

# 汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 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：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

**1.2 目录**

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14        |
| 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.....             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 16        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 16        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 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.....       | 17        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18        |
| 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..... | 18        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....     | 18        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>19</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 19        |
| 6.2 利润表.....                                 | 20        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 21        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 22        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>45</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 45        |
| 7.2 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.....                   | 45        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 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.....    | 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..... | 47        |
| 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.....    | 47        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 47        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 47        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 48        |
| 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的情况.....     | 48        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>50</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 51        |
| 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.....      | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 52        |
| 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.....         | 52        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 52        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 55        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>56</b> |
| 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.....    | 56        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 57        |

|                         |           |
|-------------------------|-----------|
| <b>§12 备查文件目录</b> ..... | <b>58</b> |
| 12.1 备查文件目录.....        | 58        |
| 12.2 存放地点.....          | 58        |
| 12.3 查阅方式.....          | 58        |

## § 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         | 2017 年 4 月 20 日    |              |
| 基金管理人           | 汇添富基金管理股份有限公司      |              |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司       |              |
| 报告期末基金份额总额      | 1,500,357,151.21 份 |              |
| 基金合同存续期         | 不定期                |              |
| 下属分级基金的基金简称:    | 汇添富鑫益定开债 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 | 1,500,233,447.30 份 | 123,703.91 份 |

### 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。                |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数  |
| 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    |      | 上海市黄浦区大沽路 288      | 北京市西城区复兴门内大街 55     |

|       |                        |                   |
|-------|------------------------|-------------------|
|       | 号 6 栋 538 室            | 号                 |
| 办公地址  | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层 | 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                     | 易会满               |

## 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》、《上海证券报》和《证券时报》              |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com                      |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 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 21 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

| 基金级别          | 汇添富鑫益定开债 A                   | 汇添富鑫益定开债 C                   |
|---------------|------------------------------|------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年4月20日 - 2017年6月30日) | 报告期(2017年4月20日 - 2017年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 11,059,164.19                | 814.96                       |
| 本期利润          | 12,039,169.60                | 895.71                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0080                       | 0.0072                       |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.80%                        | 0.72%                        |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.80%                        | 0.72%                        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日)             |                              |
| 期末可供分配利润      | 11,059,164.19                | 814.96                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0074                       | 0.0066                       |
| 期末基金资产净值      | 1,512,272,616.90             | 124,599.62                   |
| 期末基金份额净值      | 1.0080                       | 1.0072                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2017年6月30日)             |                              |
| 基金份额累计净值增长率   | 0.80%                        | 0.72%                        |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富鑫益定开债 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      | 0.37%    | 0.01%       | 0.90%      | 0.06%         | -0.53% | -0.05% |
| 自基金合同生效日起至 | 0.80%    | 0.01%       | -0.37%     | 0.08%         | 1.17%  | -0.07% |

|   |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 今 |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|

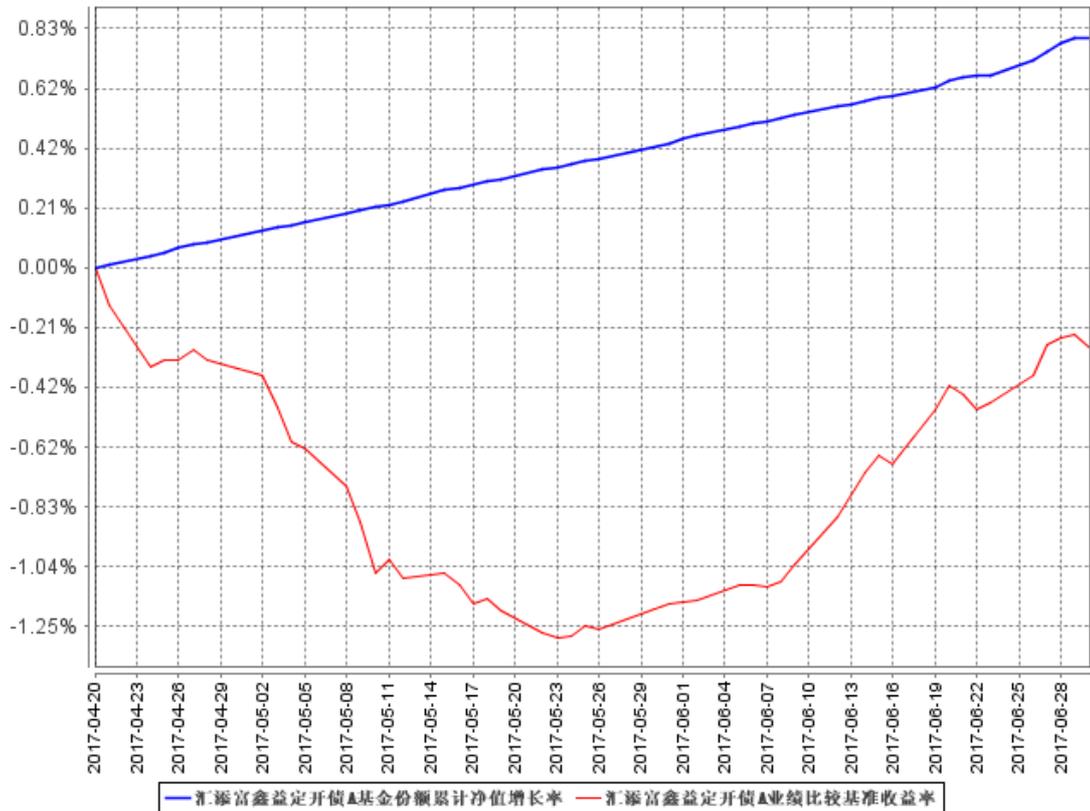
汇添富鑫益定开债 C

| 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       | 0.33%    | 0.01%       | 0.90%      | 0.06%         | -0.57% | -0.05% |
| 自基金合同生效日起至今 | 0.72%    | 0.01%       | -0.37%     | 0.08%         | 1.09%  | -0.07% |

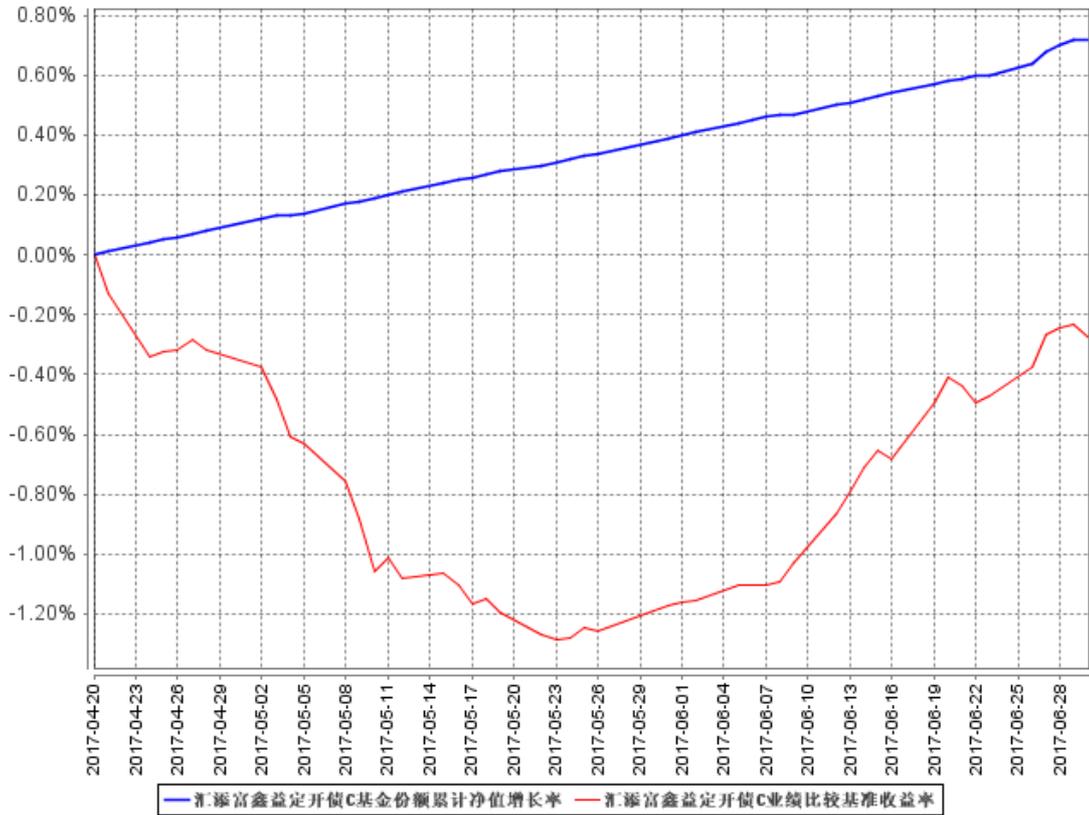
注：本基金的《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 20 日，至本报告期末未满 6 个月。

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

汇添富鑫益定开债A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富鑫益定开债C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效于2017年4月20日，截至报告期末本基金基金合同生效未满6个月。

2、按照基金合同的约定，本基金应自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## § 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由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，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，注册资本为 132,724,224 元人民币。截止到 2017 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2898.83 亿元，有效客户数约 1500 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 85 只开放式证券投资基金，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，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添

富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、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、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金。

#### 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 |        |  |
| 吴江宏 | 汇添富可转换债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合 | 2017年4月20日      | -    | 6年     | 国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕士。2011年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015年7月17日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2016年4月19日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理，2016年8月3日至今 |

|     |   |                 |   |      |  |
|-----|---|-----------------|---|------|--|
|     | 基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利债券基金、汇添富绝对收益定开混合、添富鑫汇定开债券基金的基金经理。   |                 |   |      | 任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理，2017 年 3 月 13 日至今任汇添富鑫利债券基金的基金经理，2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理，2017 年 4 月 20 日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017 年 6 月 23 日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理。  |
| 蒋文玲 | 汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富货币基金、理财 14 天债券基金、理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金、实业债券基金、优选回报混合基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定 | 2017 年 4 月 20 日 | - | 11 年 | 国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012 年 11 月 30 日至 2014 年 1 月 7 日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014 年 1 月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014 年 4 月 8 日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理，2015 年 3 月 10 日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 14 天债券基金、汇添富优选回报混合基金（原理财 21 天债券基金）的基金经理，2016 年 6 月 7 日至今任汇添富货币基金、添富货币基金、理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金、实业债券基金的基金经理，2017 年 4 月 20 日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经 |

|  |                                |  |  |   |
|--|--------------------------------|--|--|---|
|  | 开债券基金的基金经理，汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。 |  |  | 理，2017 年 5 月 15 日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理，2017 年 6 月 23 日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理。 |
|--|--------------------------------|--|--|---|

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、本基金的基金经理原为吴江宏先生和蒋文玲女士。本基金的基金经理蒋文玲女士于 2017 年 8 月 21 日起休产假，无法正常履行职务。依据法律法规及公司制度规定，本公司研究决定，蒋文玲女士休假期间，吴江宏先生继续负责该基金的投资管理工作。本基金管理人已于 2017 年 8 月 18 日就上述事项进行公告。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 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

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易

执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 8 次，由于组合投资策略导致，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

#### 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

2017 年上半年债券市场出现了剧烈的调整。一季度基本面延续去年四季度的回升态势，基建和房地产投资稳中有升，企业盈利、信贷融资需求等多项指标继续改善，三四线城市房地产销售和明显超预期。政策方面，一季度央行继续实施稳健中性的货币政策，公开市场持续回笼资金、两次上调政策利率，资金面呈现紧平衡，资金利率中枢抬升，一季度债券收益率大幅上升。

二季度相比一季度经济增长呈现弱化态势，PMI 见顶回落，工业增加值显现下行，房地产销售走弱。但金融去杠杆进程推进引发市场担忧，4 月去杠杆监管政策陆续推出，各期限债券收益率快速上行，债券一级发行大规模取消，实体经济融资受到冲击。6 月监管协调加强、货币政策削峰填谷，季末资金面紧张缓解，债券收益率开始高位回落。

报告期内，组合主要配置低久期资产。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富鑫益定开债 A 基金份额净值为 1.0080 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.80%；截至本报告期末汇添富鑫益定开债 C 基金份额净值为 1.0072 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%；同期业绩比较基准收益率为-0.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年经济表现出很强的韧性，展望下半年，制造业企业盈利改善和资产负债表的修复，制造业投资有望继续向好。受需求端调控政策的影响，下半年房地产销售的环比增长放缓，但房地产投资比销售更具韧性。考虑到政府加大土地供给，三、四线城市的库存去化周期已降至历史低位，房地产投资放缓的空间有限。基建在下半年面临较大变数，财政部 50、87 号文对地方政府融资影响将逐步体现。政策方面，预计货币政策仍将保持中性，经济通胀保持稳定的情况下，货币政策难以出现转向。去杠杆政策是影响上半年债券收益率最关键的因素，目前金融加杠杆势头明显被遏制，同业杠杆出现一定程度的去化，我们认为政策对市场最大冲击已经过去，后续关注资管统一监管管理办法的影响。

下半年本组合继续以谨慎操作为主，维持偏低久期和适宜杠杆水平，信用债以高等级为主，利率债把握波段操作机会。

#### 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《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范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，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。

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、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 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各类基金份额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；同一类别内每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **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**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富鑫益定期开放债券型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。本报告期内，汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

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证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 800,197,214.13                 |
| 结算备付金           |            | -                              |
| 存出保证金           |            | -                              |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 968,381,000.00                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              |
| 基金投资            |            | -                              |
| 债券投资            |            | 968,381,000.00                 |
| 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    | -                              |
| 应收证券清算款         |            | 21,012,384.25                  |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 3,765,967.44                   |
| 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            |            | 1,793,356,565.82               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> |
| <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       |            | 279,999,380.00                 |
| 应付证券清算款         |            | -                              |
| 应付赎回款           |            | -                              |
| 应付管理人报酬         |            | 496,189.23                     |
| 应付托管费           |            | 124,047.30                     |
| 应付销售服务费         |            | 40.82                          |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 3,769.65                       |

|               |          |                  |
|---------------|----------|------------------|
| 应交税费          |          | -                |
| 应付利息          |          | 245,922.30       |
| 应付利润          |          | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 90,000.00        |
| 负债合计          |          | 280,959,349.30   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,500,357,151.21 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 12,040,065.31    |
| 所有者权益合计       |          | 1,512,397,216.52 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,793,356,565.82 |

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,500,357,151.21 份。其中 A 类基金份额总额 1,500,233,447.30 份，份额净值 1.0080 元；C 类基金份额总额 123,703.91 份，份额净值 1.0072 元。

2、由于本基金于 2017 年 4 月 20 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2017 年 6 月 30 日的数据。

3、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号        | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效<br>日)至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------|---|
| <b>一、收入</b>      |            | 13,846,720.41                                       |
| 1.利息收入           |            | 12,866,634.25                                       |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11   | 12,104,348.74                                       |
| 债券利息收入           |            | 697,790.37  |
| 资产支持证券利息收入       |            | -   |
| 买入返售金融资产收入       |            | 64,495.14   |
| 其他利息收入           |            | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |            | -   |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12   | -   |
| 基金投资收益           |            | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.13   | -   |
| 资产支持证券投资收益       | 6.4.7.13.2 | -   |
| 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   | -             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.17   | 980,086.16    |
| 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   | -             |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 1,806,655.10  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,171,759.38  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 292,939.84    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 96.58         |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 2,500.00      |
| 5. 利息支出                    |            | 245,922.30    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 245,922.30    |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 93,437.00     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 12,040,065.31 |

注：1. 由于本基金于 2017 年 4 月 20 日成立，无比较式上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

2. 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 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证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 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）                   | 1,500,357,151.21                                | -             | 1,500,357,151.21 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -   | 12,040,065.31 | 12,040,065.31    |
| 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） | -   | -             | 0.00             |
| 其中：1.基金申购款                        | -   | -             | 0.00             |
| 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）                        | 1,500,357,151.21 | 12,040,065.31 | 1,512,397,216.52 |

注：由于本基金于 2017 年 4 月 20 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示本期数据，特此说明。

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：

|                |                |                 |
|----------------|----------------|-----------------|
| _____ 张晖 _____ | _____ 李骁 _____ | _____ 雷青松 _____ |
| 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作为发起人于 2017 年 3 月 13 日至 2017 年 4 月 18 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第 60466941\_B16 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 4 月 20 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 1,500,289,630.35 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 67,520.86 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 1,500,357,151.21 元，折合 1,500,357,151.21 份基金份额。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固定收益类金融工具，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固定收益类品种。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。本基金的业绩比较基准为中债综

合指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，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制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系本基金的《基金合同》生效之日（2017 年 04 月 20 日）起至 2017 年 06 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账位币和编制财务报表所采用的货均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

**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**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的

现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

### 3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

### 4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

### 5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变

动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交

易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、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；

2、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；

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### **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**

注：本基金本报告期无重大会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

注：本基金本报告期无重大会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

注：本基金本报告期无重大会计差错和更正金额。

## 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、国家税务总局财税字[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 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税；

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

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，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。

#### 6.4.6.3 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、国家税务总局财税字[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。

#### 6.4.6.4 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 197,214.13             |
| 定期存款           | 800,000,000.00         |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 存款期限 3 个月~1 年  | 800,000,000.00         |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 800,197,214.13         |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2017 年 6 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<br>黄金合约 | -                      | -              | -              |
| 债券                | 交易所市场                  | -              | -              |
|                   | 银行间市场                  | 967,400,913.84 | 968,381,000.00 |
|                   | 合计                     | 967,400,913.84 | 968,381,000.00 |
| 资产支持证券            | -                      | -              | -              |
| 基金                | -                      | -              | -              |
| 其他                | -                      | -              | -              |
| 合计                | 967,400,913.84         | 968,381,000.00 | 980,086.16     |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

##### 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

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<br>2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 18,683.01         |
| 应收定期存款利息   | 2,434,166.67      |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | 1,321,373.93      |
| 应收买入返售证券利息 | -8,256.17         |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | -                 |
| 合计         | 3,765,967.44      |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6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 | 3,769.65          |
| 合计          | 3,769.65          |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付信息披露费     | 67,500.00         |
| 应付审计费       | 22,500.00         |
| 合计          | 90,000.00         |

### 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<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |                  |
|               | 基金份额(份)   | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 1,500,233,447.30                                | 1,500,233,447.30 |
| 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/份额折算变动份额 | -   | -                |
| 本期申购          | -   | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -   | -                |
| 本期末           | 1,500,233,447.30                                | 1,500,233,447.30 |

金额单位：人民币元

| 汇添富鑫益定开债 C    |   |            |
|---------------|---|------------|
| 项目            | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |            |
|               | 基金份额(份)   | 账面金额       |
| 基金合同生效日       | 123,703.91                                      | 123,703.91 |
| 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/份额折算变动份额 | -   | -          |
| 本期申购          | -   | -          |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -   | -          |
| 本期末           | 123,703.91                                      | 123,703.91 |

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

### 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       |
| 基金合同生效日        | -             | -          | -             |
| 本期利润           | 11,059,164.19 | 980,005.41 | 12,039,169.60 |
| 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      | 11,059,164.19 | 980,005.41 | 12,039,169.60 |

单位：人民币元

| 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 |
| 基金合同生效日        | -      | -     | -       |
| 本期利润           | 814.96 | 80.75 | 895.71  |
| 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            | 814.96 | 80.75 | 895.71  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 51,570.96                            |
| 定期存款利息收入  | 12,052,777.78                        |
| 其他存款利息收入  | -                                    |
| 结算备付金利息收入 | -                                    |
| 其他        | -                                    |
| 合计        | 12,104,348.74                        |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期末投资股票。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

**6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

注：本基金本期未投资资产支持证券。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金本期未投资贵金属。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本期未投资衍生工具。

**6.4.7.16 股利收益**

注：本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017<br>年 6 月 30 日 |
|------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 980,086.16   |
| ——股票投资     | -  |
| ——债券投资     | 980,086.16   |
| ——资产支持证券投资 | -  |
| ——贵金属投资    | -  |
| ——其他       | -  |
| 2. 衍生工具    | -  |
| ——权证投资     | -  |
| 3. 其他      | -  |
| 合计         | 980,086.16   |

**6.4.7.18 其他收入**

注：本基金本期无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年<br>6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | -  |
| 银行间市场交易费用 | 2,500.00   |

|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 2,500.00 |
|----|----------|

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017<br>年 6 月 30 日 |
|-------|--|
| 审计费用  | 22,500.00  |
| 信息披露费 | 67,500.00  |
| 账户维护费 | -  |
| 银行划款费 | 3,437.00   |
| 合计    | 93,437.00  |

#### 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

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至财务报表批准日，本基金无需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

注：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    |
| 中国工商银行股份有限公司  | 基金托管人、基金代销机构    |
| 东方证券股份有限公司    | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 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**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |                    |
|------------|---|--------------------|
|            | 回购成交金额  | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 21,000,000.00                                   | 100.00%            |

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期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：本基金本报告期无需支付关联方的佣金。

**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<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月<br>30 日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,171,759.38                                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -  |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.4% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$  H 为每日应支付的基金管理费

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付指令，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基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 |
|----|--|
|----|--|

|                | 30 日       |
|----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 292,939.84 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$  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付指令，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基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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<br>2017 年 4 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 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  | -   | 96.58      | 96.58 |
| 合计             | -   | 96.58      | 96.58 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

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：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2017年4月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |           |
|--------------|--------------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                                 | 当期利息收入    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 197,214.13                           | 51,570.96 |

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金在本期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2017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**

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

**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**

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         |
|-----------|---------------|-----------|--------|-----------|----------------|
| 011753035 | 17 苏国信 SCP008 | 2017年7月3日 | 100.24 | 1,000,000 | 100,240,000.00 |
| 011760075 | 17 鲁黄金 SCP003 | 2017年7月3日 | 100.12 | 1,000,000 | 100,120,000.00 |

|           |                    |                   |        |           |                |
|-----------|--------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 011760076 | 17 国药控<br>股 SCP001 | 2017 年 7 月<br>3 日 | 100.14 | 800,000   | 80,112,000.00  |
| 合计        |                    |                   |        | 2,800,000 | 280,472,000.00 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 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，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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| A-1    | -                      |
| A-1 以下 | -                      |
| 未评级    | 968,381,000.00         |
| 合计     | 968,381,000.00         |

注：未评级债券为超短期融资券、国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

### 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。

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，因此，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。

### 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2017年6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              | 197,214.13     | -             | 800,000,000.00   | -    | -    | -             | 800,197,214.13   |
| 交易性金融资产           | -              | 50,025,000.00 | 918,356,000.00   | -    | -    | -             | 968,381,000.00   |
| 应收证券清算款           | -              | -             | -                | -    | -    | 21,012,384.25 | 21,012,384.25    |
| 应收利息              | -              | -             | -                | -    | -    | 3,765,967.44  | 3,765,967.44     |
| 其他资产              | -              | -             | -                | -    | -    | -             | -                |
| 资产总计              | 197,214.13     | 50,025,000.00 | 1,718,356,000.00 | -    | -    | 24,778,351.69 | 1,793,356,565.82 |
| 负债                |                |               |                  |      |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款         | 279,999,380.00 | -             | -                | -    | -    | -             | 279,999,380.00   |
| 应付管理人报酬           | -              | -             | -                | -    | -    | 496,189.23    | 496,189.23       |
| 应付托管费             | -              | -             | -                | -    | -    | 124,047.30    | 124,047.30       |

|         |                 |               |                  |   |   |                |                  |
|---------|-----------------|---------------|------------------|---|---|----------------|------------------|
| 应付销售服务费 |                 | -             | -                | - | - | 40.82          | 40.82            |
| 应付交易费用  |                 | -             | -                | - | - | 3,769.65       | 3,769.65         |
| 应付利息    |                 | -             | -                | - | - | 245,922.30     | 245,922.30       |
| 其他负债    |                 | -             | -                | - | - | 90,000.00      | 90,000.00        |
| 负债总计    | 279,999,380.00  | -             | -                | - | - | 959,969.30     | 280,959,349.30   |
| 利率敏感度缺口 | -279,802,165.87 | 50,025,000.00 | 1,718,356,000.00 | - | - | -23,818,382.39 | 1,512,397,216.52 |

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 | 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；  |  |
|    | 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；                            |  |
|    | 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；   |  |
|    | 银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，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； |  |
|    | 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。  |  |
| 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）<br>本期末（2017年6月30日） |
|    | 基准利率增加 25 个基点   | -1,366,594.89                                  |
|    | 基准利率减少 25 个基点   | 1,370,931.15                                   |

注：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、应收申购款及结算备付金，且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其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

注：本基金的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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

#### **6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析**

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净值的影响。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 固定收益投资            | 968,381,000.00   | 54.00         |
|    | 其中：债券             | 968,381,000.00   | 54.00         |
|    | 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      | 800,197,214.13   | 44.62         |
| 7  | 其他各项资产            | 24,778,351.69    | 1.38          |
| 8  | 合计                | 1,793,356,565.82 | 100.00        |

### 7.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末持有股票投资。

### 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      | 79,936,000.00  | 5.29          |
|    | 其中：政策性金融债 | 79,936,000.00  | 5.29          |
| 4  | 企业债券      | -              | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | 500,495,000.00 | 33.09         |
| 6  | 中期票据      | -              | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -             |
| 8  | 同业存单      | 387,950,000.00 | 25.65         |
| 9  | 其他        | -              | -             |
| 10 | 合计        | 968,381,000.00 | 64.03         |

### 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  | 111714196 | 17 江苏银行 CD196  | 2,000,000 | 195,680,000.00 | 12.94         |
| 2  | 011764057 | 17 国电 SCP003   | 1,500,000 | 149,970,000.00 | 9.92          |
| 3  | 011753035 | 17 苏国信 SCP008  | 1,000,000 | 100,240,000.00 | 6.63          |
| 4  | 011760076 | 17 国药控股 SCP001 | 1,000,000 | 100,140,000.00 | 6.62          |
| 5  | 011760075 | 17 鲁黄金 SCP003  | 1,000,000 | 100,120,000.00 | 6.62          |

### 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

注：本基金本期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

注：本基金本期未持有贵金属。

### 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：本基金本期未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 7.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | 21,012,384.25 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 3,765,967.44  |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 24,778,351.69 |

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

## § 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 | 311       | 4,823,901.76 | 1,500,066,500.00 | 99.99% | 166,947.30 | 0.01%   |
| 汇添富鑫益定开债 C | 33        | 3,748.60     | 0.00             | 0.00%  | 123,703.91 | 100.00% |
| 合计         | 344       | 4,361,503.35 | 1,500,066,500.00 | 99.98% | 290,651.21 | 0.02%   |

### 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 | 30,787.34  | 0.0021%  |
|                  | 汇添富鑫益定开债 C | 1,200.22   | 0.9702%  |
|                  | 合计         | 31,987.56  | 0.0021%  |

### 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 | 汇添富鑫益定开债 A | 0                  |
|                         | 汇添富鑫益定开债 C | 0                  |

|                 |            |   |
|-----------------|------------|---|
| 有本开放式基金         | 合计         | 0 |
| 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 |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 汇添富鑫益定开<br>债 A   | 汇添富鑫益定开<br>债 C |
|--|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 4 月 20 日）基金份<br>额总额     | 1,500,233,447.30 | 123,703.91     |
| 本报告期期初基金份额总额                           | -                | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购<br>份额              | -                | -              |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎<br>回份额            | -                | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变<br>动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 1,500,233,447.30 | 123,703.91     |

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。
2. 基金管理人于 2017 年 2 月 4 日公告，增聘欧阳沁春先生和杨璿先生担任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
3. 《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
4. 基金管理人于 2017 年 3 月 10 日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。
5. 《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基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
6. 基金管理人于 2017 年 3 月 16 日公告，增聘吴江宏先生担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，与顾耀强先生共同管理该基金。
7. 《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
8. 《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
9. 《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。
10. 《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
11. 《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
12. 《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。
14. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。
15. 基金管理人 2017 年 6 月 21 日公告，雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生单独管理该基金。
16. 《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
17. 本报告期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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。  
本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 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

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)自本基金合同生效日(2017年04月20日)起至本报告期末,为本基金进行审计。

### 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 |    |
| 东方证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 联讯证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 江海证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 民族证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 瑞银证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰联合证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 信达证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|       |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 国金证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安  | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投  | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司  | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券  | 1 | - | - | - | - | - |

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 |              |
|------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 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 |
| 东方证券 | -    | -            | -21,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 联讯证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 江海证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 民族证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中银国际 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 瑞银证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证<br>券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券       | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安       | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券       | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券       | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券      | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投       | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券       | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源       | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券       | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券       | - | - | - | - | - | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审

批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

(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：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：太平洋证券（上交所单元和深交所单元）

**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  | 汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金发行文件                               | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 3 月 10 日 |
| 2  | 汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告（副总经理）                     | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 3 月 10 日 |
| 3  | 关于汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金延长募集期的公告                         | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 4 月 12 日 |
| 4  | 汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金提前结束募集的公告           | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 4 月 18 日 |
| 5  | 汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告                           | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 4 月 21 日 |
| 6  | 汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下基金场外申购、定投单笔金额下限及场外最低赎回、转换、保留份额的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 4 月 26 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              | 2017 年 4 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日 | 0.00 | 1,500,066,500.00 | 0.00 | 1,500,066,500.00 | 99.98% |
| 个人    | -              | -                                | -    | -                | -    | -                | -      |
| -     | -              | -                                | -    | -                | -    | -                | -      |

#### 产品特有风险

##### 1、持有人大会投票权集中的风险

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

##### 2、巨额赎回的风险

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

##### 3、基金规模较小导致的风险

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

##### 4、基金净值大幅波动的风险

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

##### 5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，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、中国证监会核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证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富鑫益定期开放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、报告期内汇添富鑫益定期开放债券型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 21 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

2017 年 8 月 26 日