汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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8月29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2019年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

汇添富鑫利债券型证券投资基金于2019年01月16日起变更注册为汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金。基金托管人及基金注册登记机构不变,基金代码亦保持不变, 其中A类份额基金代码为 “003532”,C类份额基金代码为“003533”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019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	汇添富鑫利定开债券	
基金主代码	003532	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年03月13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	1,876,837,277.58份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富鑫利定开债券A	汇添富鑫利定开债券C
下属分级基金的交易代码	003532	003533
报告期末下属分级基金的份额总额	1,876,806,348.79份	30,928.79份

注:于2018年12月07日,汇添富鑫利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过了《关于汇添富鑫利债券型证券投资基金修订基金合同有关事项的议案》,持有人大会的决议已于当日生效。汇添富鑫利债券型证券投资基金于2019年01月16日起变更注册为汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金。新《基金合同》生效日为2019年1月16日。

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全的基础上,本基金力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势,自上而下决定类属资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。
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

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20楼 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	汇添富鑫利定开债券A	汇添富鑫利定开债券C
本期已实现收益	22,321,823.83	371.08
本期利润	25,160,297.74	419.88
加权平均基金份额本期利润	0.0186	0.0133
本期基金份额净值增长率	1.47%	1.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0215	0.0717
期末基金资产净值	1,938,044,029.31	33,490.01
期末基金份额净值	1.0326	1.0828

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。

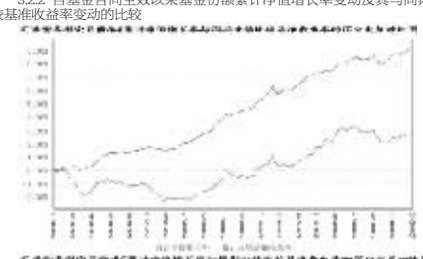
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

汇添富鑫利定开债券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	0.49%	0.02%	0.28%	0.03%	0.21%	-0.01%
过去三个月	0.63%	0.06%	-0.24%	0.06%	0.87%	0.00%
过去六个月	1.47%	0.05%	0.24%	0.06%	1.23%	-0.01%
过去一年	4.09%	0.05%	2.82%	0.06%	1.27%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	9.30%	0.04%	2.79%	0.06%	6.51%	-0.02%
汇添富鑫利定开债券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	0.45%	0.02%	0.28%	0.03%	0.17%	-0.01%
过去三个月	0.52%	0.06%	-0.24%	0.06%	0.76%	0.00%
过去六个月	1.27%	0.05%	0.24%	0.06%	1.03%	-0.01%
过去一年	3.67%	0.05%	2.82%	0.06%	0.85%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	8.28%	0.04%	2.79%	0.06%	5.49%	-0.02%

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:1、本基金的《基金合同》生效日为2019年1月16日,截至本报告期末,基金成立未满一年;2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2019年1月16日)起6个月,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经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准,于2005年2月3日正式成立。目前,公司注册资本金为132,724,224元人民币。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,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。

2019上半年,汇添富基金新成立13只公开募集证券投资基金,包括5只债券型基金、4只混合型基金、2只基金中基金、2只指数基金联接基金。截至2019年6月30日,公司共管理133只公开募集证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征,较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富稳定混合(原汇添富稳定保本混合)基金、汇添富稳健保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富稳时收益定开混合、汇添富鑫利一年期混合、汇添富鑫定开债、汇添富鑫定开债、汇添富鑫定开债、汇添富丰年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。	2017年3月13日	-	8	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日至今任汇添富稳定混合(原汇添富稳定保本混合)基金的基金经理,2016年6月13日至今任汇添富稳健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定开债基金(原添富鑫利债券基金)的基金经理,2017年5月15日至今任汇添富稳时收益定开混合基金的基金经理,2017年4月26日至今任汇添富鑫稳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,2017年9月22日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理,2018年1月25日至今任添富鑫永定节债基金的基金经理,2018年4月18日至今任添富鑫稳定开债基金的基金经理,2018年9月26日至今任添富年丰年定开混合、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。

4.2 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5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 报告期内本基金投资策略和运作分析

一季度社融数据好转,显示宽信用政策逐步生效。制造业投资增速下滑,但基建发力、地产投资有韧性,带动固定资产投资增速同比改善。政策托底经济态度明显,央行货币政策保持宽松,更强调逆周期调节和结构性货币政策。

二季度社融总量回落,经济呈现供需两弱。4月经济数据超预期,政策结束前期的危机模式,货币政策边际收紧,推动债券收益率上行。5月贸易战出现反复,叠加银行破刚兑事件引发风险偏好回落,货币政策出现边际放松,定向中小行和非银,债券收益率也跟随下行。

上半年债券收益率先上后下,信用债表现好于利率债,以房地产和城投为代表的信用利差出现修复。上半年中债总财富指数上涨1.49%。

报告期内,组合主要配置短久期、高评级的债券和存单,并适当加杠杆获取稳定的持有收益。

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利债券A基金份额净值为1.0326元, 本报告期基金份额净值增长率为1.47%; 截至本报告期末汇添富鑫利债券C基金份额净值为1.0828元, 本报告期基金份额净值增长率为1.27%; 同期业绩比较基准收益率为0.24%。

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,债市将维持震荡偏强的走势。国内经济呈现供需两弱的格局,经济下行压力仍大,货币政策维持偏松基调的确定性较高,有利于债券收益率下行。海外方面,全球央行加码宽松,国内货币政策空间加大。

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: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。

本报告期内, 本基金于2019年05月13日实施利润分配,A级每10份基金份额派发红利0.60元人民币。

本基金于2019年07月01日实施利润分配,A级每10份基金份额派发红利0.13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利定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内, 汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,汇添富鑫利定期开放债券型发起式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112,608,380.22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利定期开放债券型发起式证券投资基金2019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:汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	476,549.33	398,444.98
结算备付金	550,000.00	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,585,534,000.00	201,069,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,585,534,000.00	201,069,000.00
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	-	8,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	32,919,236.83	6,516,620.63
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,619,479,786.16	215,984,065.61
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	679,988,460.01	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	476,441.89	54,804.00
应付托管费	158,813.97	18,268.03
应付销售服务费	11.10	11.89
应付交易费用	19,369.46	3,013.00
应交税费	101,147.24	8,786.93
应付利息	328,160.69	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	329,862.48	360,000.00
负债合计	681,402,266.84	444,883.85
所有者权益:		
实收基金	1,876,837,277.58	200,100,374.41
未分配利润	61,240,241.74	15,438,807.35
所有者权益合计	1,938,077,519.32	215,539,181.76
负债和所有者权益总计	2,619,479,786.16	215,984,065.61

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额1,876,837,277.58份,其中汇添富鑫利定开债券A基金份额总额为1,876,806,348.79份,基金份额净值1.0326元;汇添富鑫利定开债券C基金份额总额为30,928.79份,基金份额净值1.0828元。

6.2 利润表

会计主体:汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	29,905,264.05	7,391,390.85
1.利息收入	26,946,321.14	4,740,318.11
其中:存款利息收入	95,412.78	21,717.72
债券利息收入	26,467,693.23	4,708,410.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	383,215.13	10,190.20
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	120,420.20	102,870.00
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	120,420.20	102,870.00
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)	2,838,522.71	2,548,202.74
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	4,744,546.43	786,575.44
1.管理人报酬	2,143,875.48	307,997.17
2.托管费	714,625.20	102,665.75
3.销售服务费	67.41	150.98
4.交易费用	15,400.00	3,875.00
5.利息支出	1,679,734.60	199,559.36
其中:卖出回购金融资产支出	1,679,734.60	199,559.36
6.税金及附加	42,066.02	4,361.40
7.其他费用	148,777.72	167,965.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	25,160,717.62	6,604,815.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	25,160,717.62	6,604,815.41

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	200,100,374.41	15,438,807.35	215,539,181.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,160,717.62	25,160,717.62
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)	1,676,736,903.17	133,249,096.99	1,809,986,000.16
其中:1.基金申购款	1,676,748,051.37	133,249,966.63	1,809,998,018.00
2.基金赎回款	-11,148.20	-869.64	-12,017.84
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)	-	-112,608,380.22	-112,608,380.22
五、期末所有者权益(基金净值)	1,876,837,277.58	61,240,241.74	1,938,077,519.32
项目	上年度可比期间 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)	200,107,690.46	3,431,322.92	203,539,013.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,604,815.41	6,604,815.41
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)	15,182.15	-1,212.42	13,969.73
其中:1.基金申购款	452,683.56	13,762.88	466,446.44
2.基金赎回款	-437,501.41	-14,975.30	-452,476.71
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)	200,122,872.61	10,034,925.91	210,157,798.52

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

汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),是由汇添富鑫利债券型证券投资基金变更而来。原汇添富鑫利债券型证券投资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]2270号文《关于准予汇添富鑫利债券型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理有限公司(现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3月13日正式生效, 首次设立募集规模为200,141,336.20份基金份额。

2018年12月7日, 汇添富鑫利债券型证券投资基金以现场方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于汇添富鑫利债券型证券投资基金修订基金合同有关事项的议案》, 内容包括汇添富鑫利债券型证券投资基金采取发起式基金形式,调整基金的运作方式及修订基金合同等,并同意将汇添富鑫利债券型证券投资基金更名为汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金, 上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2019年1月16日起,《汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效,《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型定期开放发起式,存续期限不定。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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、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、可交换企业债券、可分离交易债券、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、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。本基金不主动投资股票或权证,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交易债券而产生的权证, 应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。本基金在追求本金安全的基础上,力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“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。

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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
东方证券股份有限公司	118,000,000.00	100.00	16,500,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,143,875.48	307,997.17
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	714,625.20	102,665.75

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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

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

6.4.8.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30日		