汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年03月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2019年3月22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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	1,500,213,921.63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	1,500,121,311.22份	92,610.41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。在遵循投资的基础上,力争实现相合的稳健增值。
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	010-66106799
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年04月20日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	汇添富鑫益定开债A	汇添富鑫益定开债C	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	60,349,057.44	3,499.48	40,635,606.50	2,882.93
本期利润	70,653,697.91	4,201.26	40,776,199.89	2,873.13
加权平均基金份额本期利润	0.0471	0.0431	0.0268	0.0241
基金份额净值增长率	4.72%	4.30%	2.68%	2.40%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0369	0.0298	0.0062	0.0033
期末基金资产净值	1,565,344,676.38	96,995.77	1,509,406,888.94	107,149.29
期末基金份额净值	1.0435	1.0363	1.0062	1.0033

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

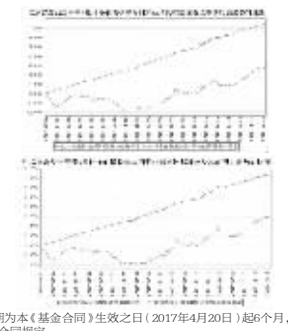
汇添富鑫益定开债A

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
过去三个月	1.06%	0.03%	1.99%	0.06%	-0.93%	-0.02%
过去六个月	2.29%	0.03%	2.57%	0.06%	-0.28%	-0.03%
过去一年	4.72%	0.02%	4.79%	0.07%	-0.07%	-0.05%
自基金合同生效起至今	7.54%	0.02%	3.04%	0.07%	4.50%	-0.05%

汇添富鑫益定开债C

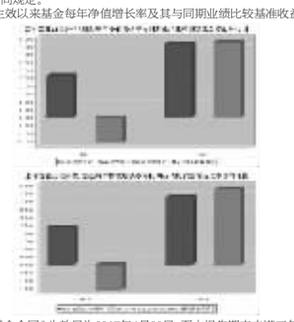
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.95%	0.03%	1.99%	0.06%	-1.04%	-0.02%
过去六个月	2.08%	0.03%	2.57%	0.06%	-0.49%	-0.03%
过去一年	4.30%	0.02%	4.79%	0.07%	-0.49%	-0.05%
自基金合同生效起至今	6.80%	0.02%	3.04%	0.07%	3.76%	-0.05%

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(2017年4月20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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金的《基金合同》生效日为2017年4月20日,至本报告期末未满三年。

2、合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:元

汇添富鑫益定开债A

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.0980	14,701,152.53	175.54	14,701,328.07	-
2017年	0.2060	30,903,160.60	706.65	30,903,867.25	-
2016年	-	-	-	-	-
合计	0.3040	45,604,313.13	882.19	45,605,195.32	-

汇添富鑫益定开债C

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.0980	1,006.18	40.38	1,046.56	-
2017年	0.2060	2,159.81	225.75	2,385.56	-
2016年	-	-	-	-	-
合计	0.3040	3,165.99	266.13	3,432.12	-

§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

汇添富基金成立于2005年2月,是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,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。

目前,汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至2018年12月31日,汇添富资产管理总规模超过6500亿元,其中公募资产管理规模(剔除货基及短期理财债券)为1738.78亿元,稳居行业前十。优秀的产品及服务赢得了行业与市场的高度认可。2018年,汇添富基金荣获"十大产品创新基金公司奖""公募基金20年最佳主动权益基金管理人""公募基金20年十大最佳基金管理人""基金20年'金基金'TOP基金公司""中国基金业20周年优秀基金管理公司(7-15年组别)及管理层"等奖项,旗下多只基金荣获金牛奖、金基金奖、明星基金奖等奖项;"添富智投"荣获"上海金融创新奖","添富养老"荣获"综合奖·2018中国A级金融先锋榜"等奖项。

2018年,汇添富基金新成立23只公募基金,包括13只混合型基金,2只股票型基金,2只指数基金,6只债券基金。新发重点主动权益产品包括添富价值创造定开混合、添富行业整合混合、添富智能制造股票、汇添富文体娱乐混合、添富创新医药混合、添富全球消费混合(QDII)等,有序推动不同久期、信用级别的债券产品落地,参与发售战略配售基金,探索养老目标日期FOF基金。2018年底,公司公募基金产品总数达120只,包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2018年,汇添富基金进一步夯实自有平台基础建设,在全方位升级平台架构及安全系统的基础上,不断引领行业创新,规模及客户数均处于行业领先水平。全年实现指纹识别、人脸识别、常用设备保护、7*24小时智能交易监控等重大升级;推出多款树立行业标杆的拳头功能:指数宝、理财日历、模拟组合、实时估值等。与此同时,互联网金融对外合作业务取得重大突破,与多家互联网巨头达成深度战略合作。截至年底,对外合作伙伴数量已超110家,成为业内对外合作最多的公司之一。

2018年,汇添富基金持续推进大机构战略,机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任,获得所有大型银行及保险委外专户组合,且保险委托管理规模同业排名第一。养老金业务方面,公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格,也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模快速增长,受托管理组合账户数量及规模持续增加。

2018年,公司积极开展渠道销售和培训工作,专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动,营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2018年,汇添富基金继续提升客户服务能力,全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设,搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系,为公司各项销售业务提供全方位支持。同时,持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设,丰富服务渠道,提高客服体验。

2018年,香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理继续发挥显著成效,国际业务总资产管理规模取得长足进步。公司海外产品线进一步完善,发行了QDII项下汇添富全球消费行业混合型证券投资基金;港股通项下添富沪港深大盘价值混合基金、添富沪港深优势定开基金。"港股通"类委外专户管理规模继续保持领先,海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2018年,香港子公司在加强母公司投研一体化基础上,港股投资及海外债券投资业绩持续优异,汇添富中港策略基金获得晨星三年与五年的五星评级,根据彭博统计在最近三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一;汇添富港币债券基金获得晨星三年和五年四星评级。

2018年,汇富公益事业坚持不懈,连续第十一年开展"河流·孩子"公益助学计划。继2017年公司党委下属的八个党支部和各地"添富小学"建立结对关系后,2018年,各支部纷纷前往相应学校开展回访及支教活动。党员们经过实地探访,了解学校实际困难和发展需求,邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的"添富小学"参加公益服务,并通过向公司员工发售筹款台历、参加"99公益日"筹款、参与"一个鸡蛋的暴走"等活动,全年筹款约8万余元,用于添富小学国学课程筹备及开设、教师培训项目开展、图书室扩充等。

2019年,汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则,进一步加强风险管理能力,提升客户服务水平,推动业务稳步发展,为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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		
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金、优选回报裁合基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开基金、添富鑫汇定开债券基金、汇添富睿丰裁合基金、汇添富新睿精选裁合基金、添富短债债券基金、添富丰润中短债基金的基金经理、汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2017年4月20日	-	12	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日任摘银安德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16日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富优选回报裁合基金(原理财21天债券基金)的基金经理,2015年3月16日至2018年5月4日任汇添富理财14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、添富通货币基金、实业债债券基金的基金经理,2016年6月7日至2018年5月4日任理财30天债券基金、理财60天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理,2017年6月16日至今任添富年年益定开裁合基金的基金经理,2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理,2018年8月2日至今任汇添富睿丰裁合基金、汇添富新睿精选裁合基金的基金经理,2018年12月13日至今任添富短债债券基金的基金经理,2018年12月24日至今任添富丰润中短债基金的基金经理。
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富鑫安保本裁合基金、汇添富鑫稳保本裁合基金、汇添富保鑫保本裁合基金、汇添富鑫鑫保本裁合基金、汇添富鑫利债券基金、汇添富汇定开债券基金、汇添富汇丰回报裁合、汇添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开裁合、汇添富双利债券的基金经理。	2017年4月20日	-	7	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日至今任汇添富鑫安保本裁合基金的基金经理,2016年8月31日至今任汇添富鑫稳保本裁合基金的基金经理,2016年9月29日至今任汇添富保鑫保本裁合基金的基金经理,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日至今任汇添富鑫双收益定开裁合基金的基金经理。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日至今任汇添富鑫汇定开债券基金的基金经理,2017年9月27日至今任汇添富民丰回报裁合基金的基金经理,2018年1月26日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理,2018年4月16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理,2018年9月28日至今任添富年年丰定开裁合、汇添富双利债券的基金经理。

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、本基金管理人于2017年8月18日公告,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。

蒋文玲女士已于2018年1月30日结束休假,恢复履行本基金的基金经理职务。本基金管理人已于2018年2月1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 公平交易制度和控制方法

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》,本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系,覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合;涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:(1)在研究环节,公司建立了统一的投研平台信息管理系统,公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时,通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。(2)在投资环节,公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会,各委员会根据各自议事规则分别召开会议,在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略,独立制定资产配置计划和组合调整方案,并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3)在交易环节,公司实行集中交易,所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式,按照"时间优先、价格优先、比例分配"的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理,严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配,确保交易的公平性。(4)在交易监控环节,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5)在报告分析方面,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时,投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 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。报告期内,本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度,进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算,以及稽核监察等相关部门组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控,确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3日、5日)同向交易的样本,根据95%置信区间下差价率的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等方面进行综合分析,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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13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

2018年上半年金融去杠杆背景下,企业融资渠道收紧,信用违约事件频发。为对冲信用收缩和违约风险传染,央行货币政策发生转向,通过定向降准释放流动性。中美贸易摩擦的持续发酵,经济中长期增长的不确定性加大,对市场风险偏好产生重大负面影响。下半年,融资环境的持续收缩开始对经济产生拖累,经济下行压力明显加大。为应对经济下行压力,货币政策基调更宽松,政策从去杠杆向稳杠杆过渡,逆周期调整政策力度明显加大。但宽货币向宽信用的传导不畅,表现为社会融资增速持续下行。

2018年中债财富总指数上涨9.63%,高等级信用债和利率债下行幅度较大,中低评级信用利差走阔。

报告期内,组合债券持仓以中短久期高等级信用债和同业存单为主。

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1.0435元,本报告期基金份额净值增长率为4.72%;截至本报告期末汇添富鑫益定开债C基金份额净值为1.0363元,本报告期基金份额净值增长率为4.30%;同期业绩比较基准收益率为4.79%。

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2019,经济下行的压力仍然较大,一是全球经济共振向下带来的外需走弱;二是房地产投资高位回落的压力仍未释放;三是企业盈利以及库存周期的下行阶段仍未结束,同时伴随着融资需求出现内生收缩。政策方面,随着财政逐步发力,预计基建投资在专项债大规模发行的配合下会出现较为明显的反弹;货币宽松力度则有望进一步增强,此外去杠杆开始转向稳杠杆,社融增速也有望企稳反弹。

债券市场进入牛市后半程,但利率债波动性提升,票息相对资本利得的性价比显著高。预计资金面宽松的局面能够维持,加杠杆的收益依然非常可观。随着宽信用政策的不断出台和货币环境的持续宽松,中低等级信用利差有望收窄。

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。

本基金于2018年3月23日实施利润分配,A级每10份基金份额派发红利0.098元人民币,C级每10份基金份额派发红利0.098元人民币。

本基金于2019年3月20日实施利润分配,A级每10份基金份额派发红利0.361元人民币,C级每10份基金份额派发红利0.361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,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对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为14,702,374.63元。

5.3 托管人对本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2018年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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师徐艳、许培菁于2019年3月25日签字出具了安永华明(2019)审字第60466941_B83号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	4,262,938.93	204,386,241.88
结算备付金	-	1,368,181.82
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,491,941,000.00	1,229,472,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,491,941,000.00	1,229,472,000.00
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	39,996,179.99	14,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	30,344,656.74	15,251,430.68
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,566,543,769.66	1,514,477,854.38
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	-	3,975,890.41
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	530,782.93	514,996.31
应付托管费	132,696.99	128,749.61
应付销售服务费	32.56	36.45
应付交易费用	14,031.69	24,147.17
应交税费	106,573.44	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	320,000.00	320,000.00
负债合计	1,103,117.51	4,963,818.15
所有者权益:		
实收基金	1,500,213,921.63	1,500,242,304.95
未分配利润	65,226,730.52	9,271,731.28
所有者权益合计	1,565,440,652.15	1,509,514,036.23
负债和所有者权益总计	1,566,543,769.66	1,514,477,854.38

注: 报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0435元,基金份额总额1,500,213,921.63份,其中下属A类基金份额参考净值1.0435元,份额总额1,500,121,311.22份;下属C类基金份额参考净值1.0363元,份额总额92,610.41份。

7.2 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:2018年1月1日 至 2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日 至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年04月20日(基金合同生效日)至 2017年12月31日
一、收入	83,594,068.41	51,419,391.29
1.利息收入	73,863,927.34	50,220,144.61
其中:存款利息收入	10,198,922.56	28,656,962.88
债券利息收入	63,568,411.08	21,425,498.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	96,593.70	138,683.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-575,211.27	1,658,662.06
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-575,211.27	1,658,662.06
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"-"号填列)	10,305,342.34	-459,415.37
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	12,936,169.15	11,240,318.27
1. 管理人报酬	6,140,321.57	4,228,298.37
2. 托管费	1,535,080.41	1,057,074.57
3. 销售服务费	397.74	335.21
4. 交易费用	11,325.00	9,975.00
5. 利息支出	4,718,138.02	5,605,100.96
其中:卖出回购金融资产支出	4,718,138.02	5,605,100.96
6. 税金及附加	157,334.34	-
7. 其他费用	373,572.07	339,534.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	70,657,899.26	40,179,073.02

7.3 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:2018年1月1日 至 2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年12月31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)	1,500,242,304.95	9,271,731.28	1,509,514,036.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	70,657,899.26	70,657,899.26
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)	-28,383.32	-525.39	-28,908.71
其中:1.基金申购款	214.28	1.64	215.92
2.基金赎回款	-28,597.60	-527.03	-29,124.63
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)	-	-14,702,374.63	-14,702,374.63
五、期末所有者权益(基金净值)	1,500,213,921.63	65,226,730.52	1,565,440,652.15

项目	上年度可比期间 2017年04月20日(基金合同生效日)至 2017年12月31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)	-	40,179,073.02	40,179,073.02
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)	-114,846.26	-1,088.93	-115,935.19
其中:1.基金申购款	923.66	3.74	927.40
2.基金赎回款	-115,774.92	-1,092.67	-116,867.59
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)	-	-30,906,252.81	-30,906,252.81
五、期末所有者权益(基金净值)	1,500,242,304.95	9,271,731.28	1,509,514,036.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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。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。

7.4.2 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(年度报告和半年度报告)》、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。

7.4.3 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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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