

汇添富双鑫添利债券型证券投资基金 2024 年 第 2 季度报告

2024 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：2024 年 07 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|---------------|---|
| 基金简称 | 汇添富双鑫添利债券 |
| 基金主代码 | 004451 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 01 月 18 日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 3,557,930,652.26 |
| 投资目标 | 在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取稳健的投资策略，通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资 |

| | | |
|--------------------|---|----------------|
| | 策略、国债期货投资策略等。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深300 指数收益率*7%+恒生指数收益率（经汇率调整）*3%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，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。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富双鑫添利债券 A | 汇添富双鑫添利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004451 | 004452 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 3,454,888,852.64 | 103,041,799.62 |

§ 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(2024 年 04 月 01 日 - 2024 年 06 月 30 日) | |
|-----------------|--|----------------|
| | 汇添富双鑫添利债券 A | 汇添富双鑫添利债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 21,489,181.94 | 20,647.40 |
| 2. 本期利润 | 43,693,752.61 | -285,024.15 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0168 | -0.0090 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,849,570,074.90 | 110,743,964.10 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1142 | 1.0747 |

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) 扣除相关费用和信用减值损失后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

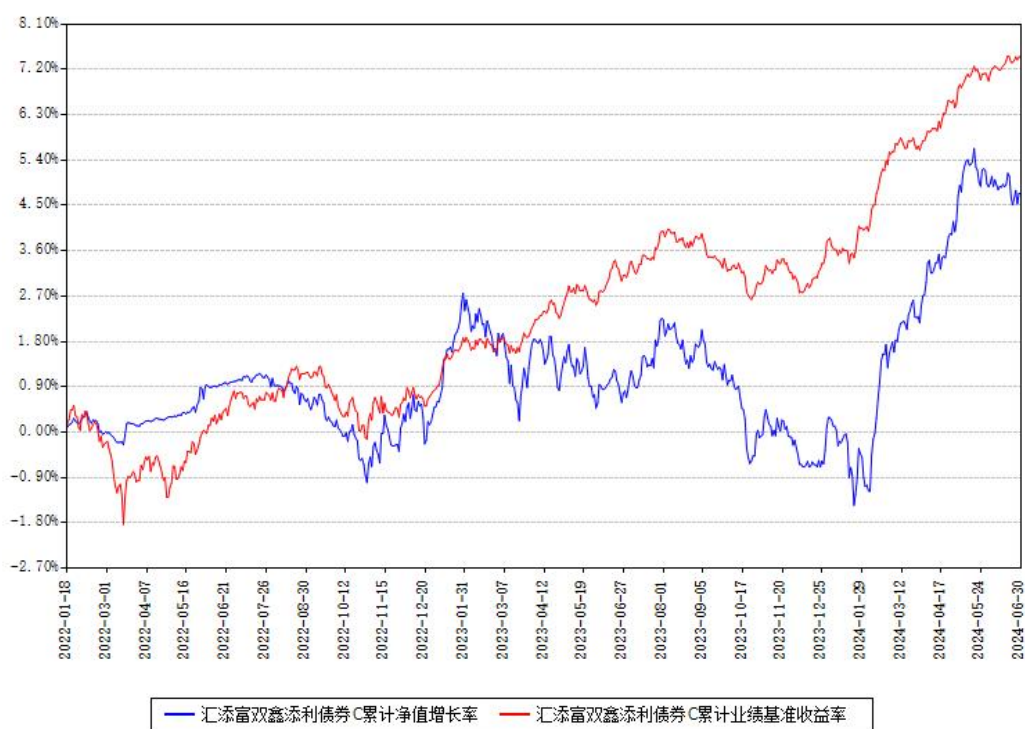
| 汇添富双鑫添利债券 A | | | | | | |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
| 过去三个月 | 2.04% | 0.18% | 1.59% | 0.08% | 0.45% | 0.10% |
| 过去六个月 | 4.60% | 0.22% | 3.47% | 0.09% | 1.13% | 0.13% |
| 过去一年 | 4.24% | 0.20% | 4.17% | 0.09% | 0.07% | 0.11% |
| 自基金合同生效日起至今 | 5.74% | 0.18% | 7.45% | 0.11% | -1.71% | 0.07% |
| 汇添富双鑫添利债券 C | | | | | | |
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
| 过去三个月 | 1.96% | 0.18% | 1.59% | 0.08% | 0.37% | 0.10% |
| 过去六个月 | 4.43% | 0.22% | 3.47% | 0.09% | 0.96% | 0.13% |
| 过去一年 | 3.85% | 0.20% | 4.17% | 0.09% | -0.32% | 0.11% |
| 自基金合同生效日起至今 | 4.74% | 0.18% | 7.45% | 0.11% | -2.71% | 0.07% |

3.2.2 自基金转型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

汇添富双鑫添利债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富双鑫添利债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2022年01月18日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金由原汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金于 2022 年 01 月 18 日转型而来。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限（年） | 说明 |
|-----|---------------------|------------------|------|-----------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐一恒 | 本基金的基金经理, 固收研究部副总经理 | 2020 年 06 月 04 日 | - | 14 | <p>国籍：中国。</p> <p>学历：武汉大学金融工程硕士。</p> <p>从业资格：证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历：2010 年 9 月至 2014 年 12 月任汇添富基金管理股份有限公司债券分析师，2014 年 12 月至 2019 年 8 月任汇添富基金管理股份有限公司专户投资经理，现任固收研究部副总经理。2019 年 9 月 4 日至 2021 年 9 月 2 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 4 日至 2021 年 9 月 2 日任汇添富鑫远债券型证券投资</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 6 月 4 日至 2023 年 5 月 12 日任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 6 月 4 日至 2022 年 10 月 10 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 6 月 4 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 6 月 4 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 8 月 5 日至今任汇添富稳健收益混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 9 月 10 日至今任汇添富稳健添盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月</p> |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|--------------------|------------------|---|----|--|
| | | | | | <p>9 日至 2023 年 11 月 6 日任汇添富稳进双盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富鑫裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> |
| 吴江宏 | 本基金的基金经理, 稳健收益部总经理 | 2022 年 08 月 10 日 | - | 13 | <p>国籍：中国。 学历：厦门大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历： 2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益分析师，现任稳健收益部总经理。 2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>经理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起</p> |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>式证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 日任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利</p> |
|--|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投</p> |
|--|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月 25 日至今任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 10 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 3 月 4 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

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。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律

法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本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成交量的 5% 的情况有 5 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本

报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，中国经济经历了由复苏向稳态的转变。具体表现为，生产端持续修复，出口和制造业链条的增长速度较快。但国内消费需求的恢复相对缓慢，房地产投资增长乏力形成一定拖累。政策方面，各项经济政策部署加快落地，特别是在房地产领域，政策从供给端转向了供需两端的协同发力。财政政策方面，超长期特别国债启动发行，国债和专项债发行速度也有所加快；货币政策方面，央行继续通过公开市场操作，维持合理充裕的市场流动性。

报告期内，债券市场整体呈现出以安全资产荒为主导的震荡下行趋势。4 月上中旬债券市场出现一定回调，尤其是长端利率品种出现较大幅度上行，市场波动率有所放大。5 月份随着流动性的充裕和市场对安全资产的追求，债券收益率水平全面下行，至 6 月末达到了新的低点。从曲线结构上看，由于资金分层现象的消失，中短端债券的下行更为显著，曲线呈现出陡峭化的趋势；同时机构投资者的配置情绪高涨，信用利差被压缩至较为极致的水平。

报告期内，股票市场震荡下行，沪深 300 指数下跌 2.42%，中证 500 下跌 6.5%，创业板指下跌 7.41%。市场分化依然较大，风格层面价值表现强于成长，大盘强于中小盘。分行业看，公用事业、电力、交运等传统行业因高股息表现较好，全球定价的上游资源受益于商品价格上涨出现不同幅度上涨。而房地产、中游制造、消费等顺周期行业则表现一般。二季度转债市场大体跟随股票波动，但由于转债中银行比例较高，指数表现优于股票，中证转债上涨 0.75%。6 月以来，市场担忧个别转债的退市、信用风险，集中抛售评级较低的低价转债，带动低价转债大幅调整，二季度万得可转债低价指数下跌 0.09%，弱于中证转债指数。

报告期内，债券方面，组合合理运用杠杆，根据市场波动积极调整久期，并重点配置了高等级信用债券，同时适度参与利率债券的交易。转债方面，组合主要配置信用风险可控的低价转债。股票方面，权益仓位有所降低，主要减持了消费行业和部分高估值成长股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富双鑫添利债券 A 类份额净值增长率为 2.04%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。本报告期汇添富双鑫添利债券 C 类份额净值增长率为 1.96%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 660,375,808.39 | 14.87 |
| | 其中：股票 | 660,375,808.39 | 14.87 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 3,699,458,250.12 | 83.33 |
| | 其中：债券 | 3,699,458,250.12 | 83.33 |
| | 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 | 13,900,000.00 | 0.31 |
| | 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 | 33,817,635.05 | 0.76 |
| 8 | 其他资产 | 32,072,573.74 | 0.72 |
| 9 | 合计 | 4,439,624,267.30 | 100.00 |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 323,324,045.43 元，占期末净值比例为 8.16%。

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 | — | — |
| B | 采矿业 | 45,510,680.00 | 1.15 |
| C | 制造业 | 254,240,270.60 | 6.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,875,000.00 | 0.43 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|------|
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,717,680.00 | 0.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 51,285.00 | 0.00 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 9,696,000.00 | 0.24 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,929,977.36 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 30,870.00 | 0.00 |
| 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 | 337,051,762.96 | 8.51 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 10 能源 | 110,698,181.42 | 2.80 |
| 15 原材料 | 5,424,057.24 | 0.14 |
| 20 工业 | 9,039,337.88 | 0.23 |
| 25 可选消费 | 43,236,280.12 | 1.09 |
| 30 日常消费 | 16,709,436.71 | 0.42 |
| 35 医疗保健 | 6,597,535.55 | 0.17 |
| 40 金融 | 1,672,029.76 | 0.04 |
| 45 信息技术 | 6,458,078.05 | 0.16 |
| 50 电信服务 | 99,025,780.00 | 2.50 |
| 55 公用事业 | 24,429,377.00 | 0.62 |

| | | |
|--------|----------------|------|
| 60 房地产 | 33,951.70 | 0.00 |
| 合计 | 323,324,045.43 | 8.16 |

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 00883 | 中国海洋石油 | 5,300,000 | 108,353,369.60 | 2.74 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 250,000 | 84,970,508.00 | 2.15 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 24,200 | 35,510,838.00 | 0.90 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 2,000,000 | 35,140,000.00 | 0.89 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 799,960 | 31,446,427.60 | 0.79 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 450,000 | 29,025,000.00 | 0.73 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 160,000 | 28,804,800.00 | 0.73 |
| 8 | 01816 | 中广核电力 | 7,781,000 | 24,429,377.00 | 0.62 |
| 9 | 03690 | 美团-W | 170,000 | 17,237,787.00 | 0.44 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| | | | | 16 | |
| 10 | 600674 | 川投能源 | 900,000 | 16,875,000.00 | 0.43 |

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 | 693,386,507.91 | 17.51 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 648,832,125.94 | 16.38 |
| | 其中：政策性金融债 | 304,428,007.27 | 7.69 |
| 4 | 企业债券 | 1,338,680,603.85 | 33.80 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 601,885,487.14 | 15.20 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 416,673,525.28 | 10.52 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 地方政府债 | - | - |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 3,699,458,250.12 | 93.41 |

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 | 019735 | 24 国债 04 | 6,700,000 | 682,269,260.30 | 17.23 |
| 2 | 230421 | 23 农发 21 | 1,100,000 | 112,010,535.52 | 2.83 |

| | | | | | |
|---|-----------|------------------------------|---------|-------------------|------|
| 3 | 111100 | 20 川交 01 | 800,000 | 84,079,145. 21 | 2.12 |
| 4 | 232480020 | 24 兴业银行 二级资本债 01 | 800,000 | 81,095,342. 47 | 2.05 |
| 5 | 102481651 | 24 华润建材 MTN001(可持 续挂钩) | 800,000 | 80,795,484. 93 | 2.04 |

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,中国农业发展银行、兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 188,588.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | 28,446,566.10 |
| 3 | 应收股利 | 3,369,545.89 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 67,873.10 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 32,072,573.74 |

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 | 113052 | 兴业转债 | 67,158,804.59 | 1.70 |
| 2 | 110081 | 闻泰转债 | 35,639,149.92 | 0.90 |
| 3 | 113059 | 福莱转债 | 32,043,616.44 | 0.81 |
| 4 | 111010 | 立昂转债 | 23,705,719.40 | 0.60 |
| 5 | 127045 | 牧原转债 | 22,866,749.86 | 0.58 |
| 6 | 128134 | 鸿路转债 | 16,062,935.29 | 0.41 |
| 7 | 113655 | 欧 22 转债 | 14,041,513.70 | 0.35 |
| 8 | 113050 | 南银转债 | 12,541,208.22 | 0.32 |
| 9 | 123113 | 仙乐转债 | 12,188,000.00 | 0.31 |
| 10 | 110087 | 天业转债 | 12,141,662.47 | 0.31 |
| 11 | 110082 | 宏发转债 | 10,613,321.92 | 0.27 |
| 12 | 113661 | 福 22 转债 | 9,596,440.08 | 0.24 |
| 13 | 113652 | 伟 22 转债 | 9,105,482.92 | 0.23 |
| 14 | 111004 | 明新转债 | 7,438,468.49 | 0.19 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 15 | 118022 | 锂科转债 | 6,944,575.34 | 0.18 |
| 16 | 110089 | 兴发转债 | 6,742,742.47 | 0.17 |
| 17 | 127073 | 天赐转债 | 6,728,540.27 | 0.17 |
| 18 | 127049 | 希望转 2 | 6,210,154.52 | 0.16 |
| 19 | 118005 | 天奈转债 | 5,993,383.56 | 0.15 |
| 20 | 127044 | 蒙娜转债 | 5,886,550.68 | 0.15 |
| 21 | 113666 | 爱玛转债 | 5,706,513.70 | 0.14 |
| 22 | 123178 | 花园转债 | 5,673,672.39 | 0.14 |
| 23 | 127022 | 恒逸转债 | 5,421,142.84 | 0.14 |
| 24 | 123169 | 正海转债 | 5,405,143.84 | 0.14 |
| 25 | 113644 | 艾迪转债 | 5,242,981.96 | 0.13 |
| 26 | 123115 | 捷捷转债 | 5,175,782.71 | 0.13 |
| 27 | 113641 | 华友转债 | 5,073,350.69 | 0.13 |
| 28 | 111014 | 李子转债 | 4,653,890.60 | 0.12 |
| 29 | 118031 | 天 23 转债 | 4,642,561.64 | 0.12 |
| 30 | 113062 | 常银转债 | 4,480,580.40 | 0.11 |
| 31 | 113650 | 博 22 转债 | 3,408,449.00 | 0.09 |
| 32 | 127016 | 鲁泰转债 | 3,397,723.56 | 0.09 |
| 33 | 113656 | 嘉诚转债 | 3,234,041.76 | 0.08 |
| 34 | 123193 | 海能转债 | 3,163,997.26 | 0.08 |
| 35 | 128124 | 科华转债 | 2,943,269.59 | 0.07 |
| 36 | 118000 | 嘉元转债 | 2,795,124.66 | 0.07 |
| 37 | 123165 | 回天转债 | 2,557,927.99 | 0.06 |
| 38 | 110073 | 国投转债 | 2,337,976.90 | 0.06 |
| 39 | 113660 | 寿 22 转债 | 2,229,525.48 | 0.06 |
| 40 | 127087 | 星帅转 2 | 2,193,881.92 | 0.06 |
| 41 | 113616 | 韦尔转债 | 2,003,987.71 | 0.05 |
| 42 | 113640 | 苏利转债 | 1,847,717.81 | 0.05 |
| 43 | 118008 | 海优转债 | 1,632,280.55 | 0.04 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 44 | 123124 | 晶瑞转 2 | 1,604,842.84 | 0.04 |
| 45 | 123170 | 南电转债 | 1,280,020.00 | 0.03 |
| 46 | 113061 | 拓普转债 | 1,186,986.03 | 0.03 |
| 47 | 113053 | 隆 22 转债 | 1,082,623.79 | 0.03 |
| 48 | 118035 | 国力转债 | 1,058,308.22 | 0.03 |
| 49 | 127074 | 麦米转 2 | 702,649.32 | 0.02 |
| 50 | 113638 | 台 21 转债 | 479,759.27 | 0.01 |
| 51 | 123208 | 孩王转债 | 216,609.75 | 0.01 |
| 52 | 123154 | 火星转债 | 191,180.96 | 0.00 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 汇添富双鑫添利债券 A | 汇添富双鑫添利债券 C |
|---------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,950,142,837.36 | 1,921,937.63 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,600,157,741.88 | 102,326,211.23 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 95,411,726.60 | 1,206,349.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,454,888,852.64 | 103,041,799.62 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富双鑫添利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富双鑫添利债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富双鑫添利债券型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号

汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 07 月 19 日