汇添富鑫瑞债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2018年8月25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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富鑫瑞债券	
基金主代码	004089	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月26日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	703,459,120.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富鑫瑞债券A	汇添富鑫瑞债券C
下属分级基金的交易代码:	004089	004090
报告期末下属分级基金的份额总额	703,458,616.59份	503.51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绝对收益率的较高收益。
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,深入挖掘价值较低的标的券种。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。
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。
	汇添富鑫瑞债券A / 汇添富鑫瑞债券C

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	胡波
	联系电话	021-28932888	021-61618888
	电子邮箱	service@99fund.com	Hubo5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95528
传真		021-28932998	021-63602540

2.4 信息披露方式

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19-22层 汇添富基金管理股份有限公司

§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

基金份额	汇添富鑫瑞债券A	汇添富鑫瑞债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	14,422,708.54	8.05
本期利润	15,114,933.57	8.58
加权平均基金份额本期利润	0.0215	0.0171
本期加权平均净值利润率	2.11%	1.69%
本期基金份额净值增长率	2.13%	1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	14,219,924.48	4.53
期末可供分配基金份额利润	0.0202	0.0090
期末基金资产净值	718,771,881.62	508.85
期末基金份额净值	1.0218	1.0106

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、上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

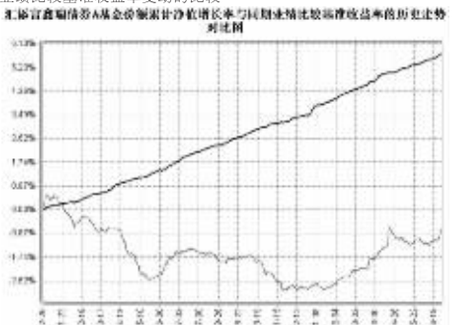
汇添富鑫瑞债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.34%	0.01%	0.34%	0.06%	0.00%	-0.05%
过去三个月	0.92%	0.02%	1.01%	0.10%	-0.09%	-0.08%
过去六个月	2.13%	0.02%	2.16%	0.08%	-0.03%	-0.06%
过去一年	3.89%	0.02%	0.83%	0.06%	3.06%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	5.74%	0.02%	-0.78%	0.07%	6.52%	-0.05%

汇添富鑫瑞债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.27%	0.01%	0.34%	0.06%	-0.07%	-0.05%
过去三个月	0.70%	0.02%	1.01%	0.10%	-0.31%	-0.08%
过去六个月	1.71%	0.02%	2.16%	0.08%	-0.45%	-0.06%
过去一年	3.10%	0.02%	0.83%	0.06%	2.27%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	4.61%	0.02%	-0.78%	0.07%	5.39%	-0.05%

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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2016年12月26日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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,注册资本金为132,724,224元人民币。截止到2018年6月30日,公司管理证券投资基金规模约4213.15亿元,有效客户数约1988万户,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理110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、汇添富监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、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金(LOF)、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
李怀宏	汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金、汇添富达欣混合基金、汇添富优势精选混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、汇添富鑫汇定期开放债券基金、汇添富添福吉祥混合基金、汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金(LOF)、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金。	2016年12月26日	-	11年	国籍:中国,学历:复旦大学经济学博士,相关业务资格:基金从业资格。从业经历:曾任光大证券股份有限公司研究所债券分析师,国信证券股份有限公司研究所固定收益高级分析师,2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司固定收益投资部,2015年5月25日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理助理,2015年11月18日至今任汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金(原汇添富互利分级债券基金)的基金经理,2015年12月2日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理,2016年3月11日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健利定期开放债券基金的基金经理,2016年12月6日至今任汇添富达欣灵活配置混合基金的基金经理,2016年12月21日至今任汇添富添福吉祥混合基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2017年4月14日至今任添富年年泰定开混合基金的基金经理,2017年9月29日至今任汇添富年年盈今基金的基金经理,2018年3月8日至今任添富鑫汇定开债基金的基金经理助理。
陆文磊	汇添富稳强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金、汇添富优势精选混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、汇添富鑫汇定期开放债券基金、汇添富添福吉祥混合基金、汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金(LOF)、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金。	2016年12月26日	-	16年	硕士研究生,经济学硕士,曾任光大证券股份有限公司研究所固定收益高级分析师,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理,2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富珠江三角洲基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富纯债(LOF)基金(原汇添富互利分级债券基金)的基金经理,2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富安鑫宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富高息纯债债券基金的基金经理,2014年12月23日至2018年5月4日任汇添富高息纯债债券基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2017年4月14日至今任汇添富年年泰定开混合基金的基金经理,2018年3月8日至今任汇添富鑫汇定开债基金的基金经理。
胡娜	汇添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、汇添富民安增益定开混合基金、汇添富鑫益定开混合基金、汇添富鑫益定开债基金的基金经理。	2017年7月3日	-	9年	硕士研究生,经济学硕士,曾任光大证券股份有限公司研究所固定收益高级分析师,2009年至2012年期间任职于中泰资产管理公司固定收益部,担任自营交易员职务,2012年11月加盟银华基金管理有限公司,担任研究员,基金经理助理职务,自2015年1月29日至2016年10月18日任银华增强收益债券型证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金的基金经理,2015年5月14日至2016年10月18日任银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年5月21日至2016年10月18日任银华配利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司任投研总监,2017年4月25日至2017年7月2日任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理助理,2017年7月3日至今任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2018年2月13日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理,2018年4月16日至今任添富鑫益定开债基金的基金经理。	9年

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、本基金管理人于2018年8月4日公告,本基金的基金经理李怀宏先生由于个人原因于2018年8月2日离任,本基金的基金经理陆文磊先生和胡娜女士继续管理本基金。

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,基金管理人对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

本报告期内本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为4次,由于组合投资策略导致。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

上半年全球经济延续复苏势头,美国经济表现强劲,投资、消费数据屡超预期,失业率持续处于低位,接近充分就业,核心PCE也达到2%的通胀目标,联储加息渐进式推进,全球货币政策转向。中美贸易摩擦持续发酵,降低了全球风险偏好。国内经济数据表现平稳,但去杠杆进入深水区,社融数据大幅回落,企业融资困难,经济下行风险有所增加,信用风险明显提升。在此背景下,货币政策基调发生边际变化,对流动性的提法从"合理稳定"转为"合理充裕",资金利率大幅下行。上半年债券市场收益率大幅下行,10年国债下行43bp,10年国开债下行62bp。上半年股市大幅下跌,上证综指整体下跌13.9%,深圳成指下跌15.04%,创业板下跌7.3%。

本基金上半年根据基金的流动性需要,维持了较短的久期和偏低的杠杆,配置了优质短久期债券,获取了相对稳定的持有期回报。

报告期内,本基金净值增长率为2.13%,业绩比较基准净值增长率为2.17%。

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瑞债券A基金份额净值为1.0218元,本报告期基金份额净值增长率为2.13%;截至本报告期末汇添富鑫瑞债券C基金份额净值为1.0106元,本报告期基金份额净值增长率为1.71%;同期业绩比较基准收益率为2.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济面临内忧外患。国内方面,基建资金来源受限,地产销量有所回落,贸易摩擦的不断升级加剧了外需的下行风险,货币政策保持稳健中性,资金面持续宽松。总体看,基本面对债券市场仍有支撑。然而考虑到去杠杆的长期性和曲折性,在经济下行压力较大的阶段,调结构可能暂时让步于稳增长,预计下半年财政政策将有所发力,全年经济仍将在合理区间内运行。

策略上,下半年仍将以组合的流动性管理为主,稳健的获取票息回报,维持适当的杠杆和久期。

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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(2017年9月5日《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止)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。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。

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、基金营运部和稽核监察部人员及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历,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;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。

本基金于2018年05月10日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.120元人民币。

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,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配,分配金额为8,440,682.91元。

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

本报告期内,由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、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:汇添富鑫瑞债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	11,789,002.68	2,274,375.48
结算备付金	157,960.19	-
存出保证金	4,933.48	-
交易性金融资产	696,877,500.00	691,986,120.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	696,877,500.00	691,986,120.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	5,009,315.07
应收利息	10,519,815.55	13,353,243.35
应收股利	-	-
应收申购款	59.94	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	719,349,271.84	712,623,053.90
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	176,888.24	182,652.73
应付托管费	58,962.75	60,884.24
应付销售服务费	0.30	0.31
应付交易费用	3,475.00	2,500.00
应交税费	83,828.16	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	253,726.92	330,000.00
负债合计	576,881.37	576,037.28
所有者权益:		
实收基金	703,459,120.10	703,408,725.45
未分配利润	15,313,270.37	8,638,291.17
所有者权益合计	718,772,390.47	712,047,016.62
负债和所有者权益合计	719,349,271.84	712,623,053.90

注:报告截止日2018年6月30日,其中下属A类基金份额参考净值1.0218元,份额总额703,458,616.59份;下属C类基金份额参考净值1.0106元,份额总额503.51份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富鑫瑞债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	16,782,425.90	10,926,329.42
1.利息收入	16,493,076.10	9,092,872.97
其中:存款利息收入	110,911.65	101,287.22
债券利息收入	16,378,953.72	8,401,397.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,210.73	590,187.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-402,875.81	758,234.34
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-402,875.81	758,234.34
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	692,225.56	1,075,222.11
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"填列)	0.05	-
减:二、费用	1,667,483.75	1,328,211.83
1.管理人报酬	1,068,074.85	779,871.94
2.托管费	356,024.95	259,957.44
3.销售服务费	1.81	1.81
4.交易费用	5,165.52	12,796.95
5.利息支出	9,135.57	99,082.78
其中:卖出回购金融资产支出	9,135.57	99,082.78
6.税金及附加	52,126.75	-
7.其他费用	176,954.30	176,498.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	15,114,942.15	9,598,117.59

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富鑫瑞债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	703,408,725.45	8,638,291.17	712,047,016.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,114,942.15	15,114,942.15
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)	50,394.65	719.96	51,114.61
其中:1.基金申购款	70,966.90	1,187.32	72,154.22
2.基金赎回款	-20,572.25	-467.36	-21,039.61
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)	-	-8,440,682.91	-8,440,682.91
五、期末所有者权益(基金净值)	703,459,120.10	15,313,270.37	718,772,390.47
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
项目	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)	200,422,613.81	117,365.30	200,539,979.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,598,117.59	9,598,117.59
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)	497,191,869.28	2,684,494.66	499,876,363.94
其中:1.基金申购款	497,314,501.69	2,685,498.31	500,000,000.00
2.基金赎回款	-122,632.41	-1,003.65	-123,636.06
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)	697,614,483.09	12,399,977.55	710,014,460.64

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

汇添富鑫瑞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[2015]2819号文《关于准予汇添富鑫瑞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于2016年12月16日起至2016年12月22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(2016)验字第60466941_B25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2016年12月26日正式生效。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200,386,609.07元,在募集期间产生的存款利息为人民币36,004.74元,以上实收基金(本息)合计为人民币200,422,613.81元,折合200,422,613.81份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、可转换债券、可交换公司债券、可分离交易债、债券回购、回收存单、货币市场工具、银行存款等固定收益类品种,国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。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(以下统称"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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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