收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通添鑫收益债券 A 净值增长率为-3.92%，同期业绩比较基准收益率为-0.85%，基金净值跑输业绩比较基准 3.07 个百分点。海富通添鑫收益债券 C 净值增长率为-4.01%，同期业绩比较基准收益率为-0.85%，基金净值跑输业绩比较基准 3.16 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2021 年 11 月 3 日至 2022 年 1 月 25 日，连续五十九个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。自 2022 年 2 月 11 日至 2022 年 3 月 31 日，连续三十五个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,363,406.24	17.36
	其中：股票	8,363,406.24	17.36
2	固定收益投资	39,429,149.65	81.83
	其中：债券	39,429,149.65	81.83
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	382,567.10	0.79
7	其他资产	8,013.53	0.02
8	合计	48,183,136.52	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	157,080.00	0.34
B	采矿业	489,208.00	1.04
C	制造业	5,400,597.00	11.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	172,825.00	0.37
E	建筑业	169,785.00	0.36
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	131,110.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	262,630.00	0.56
J	金融业	1,261,046.00	2.69
K	房地产业	152,040.00	0.32
L	租赁和商务服务业	49,311.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	117,774.24	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	8,363,406.24	17.85
--	----	--------------	-------

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	3,600	496,800.00	1.06
2	300059	东方财富	18,000	456,120.00	0.97
3	002460	赣锋锂业	3,000	376,950.00	0.80
4	600519	贵州茅台	200	343,800.00	0.73
5	002466	天齐锂业	4,000	325,560.00	0.69
6	002142	宁波银行	8,000	299,120.00	0.64
7	600438	通威股份	6,000	256,140.00	0.55
8	601615	明阳智能	10,000	221,700.00	0.47
9	600887	伊利股份	6,000	221,340.00	0.47
10	300750	宁德时代	400	204,920.00	0.44

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	25,301,680.94	53.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,003,869.39	25.61
	其中：政策性金融债	12,003,869.39	25.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,123,599.32	4.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,429,149.65	84.13

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	178,320	18,232,189.16	38.90
2	018009	国开 1803	102,060	12,003,869.39	25.61
3	019664	21 国债 16	70,000	7,069,491.78	15.08
4	113534	鼎胜转债	180	48,125.24	0.10
5	123078	飞凯转债	230	44,805.01	0.10

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 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。

##### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的宁波银行（002142），因违规为存款人多头开立银行结算账户，超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料，占压财政存款，未按照规定履行客户身份识别义务，未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违规行为，于2021年7月13日被中国人民银行宁波市中心支行给予警告，并处罚款286.2万元。因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储，开发贷款支用审核不严，房地产贷款放款和支用环节审核不严，贷款资金违规流入房市，票据业务开展不审慎等行为，于2021年7月30日被宁波银保监局罚款人民币275万元，并责令公司对相关直接责任人给予纪律处分。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国性大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,013.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,013.53

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	--------------

1	113534	鼎胜转债	48,125.24	0.10
2	123078	飞凯转债	44,805.01	0.10
3	123086	海兰转债	44,021.11	0.09
4	127033	中装转 2	43,155.05	0.09
5	123085	万顺转 2	41,861.15	0.09
6	127006	敖东转债	41,627.72	0.09
7	127045	牧原转债	41,219.18	0.09
8	127040	国泰转债	41,047.34	0.09
9	110043	无锡转债	40,881.33	0.09
10	128139	祥鑫转债	40,512.19	0.09
11	128109	楚江转债	40,299.47	0.09
12	123120	隆华转债	39,726.33	0.08
13	127029	中钢转债	39,404.53	0.08
14	113037	紫银转债	31,287.42	0.07
15	113044	大秦转债	30,427.14	0.06
16	110077	洪城转债	29,718.17	0.06
17	123070	鹏辉转债	17,553.10	0.04
18	113585	寿仙转债	17,031.92	0.04
19	123060	苏试转债	16,013.67	0.03
20	110038	济川转债	15,922.55	0.03
21	128017	金禾转债	15,687.72	0.03
22	113025	明泰转债	15,351.21	0.03
23	110064	建工转债	14,940.43	0.03
24	123012	万顺转债	14,807.55	0.03
25	113599	嘉友转债	14,701.72	0.03
26	110079	杭银转债	14,696.72	0.03
27	128034	江银转债	14,676.38	0.03
28	127017	万青转债	14,673.26	0.03
29	128119	龙大转债	14,666.95	0.03
30	128048	张行转债	14,640.03	0.03
31	123100	朗科转债	14,634.85	0.03

32	128021	兄弟转债	14,574.92	0.03
33	113537	文灿转债	14,572.31	0.03
34	128025	特一转债	14,533.35	0.03
35	127032	苏行转债	14,529.47	0.03
36	110053	苏银转债	14,526.09	0.03
37	128095	恩捷转债	14,518.70	0.03
38	110076	华海转债	14,398.07	0.03
39	128081	海亮转债	14,333.65	0.03
40	113050	南银转债	14,327.65	0.03
41	113047	旗滨转债	14,322.71	0.03
42	123048	应急转债	14,304.02	0.03
43	128134	鸿路转债	14,291.28	0.03
44	110070	凌钢转债	14,239.39	0.03
45	113045	环旭转债	14,237.90	0.03
46	127044	蒙娜转债	14,167.19	0.03
47	113516	苏农转债	14,141.47	0.03
48	123107	温氏转债	14,113.36	0.03
49	127030	盛虹转债	14,112.86	0.03
50	127016	鲁泰转债	14,111.43	0.03
51	128101	联创转债	14,099.51	0.03
52	113627	太平转债	14,058.32	0.03
53	110048	福能转债	14,039.83	0.03
54	127043	川恒转债	14,036.37	0.03
55	110045	海澜转债	14,022.35	0.03
56	123101	拓斯转债	14,004.13	0.03
57	113011	光大转债	13,990.05	0.03
58	113605	大参转债	13,983.02	0.03
59	128114	正邦转债	13,970.42	0.03
60	128026	众兴转债	13,964.60	0.03
61	118000	嘉元转债	13,960.87	0.03
62	128141	旺能转债	13,948.56	0.03

63	123022	长信转债	13,940.64	0.03
64	113602	景 20 转债	13,935.52	0.03
65	113629	泉峰转债	13,929.79	0.03
66	123063	大禹转债	13,922.13	0.03
67	113043	财通转债	13,909.76	0.03
68	113621	彤程转债	13,868.12	0.03
69	110073	国投转债	13,863.21	0.03
70	113579	健友转债	13,861.22	0.03
71	127018	本钢转债	13,800.47	0.03
72	123056	雪榕转债	13,793.15	0.03
73	128063	未来转债	13,746.41	0.03
74	113582	火炬转债	13,724.78	0.03
75	110059	浦发转债	13,721.45	0.03
76	128029	太阳转债	13,718.59	0.03
77	127012	招路转债	13,716.90	0.03
78	113048	晶科转债	13,708.81	0.03
79	128105	长集转债	13,699.33	0.03
80	113615	金诚转债	13,689.62	0.03
81	127024	盈峰转债	13,689.28	0.03
82	113024	核建转债	13,645.76	0.03
83	127005	长证转债	13,641.47	0.03
84	113042	上银转债	13,616.94	0.03
85	123108	乐普转 2	13,571.06	0.03
86	110063	鹰 19 转债	13,566.60	0.03
87	110047	山鹰转债	13,552.88	0.03
88	110060	天路转债	13,543.17	0.03
89	123035	利德转债	13,540.17	0.03
90	123104	卫宁转债	13,534.50	0.03
91	123044	红相转债	13,533.76	0.03
92	110074	精达转债	13,507.73	0.03
93	113626	伯特转债	13,506.60	0.03

94	113013	国君转债	13,427.68	0.03
95	113584	家悦转债	13,391.89	0.03
96	128023	亚太转债	13,339.86	0.03
97	123114	三角转债	13,185.24	0.03
98	113545	金能转债	13,142.04	0.03
99	128046	利尔转债	13,114.48	0.03
100	110081	闻泰转债	13,032.16	0.03
101	113622	杭叉转债	12,978.74	0.03
102	113550	常汽转债	12,949.42	0.03
103	110061	川投转债	12,944.90	0.03
104	113568	新春转债	12,881.55	0.03
105	127020	中金转债	12,837.39	0.03
106	113525	台华转债	12,835.62	0.03
107	123067	斯莱转债	12,778.69	0.03
108	113051	节能转债	12,719.45	0.03
109	123083	朗新转债	12,618.47	0.03
110	113504	艾华转债	12,541.35	0.03
111	128137	洁美转债	10,964.22	0.02

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## §6 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
本报告期期初基金份额总额	11,095,074.58	30,099,882.61
本报告期基金总申购份额	104,728.79	8,189,852.51
减：本报告期基金总赎回份额	3,261,010.25	2,142,065.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,938,793.12	36,147,669.60

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过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	2022/2/15-2022/3/31	3,160,013.98	5,942,770.34	-	9,102,784.32	20.65%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

### 8.2 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 109 只公募基金。截至 2022 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1406 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。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再度被权威媒体《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。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 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。

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二二年四月二十二日