

# 汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 08 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 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
1.2 目录 .....	3
§ 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合规守信情况的说明 .....	11
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
§ 5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	15
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
§ 7 投资组合报告 .....	45
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
7.3 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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	45
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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§ 8 基金份额持有人信息 .....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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情况.....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	49
§ 9 开放式基金份额变动 .....	49
§ 10 重大事件揭示 .....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
11.1 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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§ 12 备查文件目录 .....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富鑫益定开债	
基金主代码	004469	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 27 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	1,509,707,385.14	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富鑫益定开债 A	汇添富鑫益定开债 C
下属分级基金的交易代码	004469	004470
报告期末下属分级基金的 份额总额(份)	1,509,691,949.18	15,435.96

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在科学严格管理风险的前提下，本基金力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。本基金封闭期的投资策略主要包括：类属资产配置策略、普通债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。开放运作期内，为满足投资者申赎需求，本基金在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
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	中国工商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95588	
传真	021-28932998	010-66105798	
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号	
办公地址	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区复兴门内大街55号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	李文	陈四清	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼

## § 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(2021年01月01日 - 2021年06月30日)	
	汇添富鑫益定开债 A	汇添富鑫益定开债 C
本期已实现收益	21,448,660.47	183.10
本期利润	17,268,091.36	141.13
加权平均基金份额本期利润	0.0114	0.0091
本期加权平均净值利润率	1.06%	0.86%
本期基金份额净值增长率	1.07%	0.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)	
期末可供分配利润	124,508,762.45	986.52
期末可供分配基金份额利润	0.0825	0.0639

期末基金资产净值	1,634,200,711.63	16,422.48
期末基金份额净值	1.0825	1.0639
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.75%	3.11%

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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富鑫益定开债 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	-0.01%	0.02%	-0.04%	0.03%	0.03%	-0.01%
过去三个月	0.29%	0.02%	0.45%	0.03%	-0.16%	-0.01%
过去六个月	1.07%	0.02%	0.65%	0.04%	0.42%	-0.02%
过去一年	1.99%	0.02%	-0.20%	0.06%	2.19%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	3.75%	0.03%	0.64%	0.08%	3.11%	-0.05%
汇添富鑫益定开债 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	-0.05%	0.02%	-0.04%	0.03%	-0.01%	-0.01%
过去三	0.18%	0.02%	0.45%	0.03%	-0.27%	-0.01%

个月						
过去六个月	0.86%	0.02%	0.65%	0.04%	0.21%	-0.02%
过去一年	1.57%	0.02%	-0.20%	0.06%	1.77%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	3.11%	0.03%	0.64%	0.08%	2.47%	-0.05%

### 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

汇添富鑫益定开债A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





汇添富鑫益定开债C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金由原汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金于2019年12月27日转型而来。  
2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本金为132,724,224元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，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。

2021 上半年，汇添富基金新成立 21 只公开募集证券投资基金，包括 7 只股票型基金、13 只混合型基金、1 只债券型基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 189 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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
徐一恒	本基金的基金经理	2019 年 09 月 04 日		11	国籍:中国。学历:武汉大学金融工程学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。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。2019 年 9 月 4 日至今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 日至今任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 4 日至今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。2020 年 6 月 4 日至今任汇添富年年泰定期

					<p>开放混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 4 日至今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。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 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。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 9 日至今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。</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“离任日期”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。

#### 4.1.3 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作,实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析,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溢价率进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易,再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实,本报告期内,本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易,也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价异常的情况。

#### 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,本公司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14次,投资组合经理因投资组合的投资策略与其他组合发生同日反向交易,相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批,事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 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

2021年上半年,货币信用周期受到财政政策与监管政策的影响,财政发债节奏放缓与财政项目投放保持正常并存,叠加房地产企业“三道红线”等监管政策,这促使中性的货币

政策呈现出宽货币-紧信用的周期特征。这带给我们的启示与 2013 年美联储退出 QE 政策前的“TaperTantrum”一致，货币-信用的金融市场流动性波动不是单变量体系，而是货币政策、财政政策、监管政策与市场主体共同作用的结果。在相对宽裕的流动性推动下，债券收益率整体下行，全市场信用利差回落，但个别信用边缘主体债券收益率水平仍大幅上行。

报告期内，3 个月 Shibor 利率从年初的 2.75%到 1 月底下行至 2.58%，并在 2 月上升至 2.85%，随后一路下行至 2.40%，节奏与之类似，10 年期国债利率从 3.10%上行至 3.28%，并最终回落至 2.83%，3 年期 AAA 级信用债利率由 3.40%上行至 3.73%，并最终回落至 3.05%的水平。中低等级债券内部分化剧烈，优质城投 AA 级信用债利率整体回落，3 年优质 AA 城投收益从 4.4%回落至 3.70%水平，民企产业债与弱资质城投债收益持续上升。

报告期内，组合维持高等级信用债与商业银行金融债为主的配置状态。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 1.07%;C 类基金份额净值增长率为 0.86%。同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们分解驱动债券资产的底层宏观风险因子（经济状态、通胀状态、流动性状态与极端事件），力图将复杂的资产价格波动转化为多个更具有研究性的问题，并以此对债券投资策略的关键性假设展开情景分析，最终落地形成债券细分资产的胜率-盈亏比判断。

经济增长面临全球疫情反复与宽松财政-货币政策持续性的综合作用，国内经济仍处于同比上行趋势，但环比增速正在快速回落，正如大中小型企业 PMI 所展示的，经济结构性分化愈演愈烈。通胀压力更多来源于输入性通胀，这决定了 PPI 数值对货币政策的影响相对较低，如果考虑持续为负的 CPI-PPI 利差所表征的小微企业利润大幅压缩，当前通胀状态将支持积极的货币-财政政策，以缓解小微企业与全社会就业压力。在这样的经济与通胀状态定位上，财政与货币政策预计在下半年将保持中性偏松的状态，货币全面收紧引致系统性资金紧张的概率较低，地方债发行与财政投放有望加速。全球性的极端事件风险正在持续的从极高水平逐步向正常水平回落。

基于上述经济、通胀、流动性与极端事件的底层宏观因子形成的基准情景假设，名义无风险利率中枢大概率处于震荡区间，过去 10 年无风险利率运行的中枢（10 年期国债 3.50%）可能成为目前利率运行的上限，MLF 利率可能成为 10 年期国债新的中枢水平。目前高等级信用利差已经处于历史极低水平，同期限利率债的性价比显著强于信用品种，但考虑到信用债发债主体的快速减少，这种极低的信用利差可能有所修复，但短期很难恢复到历史中枢水

平。边缘信用主体的风险逐步加大，被显著拉大的低等级信用利差很难回到过往水平。这种信用利差的分化在信用风险定价市场化的过程中不可避免，短期会加大信用资产的投资难度，从长期看将奖励信用研究，只有深度研究才能理解信用风险本源，并掌握定价能力。

在下一个运作期，本组合将秉承我们长期以来坚持的投资方法，基于中长期货币-信用周期判断调整久期与杠杆水平，严控持仓信用风险，精选个券，关注市场变化并及时应对调整，力争为持有人获取稳健的投资收益。

#### 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》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、风险管理及合规稽核人员、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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相应类别的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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公

开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内,汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,716,955.71	3,201,357.27
结算备付金		-	-
存出保证金		-	1,010.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,712,823,000.00	1,654,556,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,709,823,000.00	1,654,556,000.00

资产支持证券投资		3,000,000.00	-
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	31,544,689.68	25,191,519.22
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		1,748,084,645.39	1,682,949,887.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>负 债:</b>			
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		112,954,590.57	64,999,782.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		537,182.51	545,904.15
应付托管费		134,295.64	136,476.05
应付销售服务费		5.40	5.58
应付交易费用	6.4.7.7	7,748.75	7,903.12
应交税费		60,447.18	83,886.08
应付利息		74,062.28	26,480.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,178.95	200,000.00
负债合计		113,867,511.28	66,000,437.92
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,509,707,385.14	1,509,707,894.98
未分配利润	6.4.7.1 0	124,509,748.97	107,241,554.27
所有者权益合计		1,634,217,134.11	1,616,949,449.25
负债和所有者权益总计		1,748,084,645.39	1,682,949,887.17

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,509,707,385.14 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.0825 元，基金份额总额 1,509,691,949.18 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.0639 元，基金份额总额 15,435.96 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金



本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>22,135,803.82</b>	<b>31,928,489.30</b>
1. 利息收入		29,674,284.51	32,566,704.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,007.87	21,148.90
债券利息收入		29,594,678.45	32,545,556.02
资产支持证券利息收入		1,564.06	-
买入返售金融资产收入		36,034.13	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,357,869.61	-1,296,462.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-3,357,869.61	-1,296,462.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-4,180,611.08	658,246.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>4,867,571.33</b>	<b>5,757,767.47</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,229,252.32	3,178,471.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	807,313.11	794,617.81
3. 销售服务费		32.58	136.00
4. 交易费用	6.4.7.20	1,175.00	2,995.61
5. 利息支出		656,720.99	1,603,735.17
其中：卖出回购金融资产支出		656,720.99	1,603,735.17
6. 税金及附加		50,084.43	50,981.86
7. 其他费用	6.4.7.21	122,992.90	126,829.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>17,268,232.49</b>	<b>26,170,721.83</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>17,268,232.49</b>	<b>26,170,721.83</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 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)	1,509,707,894.98	107,241,554.27	1,616,949,449.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,268,232.49	17,268,232.49
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)	-509.84	-37.79	-547.63
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-509.84	-37.79	-547.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,509,707,385.14	124,509,748.97	1,634,217,134.11
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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)	1,509,760,484.80	66,477,894.02	1,576,238,378.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,170,721.83	26,170,721.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,586.71	-94.05	-1,680.76

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-1,586.71	-94.05	-1,680.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,509,758,898.09	92,648,521.80	1,602,407,419.89

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>张晖</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

汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金(原“汇添富鑫益定期开放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[2016]2560号文《关于准予汇添富鑫益定期开放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日正式生效,首次设立募集规模为1,500,357,151.21份基金份额。

2019年11月28日,汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开,会议审议通过了《关于汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金转型的议案》,内容包括汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金采取发起式基金形式及修订基金合同等,并同意将汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金更名为“汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金”,上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2019年12月27日起,《汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效,《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。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与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

中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、可转换债券（含可交换债券）、可分离债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、次级债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金不主动投资股票和权证，因持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，应当在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。本基金在科学严格管理风险的前提下，力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

#### 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（以下合称“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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》、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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

#### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

农村教育事业费附加的单位外) 及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

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

### 6.4.7 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 2021年06月30日
活期存款	3,716,955.71
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	3,716,955.71

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	122,003,120.55	120,506,000.00	-1,497,120.55
	银行间市场	1,592,323,337.91	1,589,317,000.00	-3,006,337.91
	其他	-	-	-
	合计	1,714,326,458.46	1,709,823,000.00	-4,503,458.46
资产支持证券	3,000,000.00	3,000,000.00	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,717,326,458.46	1,712,823,000.00	-4,503,458.46	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

## 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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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
----	-----

	2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	374.06
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	-
应收债券利息	31,542,704.66
应收资产支持证券利息	1,610.96
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	-
合计	31,544,689.68

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	7,748.75
合计	7,748.75

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 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	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	99,178.95

#### 6.4.7.9 实收基金



金额单位：人民币元

汇添富鑫益定开债 A		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,509,692,459.02	1,509,692,459.02
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-509.84	-509.84
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,509,691,949.18	1,509,691,949.18
汇添富鑫益定开债 C		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,435.96	15,435.96
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,435.96	15,435.96

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富鑫益定开债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,508,291.48	-267,582.60	107,240,708.88
本期利润	21,448,660.47	-4,180,569.11	17,268,091.36
本期基金份	-37.06	-0.73	-37.79

额交易产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-37.06	-0.73	-37.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	128,956,914.89	-4,448,152.44	124,508,762.45
汇添富鑫益定开债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	846.99	-1.60	845.39
本期利润	183.10	-41.97	141.13
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	1,030.09	-43.57	986.52

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	42,007.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	0.18
合计	42,007.87

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	236,845,600.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	233,357,869.61
减：应收利息总额	6,845,600.00
买卖债券差价收入	-3,357,869.61

#### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,180,611.08
——股票投资	-
——债券投资	-4,180,611.08
——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	-
——期货投资	-
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	-4,180,611.08

#### 6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	1,175.00
合计	1,175.00

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	5,213.95
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	122,992.90

## 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机

	构, 基金发起人
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 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

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	-	-	20,227,882.19	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

#### 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,229,252.32	3,178,471.41
其中: 支付销售机构的客户维护费	-	-

注: 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	807,313.11	794,617.81

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 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联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富鑫益定开债 A	汇添富鑫益定开债 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	32.58	32.58
合计	-	32.58	32.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富鑫益定开债 A	汇添富鑫益定开债 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	136.00	136.00
合计	-	136.00	136.00

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 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

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

#### 6.4.10.4 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

份额单位：份

汇添富鑫益定开债 A		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2019 年 12 月 27 日）持有的基	-	-

金份额		
报告期初持有的基金份额	9,591,406.10	9,591,406.10
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,591,406.10	9,591,406.10
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	0.64	0.64
汇添富鑫益定开债 C		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2019 年 12 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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

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。

#### 6.4.10.6 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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
工商银	3,716,955.71	42,007.69	1,530,175.74	21,148.90



行				
---	--	--	--	--

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 6.4.12 期末（2021 年 06 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
					-	-	-	-	-	
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	流通受限类型	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
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
189549	G3	2021 年	2021 年	新资	100.00	100.00	30,000	3,000,000.00	3,000,000.00	

	电 建 3 A	06 月 23 日	08 月 02 日	产 支 持 证 券 未 上 市					
--	------------------	--------------------	--------------------	--------------------------------------	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金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 112,954,590.57 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1605612	16 辽宁 债 18	2021 年 07 月 01 日	100.08	540,000	54,043,200.00
1780085	17 铁道 06	2021 年 07 月 01 日	101.47	649,000	65,854,030.00
合计				1,189,000	119,897,230.00

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组

织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	100,040,000.00	99,980,000.00
合计	100,040,000.00	99,980,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	1,409,453,000.00	1,503,741,000.00
AAA 以下	50,055,000.00	50,835,000.00
未评级	150,275,000.00	-
合计	1,609,783,000.00	1,554,576,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	3,000,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	3,000,000.00	-

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日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。

##### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 20 21 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以 上	不 计 息	合 计
资 产							
银 行 存 款	3,716,955 .71	-	-	-	-	-	3,716,955.7 1
结 算 备 付 金	-	-	-	-	-	-	-
存 出 保 证 金	-	-	-	-	-	-	-
交 易 性 金 融 资 产	231,176,0 00.00	342,391,0 00.00	476,147,0 00.00	663,109,0 00.00	-	-	1,712,823,0 00.00
应 收 股	-	-	-	-	-	-	-

利							
应收利息	-	-	-	-	-	31,544,689.68	31,544,689.68
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	234,892,955.71	342,391,000.00	476,147,000.00	663,109,000.00	-	31,544,689.68	1,748,084,645.39
负债							
应付赎回	-	-	-	-	-	-	-

回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	537,182.51	537,182.51
应付托管费	-	-	-	-	-	134,295.64	134,295.64
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	112,954,590.57	-	-	-	-	-	112,954,590.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5.40	5.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,748.75	7,748.75
应	-	-	-	-	-	60,447.18	60,447.18

交税费							
应付利息	-	-	-	-	-	74,062.28	74,062.28
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	99,178.95	99,178.95
负债总计	112,954,590.57	-	-	-	-	912,920.71	113,867,511.28
利率敏感度缺口	121,938,365.14	342,391,000.00	476,147,000.00	663,109,000.00	-	30,631,768.97	1,634,217,134.11
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,201,357.27	-	-	-	-	-	3,201,357.27
结	-	-	-	-	-	-	-



算备付金							
存出保证金	1,010.68	-	-	-	-	-	1,010.68
交易性金融资产	-	100,050,000.00	905,780,000.00	648,726,000.00	-	-	1,654,556,000.00
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	25,191,519.22	25,191,519.22
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入	-	-	-	-	-	-	-

返售金融资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,202,367.95	100,050,000.00	905,780,000.00	648,726,000.00	-	25,191,519.22	1,682,949,887.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	545,904.15	545,904.15
应付托管费	-	-	-	-	-	136,476.05	136,476.05
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购	64,999,782.50	-	-	-	-	-	64,999,782.50

金融资产款							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5.58	5.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,903.12	7,903.12
应交税费	-	-	-	-	-	83,886.08	83,886.08
应付利息	-	-	-	-	-	26,480.44	26,480.44
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	64,999,782.50	-	-	-	-	1,000,655.42	66,000,437.92
利率敏感度缺	-61,797,414.55	100,050,000.00	905,780,000.00	648,726,000.00	-	24,190,863.80	1,616,949,449.25

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	4,175,782.64	4,605,749.68
	基准利率增加 25 个基点	-4,146,883.08	-4,574,323.99

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。本基金所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,712,823,000.00	97.98
	其中：债券	1,709,823,000.00	97.81
	资产支持证券	3,000,000.00	0.17
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,716,955.71	0.21
8	其他资产	31,544,689.68	1.80
9	合计	1,748,084,645.39	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

注：本基金本报告期末投资股票。

### 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	883,924,000.00	54.09
	其中：政策性金融债	100,040,000.00	6.12
4	企业债券	322,056,000.00	19.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	503,843,000.00	30.83
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,709,823,000.00	104.63

### 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	1828002	18 农业银行二级 01	1,400,000	142,870,000.00	8.74
2	1920059	19 江苏银行二级	1,000,000	102,050,000.00	6.24
3	1780085	17 铁道 06	1,000,000	101,470,000.00	6.21
4	1928002	19 民生银行二级 01	1,000,000	101,340,000.00	6.20
5	1828004	18 招商银行 01	1,000,000	100,850,000.00	6.17

### 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

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	189549	G3 电建 3A	30,000	3,000,000.00	0.18

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国进出口银行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。

#### 7.12.2

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。

#### 7.12.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,544,689.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,544,689.68

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

## § 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

				(%)		(%)
汇添富鑫益定开债 A	173	8,726,543.06	1,509,657,906.10	100.00	34,043.08	0.00
汇添富鑫益定开债 C	11	1,403.27	0.00	0.00	15,435.96	100.00
合计	184	8,204,931.44	1,509,657,906.10	100.00	49,479.04	0.00

### 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	汇添富鑫益定开债 A	13,574.14	0.00
	汇添富鑫益定开债 C	500.06	3.24
	合计	14,074.20	0.00

### 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	汇添富鑫益定开债 A	0~10
	汇添富鑫益定开债 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富鑫益定开债 A	0
	汇添富鑫益定开债 C	0
	合计	0



## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	9,591,40 6.10	0.64	9,591,40 6.10	0.64	3 年
基金管理人高级管理人员	199.88	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	13,874.3 2	0.00	-	-	
合计	9,605,48 0.30	0.64	9,591,40 6.10	0.64	

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富鑫益定开债 A	汇添富鑫益定开债 C
基金合同生效日 (2019 年 12 月 27 日) 基金份额总额	1,509,695,048.84	65,435.96
本报告期期初基金份额总额	1,509,692,459.02	15,435.96
本报告期基金总申购份额	-	-
减: 本报告期基金总赎回份额	509.84	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,509,691,949.18	15,435.96

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。

## § 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。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

## 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，未发生影响基金管理人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。

本报告期内托管人及其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 (%)	
长城证券	2	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东方证券	3	-	-	-	-	
东吴证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	

国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021年01月09日
2	关于汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金第四次自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中证报,公司网站	2021年01月14日
3	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021年01月22日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021年03月30日

5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 20 日
6	关于汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金第五次自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中证报, 公司网站	2021 年 04 月 21 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 22 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日

## § 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者超过 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	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	1,500,066,500.00	-	-	1,500,066,500.00	99.36
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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</p>							

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，很可能出现开放期最后一日基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元的情形，按照法律法规与《基金合同》的约定，本基金将面临提前终止基金合同的风险。若未触发前述提前终止情形，持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，本基金有可能在运作过程中资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富鑫益定期开放债券型发起式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、报告期内汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

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

### 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，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://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

2021 年 08 月 31 日