

、

# 汇添富长添利定期开放债券型证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 26 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。

本基金的业绩比较基准为“银行五年期定期存款税后利率”，鉴于中国人民银行对基准利率期限档次进行了适当简并，不再公布银行五年期定期存款利率，按照基金合同的约定，本基金管理人经与本基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，决定变更本基金的业绩比较基准，并相应修订基金合同及托管协议。

自 2020 年 4 月 14 日起，本基金的业绩比较基准由原“银行五年期定期存款税后利率”变更为“三年期定期存款利率（税后）+0.5%”

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 13 日，本基金的业绩比较基准为“银行五年期定期存款税后利率”；自 2020 年 4 月 14 日起，本基金的业绩比较基准为“三年期定期存款利率（税后）+0.5%”。汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金基金合同及托管协议即日生效。

## 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（转型后）.....                         | 6         |
| 2.1 基金基本情况（转型前）.....                         | 6         |
| 2.2 基金产品说明（转型后）.....                         | 6         |
| 2.2 基金产品说明（转型前）.....                         | 7         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料(转型后).....                         | 8         |
| 2.5 其他相关资料(转型前).....                         | 8         |
| <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(转型后).....                    | 8         |
| 3.1 主要会计数据和财务指标(转型前).....                    | 9         |
| 3.2 基金净值表现（转型后）.....                         | 10        |
| 3.2 基金净值表现（转型前）.....                         | 12        |
| <b>§4 管理人报告 .....</b>                        | <b>13</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 13        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15        |
| 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.....             | 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.....             | 17        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 18        |
| 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.....       | 18        |
| <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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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）（转型后） .....</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>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前） .....</b>         | <b>47</b> |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 6.1 资产负债表.....                             | 47        |
| 6.2 利润表.....                               | 48        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 49        |
| 6.4 报表附注.....                              | 51        |
| <b>§7 投资组合报告（转型后） .....</b>                | <b>72</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 72        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 73        |
| 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.....     | 73        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 73        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 73        |
| 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.....    | 74        |
| 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..... | 74        |
| 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..... | 74        |
| 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.....    | 74        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 74        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 74        |
| <b>§7 投资组合报告（转型前） .....</b>                | <b>75</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 75        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 75        |
| 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.....     | 76        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 76        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 76        |
| 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.....    | 76        |
| 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..... | 77        |
| 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..... | 77        |
| 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.....    | 77        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 77        |
| 7.11 市场中性策略执行情况.....                       | 77        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 77        |
| <b>§8 基金份额持有人信息（转型后） .....</b>             | <b>78</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 78        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 78        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....      | 79        |
| <b>§8 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>             | <b>79</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 79        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 80        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....      | 80        |
| <b>§9 开放式基金份额变动（转型后） .....</b>             | <b>80</b> |
| <b>§9 开放式基金份额变动（转型前） .....</b>             | <b>81</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>81</b> |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 81        |
| 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.....    | 82        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 82        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 82        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 82        |
| 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.....       | 82        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....         | 82        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....         | 83        |
| 10.8 其他重大事件(转型后).....                    | 85        |
| 10.8 其他重大事件(转型前).....                    | 85        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>           | <b>86</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 ..... | 86        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 86        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>87</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 87        |
| 12.2 存放地点.....                           | 87        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 87        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

|                 |                     |                |
|-----------------|---------------------|----------------|
| 基金名称            | 汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 汇添富长添利定期开放债券        |                |
| 基金主代码           | 003528              |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                |
| 基金合同生效日         | 2020 年 4 月 14 日     |                |
| 基金管理人           | 汇添富基金管理股份有限公司       |                |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司        |                |
| 报告期末基金份额总额      | 15,004,112,348.59 份 |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇添富长添利定期开放债券 A      | 汇添富长添利定期开放债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 003528              | 003529         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,004,110,128.87 份 | 2,219.72 份     |

### 2.1 基金基本情况（转型前）

|                 |                     |                |
|-----------------|---------------------|----------------|
| 基金名称            | 汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 汇添富长添利定期开放债券        |                |
| 基金主代码           | 003528              |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                |
| 基金合同生效日         | 2016 年 12 月 6 日     |                |
| 基金管理人           | 汇添富基金管理股份有限公司       |                |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司        |                |
| 报告期末基金份额总额      | 15,004,105,136.66 份 |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇添富长添利定期开放债券 A      | 汇添富长添利定期开放债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 003528              | 003529         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,004,102,916.94 份 | 2,219.72 份     |

### 2.2 基金产品说明（转型后）

|      |                             |
|------|-----------------------------|
| 投资目标 | 在严格管理风险的基础上，力求在本金安全的基础上实现资产 |
|------|-----------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 的长期稳健增值。                                                                                                                                                                          |
| 投资策略   | 在每一运作周期内，本基金将投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金当期运作周期剩余期限的固定收益类金融工具，并主要采取买入并持有的策略，辅以回购融资策略，以力争获得超过业绩比较基准的收益率。包含 1、类属资产配置策略，2、普通债券投资策略，3、可转换债券投资策略，4、中小企业私募债券投资策略，5、资产支持证券投资策略，6、回购融资策略，7、再投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 三年期定期存款利率（税后）+0.5%                                                                                                                                                                |
| 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                                                                                                            |

## 2.2 基金产品说明（转型前）

|        |                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在严格管理风险的基础上，力求在本金安全的基础上实现资产的长期稳健增值。                                                                                                                                               |
| 投资策略   | 在每一运作周期内，本基金将投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金当期运作周期剩余期限的固定收益类金融工具，并主要采取买入并持有的策略，辅以回购融资策略，以力争获得超过业绩比较基准的收益率。包含 1、类属资产配置策略，2、普通债券投资策略，3、可转换债券投资策略，4、中小企业私募债券投资策略，5、资产支持证券投资策略，6、回购融资策略，7、再投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 银行五年期定期存款税后利率                                                                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金                                                                                                            |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                              | 基金托管人                 |
|---------|------|------------------------------------|-----------------------|
| 名称      |      | 汇添富基金管理股份有限公司                      | 中国民生银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李鹏                                 | 罗菲菲                   |
|         | 联系电话 | 021-28932888                       | 010-58560666          |
|         | 电子邮箱 | service@99fund.com                 | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-888-9918                       | 95568                 |
| 传真      |      | 021-28932998                       | 010-58560798          |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号      |
| 办公地址    |      | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼             | 北京市西城区复兴门内大街 2 号      |
| 邮政编码    |      | 200120                             | 100031                |
| 法定代表人   |      | 李文                                 | 高迎欣                   |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                      |
|----------------------|--------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《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 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司 |

## 2.5 其他相关资料(转型后)

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

## 2.5 其他相关资料(转型前)

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

金额单位：人民币元

|               |                                               |                |
|---------------|-----------------------------------------------|----------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020 年 4 月 14 日(基金合同生效日)-2020 年 6 月 30 日) |                |
|               | 汇添富长添利定期开放债券 A                                | 汇添富长添利定期开放债券 C |
| 本期已实现收益       | 109,586,026.46                                | 14.62          |
| 本期利润          | 104,966,027.16                                | 13.92          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0070                                        | 0.0063         |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.69%                                         | 0.62%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.69%                                         | 0.69%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                         |                |



|              |                   |          |
|--------------|-------------------|----------|
| 期末可供分配利润     | 85,619,672.99     | 7.86     |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0057            | 0.0035   |
| 期末基金资产净值     | 15,089,729,801.86 | 2,227.58 |
| 期末基金份额净值     | 1.006             | 1.004    |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年6月30日)  |          |
| 基金份额累计净值增长率  | 0.69%             | 0.69%    |

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。

4、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金于2020年04月14日起正式转型为汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金。

### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年1月1日-2020年4月13日) |                |
|---------------|---------------------------|----------------|
|               | 汇添富长添利定期开放债券 A            | 汇添富长添利定期开放债券 C |
| 本期已实现收益       | 144,314,789.92            | 19.19          |
| 本期利润          | 145,732,177.36            | 19.43          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0097                    | 0.0088         |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.96%                     | 0.87%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.99%                     | 0.79%          |

|               |                   |          |
|---------------|-------------------|----------|
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年4月13日)  |          |
| 期末可供分配利润      | 246,947,421.05    | 33.41    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0165            | 0.0151   |
| 期末基金资产净值      | 15,254,830,394.34 | 2,253.62 |
| 期末基金份额净值      | 1.017             | 1.015    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020年4月13日)  |          |
| 基金份额累计净值增长率   | 12.23%            | 10.93%   |

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（转型后）

### 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

汇添富长添利定期开放债券 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     | 0.40%    | 0.04%       | 0.28%      | 0.01%         | 0.12% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至 | 0.69%    | 0.03%       | 0.69%      | 0.01%         | 0.00% | 0.02% |

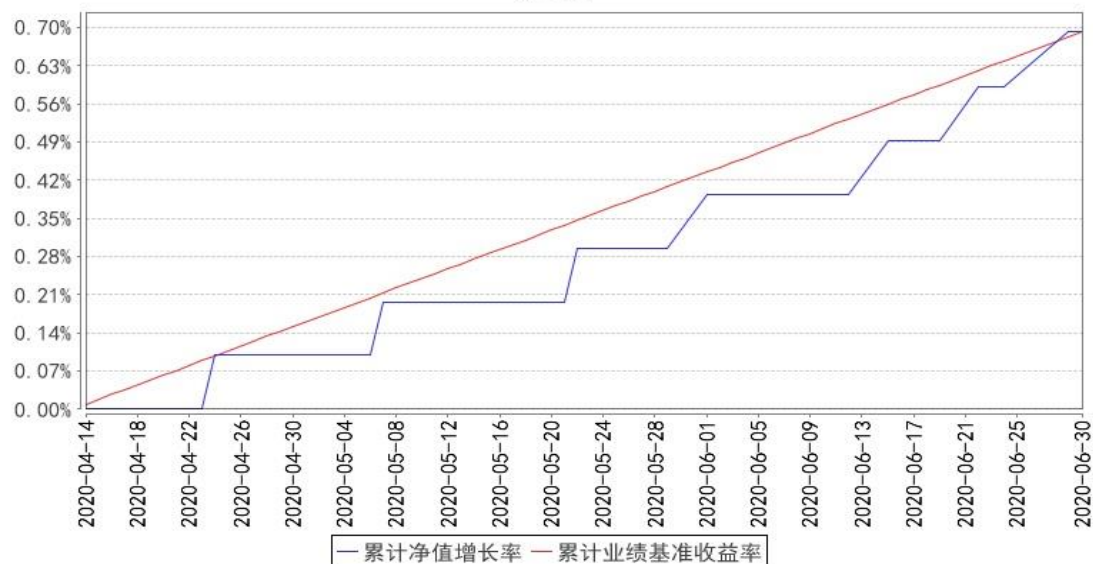
汇添富长添利定期开放债券 C

| 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|    |          |             |            |               |     |     |

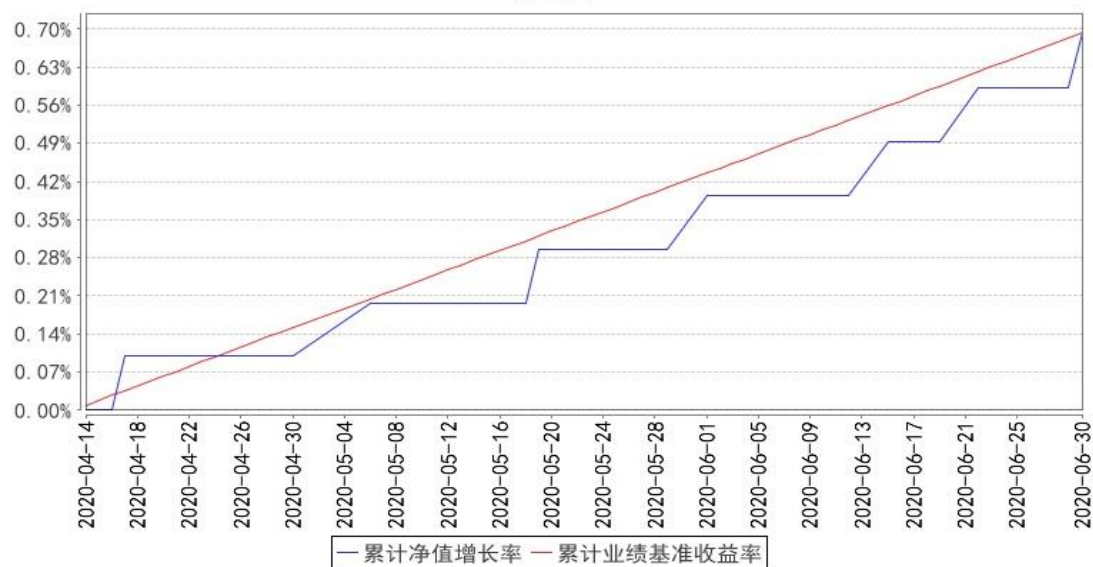
|           |       |       |       |       |       |       |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去一个月     | 0.40% | 0.04% | 0.28% | 0.01% | 0.12% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至 | 0.69% | 0.03% | 0.69% | 0.01% | 0.00% | 0.02% |

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

汇添富长添利定期开放债券A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



汇添富长添利定期开放债券C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《基金合同》生效之日为 2020 年 04 月 14 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为自本《基金合同》生效之日起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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

汇添富长添利定期开放债券 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   |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月     | 0.10%    | 0.03%       | 0.10%      | 0.01%         | 0.00% | 0.02% |
| 过去六个月     | 0.99%    | 0.04%       | 0.78%      | 0.01%         | 0.21% | 0.03% |
| 过去一年      | 2.65%    | 0.03%       | 2.17%      | 0.01%         | 0.48% | 0.02% |
| 过去三年      | 10.14%   | 0.03%       | 7.67%      | 0.01%         | 2.47% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至 | 12.23%   | 0.03%       | 9.23%      | 0.01%         | 3.00% | 0.02% |

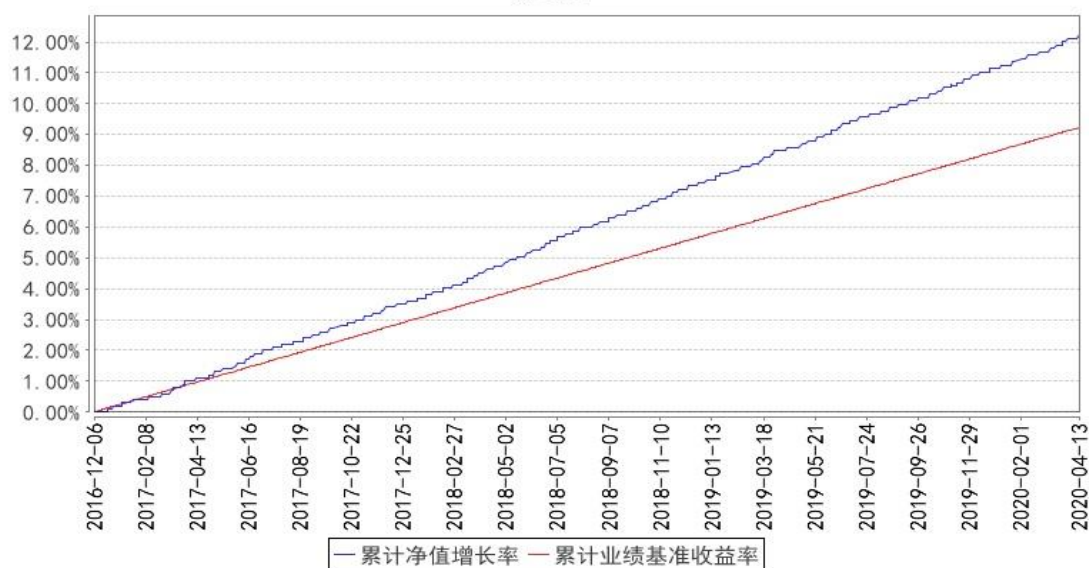
汇添富长添利定期开放债券 C

| 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   |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月     | 0.10%    | 0.03%       | 0.10%      | 0.01%         | 0.00% | 0.02% |
| 过去六个月     | 0.79%    | 0.03%       | 0.78%      | 0.01%         | 0.01% | 0.02% |
| 过去一年      | 2.34%    | 0.03%       | 2.17%      | 0.01%         | 0.17% | 0.02% |
| 过去三年      | 9.07%    | 0.03%       | 7.67%      | 0.01%         | 1.40% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至 | 10.93%   | 0.03%       | 9.23%      | 0.01%         | 1.70% | 0.02% |

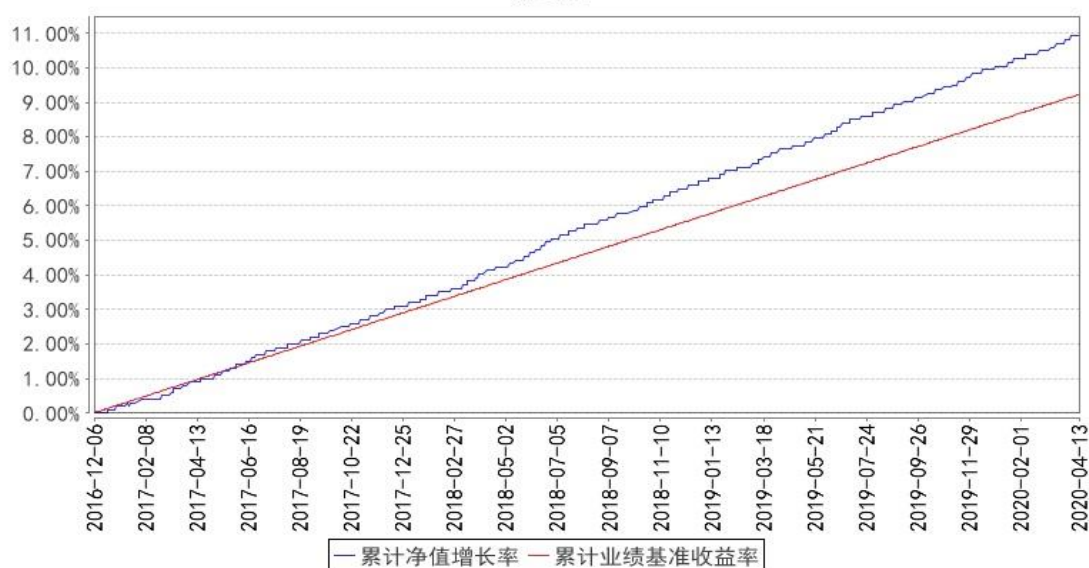
注：本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 4 月 13 日止。本基金的业绩比较基准为“银行五年期定期存款税后利率”。

### 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

汇添富长添利定期开放债券A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



汇添富长添利定期开放债券C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：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2016年12月6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。

2020 上半年，汇添富基金新成立 11 只公开募集证券投资基金，包括 4 只债券型基金、5 只混合型基金、1 只基金中基金、1 只指数基金联接基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 154 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（转型后）

| 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 杨靖 | 本基金的基金经理 | 2019 年 8 月 28 日 | -    | 9 年    | 国籍：中国。学历：南京大学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任华夏基金机构债券投资部投资经理、研究员。2016 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益部专户投资经理。2019 年 2 月 22 日至今任添富 AAA 级信用纯债的基金经理，2019 年 8 月 28 日至今任汇添富长添利定期开放债券、添富鑫汇定开债券的基金经理，2020 年 1 月 6 日至今任汇添富中债 1-3 年农发债的基金经理，2020 年 3 月 23 日至今任汇添富鑫利定开债的基金经理，2020 年 6 月 10 日至今任添富民安增益定开混合的基金经理。 |

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“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、本报告期末发生本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

| 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 杨靖 | 本基金的基金经理 | 2019 年 08 月 28 日 | -    | 9 年    | 国籍：中国。学历：南京大学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任华夏基金机构债券投资部投资经理、研究员。2016 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益部专户投资经理。2019 年 2 月 22 日至今任添富 AAA 级信用纯债的基金经理，2019 年 8 月 28 日至今任汇添富长添利定期开放债券、添富鑫汇定开债券的基金经理，2020 年 1 月 6 日至今任汇添富中债 1-3 年农发债的基金经理，2020 年 3 月 23 日至今任汇添富鑫利定开债的基金经理，2020 年 6 月 10 日至今任添富民安增益定开混合的基金经理。 |

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“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、本报告期末发生本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型后）

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型前）

### 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遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、

营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，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。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据95%置信区间下平均价差率的T检验显著程度、同向交易占比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有34次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2020年上半年，全球经济和政策的关注点都围绕着新冠疫情，主要金融市场都出现了较大的波动。一季度，受海外疫情扩散的影响，欧美股市出现较大调整，海外主要经济体国债利率明显下行，包括美联储在内的多个货币当局紧急降息，各国纷纷出台大规模的财政刺激政策。就国内而言，3月底疫情防控已进入扫尾阶段，重点工作向复工复产过渡，货币环境继续维持宽松，3个月期限的shibor利率由3.0%降至1.9%，各期限的债券利率均出现明显下行。进入二季度后，国内债券市场出现了较大幅度的调整。4月在货币政策宽松的刺激下，各期限的债券收益率创近年来新低，3个月期限的shibor一度降至1.40%左右。5-6月在经济数据逐步回升、资金利率边际收紧、央行表态中性偏严的影响下，各品种的债券收益率自底部出现了80-100bp的上行，导致包括银行理财、债券基金在内的固定收益类产品普遍出现了一定的净值回撤。

报告期内，组合以配置高等级信用债和利率债为主，在市场波动中进行了部分再投资操作。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2020 年 04 月 14 日转型为汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金，转型前汇添富长添利定期开放债券 A 基金本期（2020 年 1 月 1 日至 4 月 13 日）份额净值收益率为 0.99%，汇添富长添利定期开放债券 C 基金本期份额净值收益率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%；转型后汇添富长添利定期开放债券 A 基金本期（2020 年 4 月 14 日至 6 月 30 日）份额净值收益率为 0.69%，汇添富长添利定期开放债券 C 基金本期份额净值收益率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

#### 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，预计宏观经济和政策基调对债券市场整体偏向于中性。相对利好的因素在于房地产市场严格调控的基调不改，意味着实体信用扩张的节奏有望放缓，经济回升或更加温和；相对不利的因素在于稳增长基调依然延续，对应宏观经济总体回升的态势不会发生变化。总体而言，下半年经济延续复苏但复苏斜率放缓，在货币政策基调无重大调整的前提下，预计债券市场以区间震荡为主。

投资策略上，我们认为当前的债券收益率具备长期配置的价值。操作上，组合将以持有策略为主，关注市场波动带来的投资机会。

#### 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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值

第 17 页 共 87 页

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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金金额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份金额该次可供分配利润的 20%，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，即基金收益分配准日的基金份额净值减去每单位收益分配金额后不能低于面值。

本基金于 2020 年 6 月 19 日实施利润分配，A 级每 10 份基金份额派发红利 0.18 元人民币，C 级每 10 份基金份额派发红利 0.18 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 10,831,516.88                  |
| 结算备付金           |            | -                              |
| 存出保证金           |            | -                              |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 206,880,000.00                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              |
| 基金投资            |            | -                              |
| 债券投资            |            | 206,880,000.00                 |
| 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    | 9,000,000.00                   |
| 应收证券清算款         |            | 9,001,601.51                   |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 90,545,433.78                  |
| 应收股利            |            | -                              |
| 应收申购款           |            | -                              |
| 递延所得税资产         |            | -                              |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 14,778,729,550.18              |
| 资产总计            |            | 15,104,988,102.35              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 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       |            | -                              |
| 应付证券清算款         |            | 9,000,000.00                   |
| 应付赎回款           |            | -                              |
| 应付管理人报酬         |            | 3,745,863.39                   |
| 应付托管费           |            | 1,248,621.12                   |
| 应付销售服务费         |            | 0.60                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 8,425.00                       |
| 应交税费            |            | 1,153,708.90                   |
| 应付利息            |            | -                              |

|               |          |                   |
|---------------|----------|-------------------|
| 应付利润          |          | -                 |
| 递延所得税负债       |          | -                 |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 99,453.90         |
| 负债合计          |          | 15,256,072.91     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                   |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 15,004,112,348.59 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 85,619,680.85     |
| 所有者权益合计       |          | 15,089,732,029.44 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 15,104,988,102.35 |

注：(1)报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 15,004,112,348.59 份，其中下属 A 类基金份额参考净值 1.006 元，份额总额 15,004,110,128.87 份；下属 C 类基金份额参考净值 1.004 元，份额总额 2,219.72 份。

(2)本基金转型后合同于 2020 年 4 月 14 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2020 年 6 月 30 日数据，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2020 年 4 月 14 日（基金合同<br>生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|-----------------------------------------------------|
| 一、收入                   |            | 118,434,122.45                                      |
| 1. 利息收入                |            | 123,054,122.45                                      |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 38,841.64                                           |
| 债券利息收入                 |            | 123,013,679.30                                      |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                                   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 1,601.51                                            |
| 证券出借利息收入               |            | -                                                   |
| 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             | 6.4.7.13.5 | -                                                   |
| 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   | -4,620,000.00                                       |

|                     |                |                |
|---------------------|----------------|----------------|
| 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    | -              |
| 减：二、费用              |                | 13,468,081.37  |
| 1. 管理人报酬            | 6. 4. 10. 2. 1 | 9,758,007.50   |
| 2. 托管费              | 6. 4. 10. 2. 2 | 3,252,669.16   |
| 3. 销售服务费            | 6. 4. 10. 2. 3 | 1.56           |
| 4. 交易费用             | 6. 4. 7. 19    | -              |
| 5. 利息支出             |                | 211,983.57     |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |                | 211,983.57     |
| 6. 税金及附加            |                | 190,286.48     |
| 7. 其他费用             | 6. 4. 7. 20    | 55,133.10      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |                | 104,966,041.08 |
| 减：所得税费用             |                | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |                | 104,966,041.08 |

注：本基金转型后合同于2020年4月14日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2020年4月14日（基金合同生效日）至2020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）                   | 15,004,105,136.66                    | 250,727,511.30  | 15,254,832,647.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                    | 104,966,041.08  | 104,966,041.08    |
| 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） | 7,211.93                             | 150.28          | 7,362.21          |
| 其中：1. 基金申购款                       | 9,802.39                             | 204.72          | 10,007.11         |
| 2. 基金赎回款                          | -2,590.46                            | -54.44          | -2,644.90         |
| 四、本期向基金份额持有人分配                    | -                                    | -270,074,021.81 | -270,074,021.81   |

|                          |                   |               |                   |
|--------------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| 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）          | 15,004,112,348.59 | 85,619,680.85 | 15,089,732,029.44 |

注：本基金转型后合同于 2020 年 4 月 14 日生效，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 2020 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日数据，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

汇添富长添利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[2014]1171 号文《关于准予汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，并获中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2412 号文《关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》准予延期募集，由基金管理人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 2016 年 12 月 6 日生效，首次设立募集规模为 15,003,892,912.09 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款），以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证，也不参与一级市场新股申购。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。本基金在严格管理风险的基础上，力求在本金安全的基础上实现资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：三年期定期存款利率（税后）+0.5%。根据《关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同的公告》

的有关规定，自 2020 年 4 月 14 日起，本基金的业绩比较基准由原“银行五年期定期存款税后利率”变更为“三年期定期存款利率（税后）+0.5%”。

#### 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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 04 月 14 日至 2020 年 06 月 30 日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。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 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 2020 年 4 月 14 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 06 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。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金融资产（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：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金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包括股票投资；

#### (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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；持有至到期投资、贷款和应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；

持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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；持有至到期投资、贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。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；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；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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产



或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

表明金融资产发生减值的客观证据，是指金融资产初始确认后实际发生的、对该金融资产的预计未来现金流量有影响，且本基金能够对该影响进行可靠计量的事项。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。

#### 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) 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。分类为持有至到期投资的债券利息收入按实际持有期内逐日计提，付息债券，贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(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) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证

券出借业务利息收入；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（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；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 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；

(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（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；

(11) 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；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(13) 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**

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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；

(3) 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

去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

—

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

—

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 10,831,516.88          |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计             | 10,831,516.88          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |      |        |
|----|------------------------|------|--------|
|    | 成本                     | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | -                      | -    | -      |

|               |       |                |                |             |
|---------------|-------|----------------|----------------|-------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -              | -              | -           |
| 债券            | 交易所市场 | -              | -              | -           |
|               | 银行间市场 | 207,719,794.52 | 206,880,000.00 | -839,794.52 |
|               | 合计    | 207,719,794.52 | 206,880,000.00 | -839,794.52 |
| 资产支持证券        |       | -              | -              | -           |
| 基金            |       | -              | -              | -           |
| 其他            |       | -              | -              | -           |
| 合计            |       | 207,719,794.52 | 206,880,000.00 | -839,794.52 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2020年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 9,000,000.00      | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 9,000,000.00      | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 10,458.97         |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | 90,534,974.81     |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 应收出借证券利息   | -                 |
| 其他         | -                 |

|    |               |
|----|---------------|
| 合计 | 90,545,433.78 |
|----|---------------|

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目      | 本期末<br>2020年6月30日 |
|---------|-------------------|
| 其他应收款   | -                 |
| 待摊费用    | -                 |
| 持有至到期投资 | 14,778,729,550.18 |
| 合计      | -                 |

注：截至本报告期末，本基金持有至到期债券投资成本为 14,778,729,550.18 元，账面价值为 14,778,729,550.18 元，未计提减值损失；其中，交易所市场持有至到期债券投资成本为 1,879,901,903.43 元，账面价值为 1,879,901,903.43 元，未计提减值损失；银行间市场持有至到期债券投资成本为 12,898,827,646.75 元，账面价值为 12,898,827,646.75 元，未计提减值损失。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020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 | 8,425.00          |
| 合计          | 8,425.00          |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付审计费       | 39,781.56         |
| 应付信息披露费     | 59,672.34         |
| 合计          | 99,453.90         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富长添利定期开放债券 A

| 项目 | 本期<br>2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年<br>6月30日 |
|----|------------------------------------------|
|----|------------------------------------------|



|                                                 | 基金份额（份）           | 账面金额              |
|-------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日                                         | 15,004,102,916.94 | 15,004,102,916.94 |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生效日)至2020年6月30日基金份额折算调整      | -                 | -                 |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生效日)至2020年6月30日未领取红利份额折算调整   | -                 | -                 |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生效日)至2020年6月30日集中申购募集资金本金及利息 | -                 | -                 |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生效日)至2020年6月30日基金拆分和集中申购完成后  | -                 | -                 |
| 本期申购                                            | 9,802.39          | 9,802.39          |
| 本期赎回（以“-”号填列）                                   | -2,590.46         | -2,590.46         |
| 本期末                                             | 15,004,110,128.87 | 15,004,110,128.87 |

汇添富长添利定期开放债券C

| 项目                                             | 本期<br>2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年<br>6月30日 |          |
|------------------------------------------------|------------------------------------------|----------|
|                                                | 基金份额（份）                                  | 账面金额     |
| 基金合同生效日                                        | 2,219.72                                 | 2,219.72 |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生效日)至2020年6月30日基金份额折算调整     | -                                        | -        |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生效日)至2020年6月30日未领取红利份额折算调整  | -                                        | -        |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生效日)至2020年6月30日基金拆分和集中申购完成后 | -                                        | -        |

|                                                        |          |          |
|--------------------------------------------------------|----------|----------|
| 效日)至2020年6月30日集中申购募集<br>资金本金及利息                        |          |          |
| 2020年4月14日(修订后的基金合同生<br>效日)至2020年6月30日基金拆分和集<br>中申购完成后 | -        | -        |
| 本期申购                                                   | -        | -        |
| 本期赎回(以“-”号填列)                                          | -        | -        |
| 本期末                                                    | 2,219.72 | 2,219.72 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 汇添富长添利定期开放债券 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<br>效日            | 246,947,421.05  | 3,780,056.35  | 250,727,477.40  |
| 本期利润                   | 109,586,026.46  | -4,619,999.30 | 104,966,027.16  |
| 本期基金份<br>额交易产生<br>的变动数 | 150.57          | -0.29         | 150.28          |
| 其中：基金申<br>购款           | 205.11          | -0.39         | 204.72          |
| 基金赎<br>回款              | -54.54          | 0.10          | -54.44          |
| 本期已分配<br>利润            | -270,073,981.85 | -             | -270,073,981.85 |
| 本期末                    | 86,459,616.23   | -839,943.24   | 85,619,672.99   |
| 汇添富长添利定期开放债券 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<br>日            | 33.41           | 0.49          | 33.90           |
| 本期利润                   | 14.62           | -0.70         | 13.92           |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -               | -             | -               |
| 其中：基金申<br>购款           | -               | -             | -               |
| 基金赎<br>回款              | -               | -             | -               |
| 本期已分配利                 | -39.96          | -             | -39.96          |

|     |      |       |      |
|-----|------|-------|------|
| 润   |      |       |      |
| 本期末 | 8.07 | -0.21 | 7.86 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 38,837.91                            |
| 定期存款利息收入  | -                                    |
| 其他存款利息收入  | -                                    |
| 结算备付金利息收入 | 3.73                                 |
| 其他        | -                                    |
| 合计        | 38,841.64                            |

注：表中“其他”指直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 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

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|-------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,327,424,000.00                     |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,280,000,000.00                     |
| 减：应收利息总额                | 47,424,000.00                        |
| 买卖债券差价收入                | -                                    |

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 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>2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -4,620,000.00                        |
| 股票投资                   | -                                    |
| 债券投资                   | -4,620,000.00                        |
| 资产支持证券投资               | -                                    |
| 基金投资                   | -                                    |
| 贵金属投资                  | -                                    |
| 其他                     | -                                    |
| 2. 衍生工具                | -                                    |
| 权证投资                   | -                                    |
| 3. 其他                  | -                                    |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                    |
| 合计                     | -4,620,000.00                        |

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|---------|--------------------------------------|
| 审计费用    | 17,049.24                            |
| 信息披露费   | 25,573.86                            |
| 证券出借违约金 | -                                    |
| 银行费用    | 3,210.00                             |
| 账户维护费   | 9,300.00                             |
| 合计      | 55,133.10                            |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司        | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司（“民生银行”） | 基金托管人、基金代销机构          |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）   | 基金管理人的股东、基金代销机构       |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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                             |                   |
|------------|--------------------------------|-------------------|
|            | 2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |                   |
|            | 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 | 2,467,300,000.00               | 100.00            |

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 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                             |
|-----------------|--------------------------------|
|                 | 2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 9,758,007.50                   |
| 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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托，于次月前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                             |
|----------------|--------------------------------|
|                | 2020年4月14日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,252,669.16                   |

注：自2013年11月6日（基金合同生效日）至2017年5月8日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%年费率计提；于2017年5月8日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

R为基金托管费年费率

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>2020 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |                    |      |
|----------------|-------------------------------------------------|--------------------|------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                |                    |      |
|                | 汇添富长添利定期开放<br>债券 A                              | 汇添富长添利定期开放<br>债券 C | 合计   |
|                |                                                 |                    |      |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -                                               | 1.56               | 1.56 |
| 合计             | -                                               | 1.56               | 1.56 |

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前 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末不存在与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

务的情况。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末不存在与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                         | 本期<br>2020年4月14日(基金合同生效日)至2020年6月30日 | 本期<br>2020年4月14日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
|----------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
|                            | 汇添富长添利定期开放债券A                        | 汇添富长添利定期开放债券C                        |
| 基金合同生效日(2020年4月14日)持有的基金份额 | 283,426.21                           | —                                    |
| 报告期初持有的基金份额                | 283,426.21                           | —                                    |
| 报告期间申购/买入总份额               | 9,735.91                             | —                                    |
| 报告期间因拆分变动份额                | —                                    | —                                    |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额             | —                                    | —                                    |
| 报告期末持有的基金份额                | 293,162.12                           | —                                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 0.00%                                | —                                    |

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年4月14日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
|-------|--------------------------------------|
|-------|--------------------------------------|



|              | 期末余额          | 当期利息收入    |
|--------------|---------------|-----------|
| 中国民生银行股份有限公司 | 10,831,516.88 | 38,837.91 |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 汇添富长添利定期开放债券 A |                    |     |                    |                       |                    |               |                    |    |
|----------------|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|--------------------|---------------|--------------------|----|
| 序号             | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份基<br>金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额       | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计       | 备注 |
|                |                    | 场内  | 场外                 |                       |                    |               |                    |    |
| 1              | 2020 年 6<br>月 19 日 | -   | 2020 年 6 月<br>19 日 | 0.1800                | 270,073,<br>915.10 | 66.75         | 270,073,<br>981.85 | -  |
| 合计             | -                  | -   | -                  | 0.1800                | 270,073,<br>915.10 | 66.75         | 270,073,<br>981.85 | -  |
| 汇添富长添利定期开放债券 C |                    |     |                    |                       |                    |               |                    |    |
| 序号             | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份基<br>金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额       | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计       | 备注 |
|                |                    | 场内  | 场外                 |                       |                    |               |                    |    |
| 1              | 2020 年 6<br>月 19 日 | -   | 2020 年 6 月<br>19 日 | 0.1800                | 39.96              | -             | 39.96              | -  |
| 合计             | -                  | -   | -                  | 0.1800                | 39.96              | -             | 39.96              | -  |

#### 6.4.12 期末(2020 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：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 |
|--------|-------------------|
| A-1    | -                 |
| A-1 以下 | -                 |
| 未评级    | 1,312,073,032.13  |
| 合计     | 1,312,073,032.13  |

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA    | 3,737,018,809.28  |
| AAA 以下 | -                 |
| 未评级    | 9,936,517,708.77  |
| 合计     | 13,673,536,518.05 |

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资及结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 年 6 月<br>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                      | 10,831,516.88 | -      | -        | -     | -     | -   | 10,831,516.88 |
| 结算备付金                     | -             | -      | -        | -     | -     | -   | -             |
| 存出保证金                     | -             | -      | -        | -     | -     | -   | -             |

|           |                |                |                  |                   |   |               |                   |
|-----------|----------------|----------------|------------------|-------------------|---|---------------|-------------------|
| 交易性金融资产   | -              | -              | -                | 206,880,000.00    | - | -             | 206,880,000.00    |
| 衍生金融资产    | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 买入返售金融资产  | 9,000,000.00   | -              | -                | -                 | - | -             | 9,000,000.00      |
| 应收利息      | -              | -              | -                | -                 | - | 90,545,433.78 | 90,545,433.78     |
| 应收股利      | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 应收申购款     | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 应收证券清算款   | -              | -              | -                | -                 | - | 9,001,601.51  | 9,001,601.51      |
| 其他资产      | 419,334,359.97 | 249,185,059.53 | 1,369,515,336.23 | 12,740,694,794.45 | - | -             | 14,778,729,550.18 |
| 资产总计      | 439,165,876.85 | 249,185,059.53 | 1,369,515,336.23 | 12,947,574,794.45 | - | 99,547,035.29 | 15,104,988,102.35 |
| 负债        | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 应付赎回款     | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -                | -                 | - | 3,745,863.39  | 3,745,863.39      |
| 应付托管费     | -              | -              | -                | -                 | - | 1,248,621.12  | 1,248,621.12      |
| 应付证券清算款   | -              | -              | -                | -                 | - | 9,000,000.00  | 9,000,000.00      |
| 卖出回购金融资产款 | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 应付销售服务费   | -              | -              | -                | -                 | - | 0.60          | 0.60              |
| 应付交易费用    | -              | -              | -                | -                 | - | 8,425.00      | 8,425.00          |
| 应付利息      | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 应付利润      | -              | -              | -                | -                 | - | -             | -                 |
| 应交税费      | -              | -              | -                | -                 | - | 1,153,708.90  | 1,153,708.90      |
| 其他负债      | -              | -              | -                | -                 | - | 99,453.90     | 99,453.90         |
| 负债总计      | -              | -              | -                | -                 | - | 15,256,072.91 | 15,256,072.91     |
| 利率敏感度缺口   | 439,165,876.85 | 249,185,059.53 | 1,369,515,336.23 | 12,947,574,794.45 | - | 84,290,962.38 | 15,089,732,029.44 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                                                                                                                 |                             |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                                                                                                                 |                             |
|    | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；                                                                                           |                             |
|    | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                                                                                                          |                             |
|    | 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利[CTX1] 息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； |                             |
|    | 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券、可交换债券以及持有至到期投资的债券资产。                                                                                                 |                             |
|    | 相关风险变量的变动                                                                                                                                       | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                                                                                                                                                 | 本期末（2020 年 6 月 30 日）        |
| 分析 | 基准利率减少 25 个基点                                                                                                                                   | -58,370,801.57              |
|    | 基准利率增加 25 个基点                                                                                                                                   | 58,765,738.38               |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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 2020 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 4 月 13 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2020 年 4 月 13 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 17,558,053.81                  | 1,970,469.58                     |
| 结算备付金           |            | —                              | 59,524.86                        |
| 存出保证金           |            | —                              | —                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 211,500,000.00                 | 762,875,000.00                   |
| 其中：股票投资         |            | —                              | —                                |
| 基金投资            |            | —                              | —                                |
| 债券投资            |            | 211,500,000.00                 | 762,875,000.00                   |
| 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         |            | —                              | —                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 344,888,434.96                 | 323,042,104.83                   |
| 应收股利            |            | —                              | —                                |
| 应收申购款           |            | —                              | —                                |
| 递延所得税资产         |            | —                              | —                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 14,683,289,753.56              | 14,027,253,819.03                |
| 资产总计            |            | 15,257,236,242.33              | 15,115,200,918.30                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 4 月 13 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 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     |          | -                 | -                 |
| 应付证券清算款       |          | -                 | -                 |
| 应付赎回款         |          | -                 | -                 |
| 应付管理人报酬       |          | 1,624,596.71      | 3,845,091.83      |
| 应付托管费         |          | 541,532.24        | 1,281,697.24      |
| 应付销售服务费       |          | 0.26              | 0.62              |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 11,972.48         | 15,775.00         |
| 应交税费          |          | 168,661.88        | 677,902.44        |
| 应付利息          |          | -                 | -                 |
| 应付利润          |          | -                 | -                 |
| 递延所得税负债       |          | -                 | -                 |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 56,830.80         | 280,000.00        |
| 负债合计          |          | 2,403,594.37      | 6,100,467.13      |
| <b>所有者权益：</b> |          |                   |                   |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 15,004,105,136.66 | 15,004,105,136.66 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 250,727,511.30    | 104,995,314.51    |
| 所有者权益合计       |          | 15,254,832,647.96 | 15,109,100,451.17 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 15,257,236,242.33 | 15,115,200,918.30 |

注： 报告截止日 2020 年 04 月 13 日，基金份额总额 15,004,105,136.66 份，其中下属 A 类基金份额参考净值 1.017 元，份额总额 15,004,102,916.94 份；下属 C 类基金份额参考净值 1.015 元，份额总额 2,219.72 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 13 日

单位：人民币元

| 项 目        | 附注号      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>4 月 13 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 30 日 |
|------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入       |          | 164,219,416.79                           | 305,913,729.39                                |
| 1. 利息收入    |          | 165,594,416.79                           | 309,873,729.39                                |
| 其中：存款利息收入  | 6.4.7.11 | 105,945.78                               | 295,638.19                                    |
| 债券利息收入     |          | 165,191,507.30                           | 308,568,650.37                                |
| 资产支持证券利息收入 |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入 |          | 296,963.71                               | 1,009,440.83                                  |



|                        |            |                |                |
|------------------------|------------|----------------|----------------|
| 证券出借利息收入               |            | -              | -              |
| 其他利息收入                 |            | -              | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -2,792,387.68  | -              |
| 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   | -2,792,387.68  | -              |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.13.5 | -              | -              |
| 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   | 1,417,387.68   | -3,960,000.00  |
| 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   | -              | -              |
| 减：二、费用                 |            | 18,487,220.00  | 31,535,116.59  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 12,938,250.43  | 22,813,085.21  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 4,312,750.16   | 7,604,361.76   |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 2.08           | 6.86           |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | -              | -              |
| 5. 利息支出                |            | 872,670.42     | 249,713.15     |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 872,670.42     | 249,713.15     |
| 6. 税金及附加               |            | 294,786.11     | 727,257.13     |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 68,760.80      | 140,692.48     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 145,732,196.79 | 274,378,612.80 |
| 减：所得税费用                |            | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 145,732,196.79 | 274,378,612.80 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年4月13日

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月13日 |                |                   |
|---------|----------------------------|----------------|-------------------|
|         | 实收基金                       | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者 | 15,004,105,136.66          | 104,995,314.51 | 15,109,100,451.17 |

|                                        |                                 |                 |                   |
|----------------------------------------|---------------------------------|-----------------|-------------------|
| 权益(基金净值)                               |                                 |                 |                   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 145,732,196.79  | 145,732,196.79    |
| 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)      | -                               | -               | -                 |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                               | -               | -                 |
| 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)                        | 15,004,105,136.66               | 250,727,511.30  | 15,254,832,647.96 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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)                        | 15,004,051,059.74               | 553,793,393.02  | 15,557,844,452.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 274,378,612.80  | 274,378,612.80    |
| 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)      | 20,295.09                       | 204.17          | 20,499.26         |
| 其中：1. 基金申购款                            | 32,884.37                       | 328.78          | 33,213.15         |
| 2. 基金赎回款                               | -12,589.28                      | -124.61         | -12,713.89        |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金                  | -                               | -630,170,130.55 | -630,170,130.55   |

|                   |                   |                |                   |
|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 净值变动（净值减少以“-”号填列） |                   |                |                   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）   | 15,004,071,354.83 | 198,002,079.44 | 15,202,073,434.27 |

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

汇添富长添利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[2014]1171 号文《关于准予汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,并获中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2412 号文《关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》准予延期募集,由基金管理人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 2016 年 12 月 6 日生效,首次设立募集规模为 15,003,892,912.09 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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款及协议存款),以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证,也不参与一级市场新股申购。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。本基金在严格管理风险的基础上,力求在本金安全的基础上实现资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为:银行五年期定期存款税后利率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会

计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年4月13日的财务状况以及2020年01月01日至2020年04月13日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 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**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 印花税**

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

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

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

暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 4 月 13 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 17,558,053.81          |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |

|             |               |
|-------------|---------------|
| 存款期限 3 个月以上 | -             |
| 其他存款        | -             |
| 合计          | 17,558,053.81 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 4 月 13 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | -                      | -              | -              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | -              | -              |
|               | 银行间市场                  | 207,719,794.52 | 211,500,000.00 |
|               | 合计                     | 207,719,794.52 | 211,500,000.00 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -              |
| 基金            | -                      | -              | -              |
| 其他            | -                      | -              | -              |
| 合计            | 207,719,794.52         | 211,500,000.00 | 3,780,205.48   |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 4 月 13 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 5,227.14               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 221.40                 |
| 应收债券利息     | 344,882,986.42         |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |

|            |                |
|------------|----------------|
| 应收申购款利息    | -              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -              |
| 应收出借证券利息   | -              |
| 其他         | -              |
| 合计         | 344,888,434.96 |

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目      | 本期末<br>2020年4月13日 |
|---------|-------------------|
| 其他应收款   | -                 |
| 待摊费用    | -                 |
| 持有至到期投资 | 14,683,289,753.56 |
| 合计      | 14,683,289,753.56 |

注：截至本报告期末，本基金持有至到期债券投资成本为 14,683,289,753.56 元，账面价值为 14,683,289,753.56 元，未计提减值损失；其中，交易所市场持有至到期债券投资成本为 2,064,223,011.17 元，账面价值为 2,064,223,011.17 元，未计提减值损失；银行间市场持有至到期债券投资成本为 12,619,066,742.39 元，账面价值为 12,619,066,742.39 元，未计提减值损失。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年4月13日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 11,972.48         |
| 合计          | 11,972.48         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年4月13日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付信息披露费     | 34,098.48         |
| 应付审计费       | 22,732.32         |
| 合计          | 56,830.80         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富长添利定期开放债券 A

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|



|               | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 13 日 |                   |
|---------------|---------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额              |
| 上年度末          | 15,004,102,916.94               | 15,004,102,916.94 |
| 本期申购          | -                               | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                               | -                 |
| -基金拆分/份额折算前   | -                               | -                 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                               | -                 |
| 本期申购          | -                               | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                               | -                 |
| 本期末           | 15,004,102,916.94               | 15,004,102,916.94 |

汇添富长添利定期开放债券 C

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 13 日 |          |
|---------------|---------------------------------------|----------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额     |
| 上年度末          | 2,219.72                              | 2,219.72 |
| 本期申购          | -                                     | -        |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -        |
| -基金拆分/份额折算前   | -                                     | -        |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -        |
| 本期申购          | -                                     | -        |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -        |
| 本期末           | 2,219.72                              | 2,219.72 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 汇添富长添利定期开放债券 A |                |              |                |
|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分        | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 102,632,631.13 | 2,362,668.91 | 104,995,300.04 |
| 本期利润           | 144,314,789.92 | 1,417,387.44 | 145,732,177.36 |
| 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            | 246,947,421.05 | 3,780,056.35 | 250,727,477.40 |
| 汇添富长添利定期开放债券 C |                |              |                |
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分        | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 14.22          | 0.25         | 14.47          |

|                        |       |      |       |
|------------------------|-------|------|-------|
| 本期利润                   | 19.19 | 0.24 | 19.43 |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -     | -    | -     |
| 其中：基金申<br>购款           | -     | -    | -     |
| 基金赎<br>回款              | -     | -    | -     |
| 本期已分配利<br>润            | -     | -    | -     |
| 本期末                    | 33.41 | 0.49 | 33.90 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月13日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 64,384.99                  |
| 定期存款利息收入  | -                          |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 41,560.79                  |
| 其他        | -                          |
| 合计        | 105,945.78                 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 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

单位：人民币元

| 项目                          | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月13日 |
|-----------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交<br>总额   | 2,294,006,400.00           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）<br>成本总额 | 2,212,792,387.68           |
| 减：应收利息总额                    | 84,006,400.00              |
| 买卖债券差价收入                    | -2,792,387.68              |

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注:本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注: 本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注:本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 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>2020年1月1日至2020年4月13日 |
|-----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产                  | 1,417,387.68               |
| 股票投资                        | -                          |
| 债券投资                        | 1,417,387.68               |
| 资产支持证券投资                    | -                          |
| 基金投资                        | -                          |
| 贵金属投资                       | -                          |
| 其他                          | -                          |
| 2. 衍生工具                     | -                          |
| 权证投资                        | -                          |
| 3. 其他                       | -                          |
| 减: 应税金融商品公允价值变动<br>产生的预估增值税 | -                          |
| 合计                          | 1,417,387.68               |

#### 6.4.7.18 其他收入

注:本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

注: 本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月13日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 22,732.32                  |
| 信息披露费   | 34,098.48                  |
| 证券出借违约金 | -                          |

|       |           |
|-------|-----------|
| 银行费用  | 2,630.00  |
| 账户维护费 | 9,300.00  |
| 合计    | 68,760.80 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

经 2020 年 4 月 14 日的公告《关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准为“银行五年期定期存款税后利率”，鉴于中国人民银行对基准利率期限档次进行了适当简并，不再公布银行五年期定期存款利率，按照基金合同的约定，本基金管理人经与本基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，决定变更本基金的业绩比较基准，并相应修订基金合同。自 2020 年 4 月 14 日起，本基金的业绩比较基准由原“银行五年期定期存款税后利率”变更为“三年期定期存款利率（税后）+0.5%”。基金合同“第十二部分 基金的投资”中“五、业绩比较基准”由：“银行五年期定期存款税后利率。如果今后法律法规发生变化，或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布，或者市场中出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。”修订为：“三年期定期存款利率（税后）+0.5%。本基金以定期开放的方式运作，以 66 个月为一个运作周期，在每一运作周期内，本基金主要采取买入并持有的策略。以三年期定期存款利率（税后）+0.5%作为本基金的业绩比较基准符合产品特性，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量本基金的业绩表现。三年期定期存款利率采用每个运作周期起始日中国人民银行公布的金融机构人民币三年期存款基准利率。如果今后法律法规发生变化，或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布，或者市场中出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。”上述变更业绩比较基准并相应修订基金合同的事项对原基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的约定。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司        | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司（“民生银行”） | 基金托管人、基金代销机构          |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）   | 基金管理人的股东、基金代销机构       |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月13日 |                           | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                           |
|------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券股份有限公司 | 4,018,500,000.00           | 100.00                    | 7,080,900,000.00                | 100.00                    |

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 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>2020年1月1日至2020年4<br>月13日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 12,938,250.43                  | 22,813,085.21                       |
| 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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前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>2020年1月1日至2020年4<br>月13日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,312,750.16                   | 7,604,361.76                        |

注：自2013年11月6日（基金合同生效日）至2017年5月8日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%年费率计提；于2017年5月8日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

R为基金托管费年费率

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>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 13 日      |                    |      |
|----------------|--------------------------------------------|--------------------|------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |      |
|                | 汇添富长添利定期开放<br>债券 A                         | 汇添富长添利定期开放<br>债券 C | 合计   |
|                |                                            |                    |      |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -                                          | 2.08               | 2.08 |
| 合计             | -                                          | 2.08               | 2.08 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                    |      |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |      |
|                | 汇添富长添利定期开放<br>债券 A                         | 汇添富长添利定期开放<br>债券 C | 合计   |
|                |                                            |                    |      |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -                                          | 6.86               | 6.86 |
| 合计             | -                                          | 6.86               | 6.86 |

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前 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末不存在与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末不存在与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

| 份额单位：份                     |                                |                                |
|----------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 项目                         | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月<br>13日 | 本期<br>2020年1月1日至2020年4<br>月13日 |
|                            | 汇添富长添利定期开放债券A                  | 汇添富长添利定期开放债券C                  |
| 基金合同生效日（2016年12月6日）持有的基金份额 | -                              | -                              |
| 报告期初持有的基金份额                | 283,426.21                     | -                              |
| 报告期间申购/买入总份额               | -                              | -                              |
| 报告期间因拆分变动份额                | -                              | -                              |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额             | -                              | -                              |
| 报告期末持有的基金份额                | 283,426.21                     | -                              |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例    | 0.00%                          | -                              |
| 项目                         | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月   | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6    |



|                                 | 30 日           | 月 30 日         |
|---------------------------------|----------------|----------------|
|                                 | 汇添富长添利定期开放债券 A | 汇添富长添利定期开放债券 C |
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 6 日）持有的基金份额 | —              | —              |
| 报告期初持有的基金份额                     | 224,129.75     | —              |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 9,841.94       | —              |
| 报告期间因拆分变动份额                     | —              | —              |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | —              | —              |
| 报告期末持有的基金份额                     | 233,971.69     | —              |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.00%          | —              |

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 13 日 |           | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |            |
|--------------|---------------------------------------|-----------|--------------------------------------------|------------|
|              | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入     |
| 中国民生银行股份有限公司 | 17,558,053.81                         | 64,384.99 | 4,485,063.98                               | 211,315.88 |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2020 年 4 月 13 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：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 4 月 13 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 4 月 13 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注: 截至本报告期末 2020 年 04 月 13 日止, 本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构, 并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行, 申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外, 在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年4月13日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 1,403,265,316.85  | 1,391,243,027.51    |
| 合计     | 1,403,265,316.85  | 1,391,243,027.51    |

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年4月13日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 4,930,791,365.24  | 7,156,457,762.58    |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 8,560,733,071.47  | 6,242,428,028.94    |
| 合计     | 13,491,524,436.71 | 13,398,885,791.52   |

注：未评级债券为国债、中央银行票据以及政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年4月13<br>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                  | 17,558,053.81 | -                | -                | -                 | -    | -              | 17,558,053.81     |
| 结算备付金                 | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 存出保证金                 | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 交易性金融资产               | -             | -                | -                | 211,500,000.00    | -    | -              | 211,500,000.00    |
| 衍生金融资产                | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 买入返售金融资产              | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应收利息                  | -             | -                | -                | -                 | -    | 344,888,434.96 | 344,888,434.96    |
| 应收股利                  | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应收申购款                 | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应收证券清算款               | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 其他资产                  | 9,977,208.24  | 1,390,930,527.28 | 1,456,153,005.32 | 11,826,229,012.72 | -    | -              | 14,683,289,753.56 |
| 资产总计                  | 27,535,262.05 | 1,390,930,527.28 | 1,456,153,005.32 | 12,037,729,012.72 | -    | 344,888,434.96 | 15,257,236,242.33 |
| 负债                    |               |                  |                  |                   |      |                |                   |
| 应付赎回款                 | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应付管理人报酬               | -             | -                | -                | -                 | -    | 1,624,596.71   | 1,624,596.71      |
| 应付托管费                 | -             | -                | -                | -                 | -    | 541,532.24     | 541,532.24        |
| 应付证券清算款               | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 卖出回购金融资产款             | -             | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应付销售服务                | -             | -                | -                | -                 | -    | 0.26           | 0.26              |

|                     |                  |                  |                  |                   |      |                |                   |
|---------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|------|----------------|-------------------|
| 费                   |                  |                  |                  |                   |      |                |                   |
| 应付交易费用              | -                | -                | -                | -                 | -    | 11,972.48      | 11,972.48         |
| 应付利息                | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应付利润                | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应交税费                | -                | -                | -                | -                 | -    | 168,661.88     | 168,661.88        |
| 其他负债                | -                | -                | -                | -                 | -    | 56,830.80      | 56,830.80         |
| 负债总计                | -                | -                | -                | -                 | -    | 2,403,594.37   | 2,403,594.37      |
| 利率敏感度缺口             | 27,535,262.05    | 1,390,930,527.28 | 1,456,153,005.32 | 12,037,729,012.72 | -    | 342,484,840.59 | 15,254,832,647.96 |
| 上年度末<br>2019年12月31日 | 1个月以内            | 1-3个月            | 3个月-1年           | 1-5年              | 5年以上 | 不计息            | 合计                |
| 资产                  |                  |                  |                  |                   |      |                |                   |
| 银行存款                | 1,970,469.58     | -                | -                | -                 | -    | -              | 1,970,469.58      |
| 结算备付金               | 59,524.86        | -                | -                | -                 | -    | -              | 59,524.86         |
| 存出保证金               | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 交易性金融资产             | 555,335,000.00   | -                | -                | 207,540,000.00    | -    | -              | 762,875,000.00    |
| 买入返售金融资产            | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应收利息                | -                | -                | -                | -                 | -    | 323,042,104.83 | 323,042,104.83    |
| 应收股利                | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应收申购款               | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应收证券清算款             | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 其他资产                | 1,000,691,006.36 | 661,138,313.48   | 2,576,507,054.86 | 9,788,917,444.33  | -    | -              | 14,027,253,819.03 |
| 资产总计                | 1,558,056,000.80 | 661,138,313.48   | 2,576,507,054.86 | 9,996,457,444.33  | -    | 323,042,104.83 | 15,115,200,918.30 |
| 负债                  |                  |                  |                  |                   |      |                |                   |
| 应付赎回款               | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 应付管理人报酬             | -                | -                | -                | -                 | -    | 3,845,091.83   | 3,845,091.83      |
| 应付托管费               | -                | -                | -                | -                 | -    | 1,281,697.24   | 1,281,697.24      |
| 应付证券清算款             | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |
| 卖出回购金融资产款           | -                | -                | -                | -                 | -    | -              | -                 |

|         |                 |                |                  |                  |   |                |                   |
|---------|-----------------|----------------|------------------|------------------|---|----------------|-------------------|
| 应付销售服务费 | -               | -              | -                | -                | - | 0.62           | 0.62              |
| 应付交易费用  | -               | -              | -                | -                | - | 15,775.00      | 15,775.00         |
| 应付利息    | -               | -              | -                | -                | - | -              | -                 |
| 应付利润    | -               | -              | -                | -                | - | -              | -                 |
| 应交税费    | -               | -              | -                | -                | - | 677,902.44     | 677,902.44        |
| 其他负债    | -               | -              | -                | -                | - | 280,000.00     | 280,000.00        |
| 负债总计    | -               | -              | -                | -                | - | 6,100,467.13   | 6,100,467.13      |
| 利率敏感度缺口 | 1,558,056.00.80 | 661,138.313.48 | 2,576,507.054.86 | 9,996,457,444.33 | - | 316,941,637.70 | 15,109,100,451.17 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                                                                                                          |                             |                        |
|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                                                                                                          |                             |                        |
|    | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；                                                                                    |                             |                        |
|    | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                                                                                                   |                             |                        |
|    | 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； |                             |                        |
|    | 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券、可交换债券以及持有至到期投资的债券资产。                                                                                          |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                                                                                                                | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                                                                                                                          | 本期末（2020 年 4 月 13 日）        | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 基准利率减少 25 个基点                                                                                                                            | -1,027,689.47               | 1,232,524.20           |
|    | 基准利率增加 25 个基点                                                                                                                            | 1,035,493.03                | -1,223,175.22          |

|  |    |  |  |
|--|----|--|--|
|  | 基点 |  |  |
|--|----|--|--|

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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 2020 年 4 月 13 日，本基金未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券（于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告（转型后）

### 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  | 基金投资   | —                 | —            |
| 3  | 固定收益投资 | 14,985,609,550.18 | 99.21        |
|    | 其中：债券  | 14,985,609,550.18 | 99.21        |
|    | 资产支持证券 | —                 | —            |



|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| 4 | 贵金属投资             | -                 | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -                 | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | 9,000,000.00      | 0.06   |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 10,831,516.88     | 0.07   |
| 8 | 其他各项资产            | 99,547,035.29     | 0.66   |
| 9 | 合计                | 15,104,988,102.35 | 100.00 |

## 7.2 报告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股票投资。

## 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。

## 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。

## 7.5 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      | 9,936,517,708.77  | 65.85        |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,936,517,708.77  | 65.85        |
| 4  | 企业债券      | 2,239,198,801.11  | 14.84        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | 1,497,820,008.17  | 9.93         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | 1,312,073,032.13  | 8.70         |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 14,985,609,550.18 | 99.31        |

注：1、根据基金合同规定，本基金除具有回售条款的债券，可转换债券外的固定收益类金融工具

以摊余成本进行后续计量；

2、具有回售条款的债券，可转换债券（可交换债）根据公允价值进行后续计量。

3、由于四舍五入的原因各比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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  | 190306  | 19 进出 06       | 61,390,000 | 6,189,510,213.54 | 41.02        |
| 2  | 122723  | 12 石油 05       | 12,300,000 | 1,249,987,498.25 | 8.28         |
| 3  | 170206  | 17 国开 06       | 9,000,000  | 907,084,970.88   | 6.01         |
| 4  | 122150  | 12 石化 02       | 6,158,960  | 629,914,405.18   | 4.17         |
| 5  | 1182326 | 11 中信集<br>MTN3 | 6,000,000  | 607,878,809.39   | 4.03         |

## 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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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 | 9,001,601.51  |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 90,545,433.78 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 99,547,035.29 |

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有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投资。

### § 7 投资组合报告（转型前）

#### 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  | 基金投资              | —                 | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 14,894,789,753.56 | 97.62        |
|    | 其中：债券             | 14,894,789,753.56 | 97.62        |
|    | 资产支持证券            | —                 | —            |
| 4  | 贵金属投资             | —                 | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —                 | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | —                 | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                 | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 17,558,053.81     | 0.12         |
| 8  | 其他各项资产            | 344,888,434.96    | 2.26         |
| 9  | 合计                | 15,257,236,242.33 | 100.00       |

#### 7.2 报告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股票投资。

### 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。

### 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初基金资产净值 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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      | 8,741,098,274.92  | 57.30        |
|    | 其中：政策性金融债 | 8,560,733,071.47  | 56.12        |
| 4  | 企业债券      | 2,248,034,108.17  | 14.74        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | 2,502,392,053.62  | 16.40        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | 1,403,265,316.85  | 9.20         |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 14,894,789,753.56 | 97.64        |

注：1、根据基金合同规定，本基金除具有回售条款的债券，可转换债券外的固定收益类金融工具以摊余成本进行后续计量；

2、具有回售条款的债券，可转换债券（可交换债）根据公允价值进行后续计量。

3、由于四舍五入的原因各比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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  | 190306  | 19 进出 06    | 52,590,000 | 5,297,312,530.04 | 34.73        |
| 2  | 122723  | 12 石油 05    | 12,300,000 | 1,252,425,859.90 | 8.21         |
| 3  | 1382312 | 13 中铁建 MTN1 | 10,000,000 | 1,001,723,665.94 | 6.57         |
| 4  | 170206  | 17 国开 06    | 9,000,000  | 907,898,044.64   | 5.95         |
| 5  | 122150  | 12 石化 02    | 6,158,960  | 631,431,947.82   | 4.14         |

**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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11 市场中性策略执行情况**

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形**

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 344,888,434.96 |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 344,888,434.96 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

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(%) |
| 汇添富长添利定期开放债券A | 513      | 29,247,778.03 | 15,004,065,162.12 | 100.00    | 44,966.75 | 0.00      |
| 汇添富长添利定期开放债券C | 13       | 170.75        | 0.00              | 0.00      | 2,219.72  | 100.00    |
| 合计            | 526      | 28,524,928.42 | 15,004,065,162.12 | 100.00    | 47,186.47 | 0.00      |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目  | 份额级别          | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|-----|---------------|-----------|-------------|
| 基金管 | 汇添富长添利定期开放债券A | 23,849.93 | 0.00        |

|               |                |           |      |
|---------------|----------------|-----------|------|
| 理人所有从业人员持有本基金 | 汇添富长添利定期开放债券 C | 200.00    | 9.01 |
|               | 合计             | 24,049.93 | 0.00 |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别           | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇添富长添利定期开放债券 A | 0~10              |
|                                | 汇添富长添利定期开放债券 C | 0                 |
|                                | 合计             | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 汇添富长添利定期开放债券 A | 0                 |
|                                | 汇添富长添利定期开放债券 C | 0                 |
|                                | 合计             | 0                 |

## § 8 基金份额持有人信息（转型前）

### 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（%） |
| 汇添富长添利定期开放债券 A | 534      | 28,097,571.01 | 15,004,055,426.21 | 100.00    | 47,490.73 | 0.00      |
| 汇              | 13       | 170.75        | 0.00              | 0.00      | 2,219.72  | 100.00    |

|               |     |               |                   |        |           |      |
|---------------|-----|---------------|-------------------|--------|-----------|------|
| 添富长添利定期开放债券 C |     |               |                   |        |           |      |
| 合计            | 547 | 27,429,808.29 | 15,004,055,426.21 | 100.00 | 49,710.45 | 0.00 |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别           | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|----------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 汇添富长添利定期开放债券 A | 25,495.30 | 0.00        |
|                  | 汇添富长添利定期开放债券 C | 200.00    | 9.01        |
|                  | 合计             | 25,695.30 | 0.00        |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别           | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇添富长添利定期开放债券 A | 0~10              |
|                                | 汇添富长添利定期开放债券 C | 0                 |
|                                | 合计             | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 汇添富长添利定期开放债券 A | 0                 |
|                                | 汇添富长添利定期开放债券 C | 0                 |
|                                | 合计             | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

| 项目                           | 汇添富长添利定期开放债券 A    | 汇添富长添利定期开放债券 C |
|------------------------------|-------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2020 年 4 月 14 日) | 15,004,102,916.94 | 2,219.72       |



|                                    |                   |          |
|------------------------------------|-------------------|----------|
| 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份额              | 9,802.39          | —        |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 2,590.46          | —        |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —                 | —        |
| 本报告期末基金份额总额                        | 15,004,110,128.87 | 2,219.72 |

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| 项目                                     | 汇添富长添利定期开放债券 A    | 汇添富长添利定期开放债券 C |
|----------------------------------------|-------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>（2016 年 12 月 6 日）<br>基金份额总额 | 15,003,889,112.05 | 3,800.04       |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 15,004,102,916.94 | 2,219.72       |
| 本报告期基金总申购份额                            | —                 | —              |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | —                 | —              |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）               | —                 | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 15,004,102,916.94 | 2,219.72       |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

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 |    |
| 东方证券股份有限公司 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 |
|------|------|--------|------|
|------|------|--------|------|

|                    | 成交金额 | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额             | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证<br>成交总额的<br>比例 |
|--------------------|------|----------------------|------------------|----------------------------|------|--------------------------|
| 东方证券<br>股份有限<br>公司 | -    | -                    | 2,467,300,000.00 | 100.00%                    | -    | -                        |

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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

### 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|-----|------|-----------|----|
|------|-----|------|-----------|----|

|            | 元数量 | 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 |   |
|------------|-----|------|--------------|----|------------|---|
| 东方证券股份有限公司 | 2   | -    | -            | -  | -          | - |

注:1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计, 不单指股票交易佣金。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称       | 债券交易 |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------------|------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|            | 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 |
| 东方证券股份有限公司 | -    | -            | 4,018,500,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

### 10.8 其他重大事件 (转型后)

| 序号 | 公告事项                                                                   | 法定披露方式                               | 法定披露日期     |
|----|------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|------------|
| 1  | 关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同的公告                                | 证券时报, 公司网站                           | 2020-04-14 |
| 2  | 汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书         | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020-04-14 |
| 3  | 汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告                                          | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020-04-21 |
| 4  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金 (FOF) 资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告          | 中证报, 公司网站                            | 2020-04-29 |
| 5  | 关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金第七次受限开放期开放申购、赎回业务的公告                              | 证券时报, 公司网站                           | 2020-06-04 |
| 6  | 关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金 2020 年 06 月 08 日至 2020 年 06 月 09 日受限开放期申购赎回结果的公告 | 证券时报, 公司网站                           | 2020-06-11 |
| 7  | 汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金收益分配公告                                              | 证券时报, 公司网站                           | 2020-06-17 |

### 10.8 其他重大事件 (转型前)

| 序号 | 公告事项                                    | 法定披露方式                               | 法定披露日期     |
|----|-----------------------------------------|--------------------------------------|------------|
| 1  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告 | 上证报, 公司网站                            | 2020-01-02 |
| 2  | 汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年第 4 季度报告          | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所                  | 2020-01-21 |
| 3  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回 等业务的公告       | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020-01-31 |

|   |                               |                                      |            |
|---|-------------------------------|--------------------------------------|------------|
| 4 | 汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年年度报告    | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报 | 2020-03-30 |
| 5 | 汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告 | 中证报, 上交所, 公司网站, 深交所                  | 2020-04-01 |

## § 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              | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 15,003,772,000.00 | 0.00 | 0.00 | 15,003,772,000.00 | 100.00   |
| 个人                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | -              | -                               | -                 | -    | -    | -                 | -        |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                |                                 |                   |      |      |                   |          |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险</p> <p>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险</p> <p>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。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险</p> <p>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。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险</p> <p>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。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，很可能出现自由开放期最后一日本基金的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或减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于 2 亿元的情形，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。</p> |                |                                 |                   |      |      |                   |          |

### 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、中国证监会准予汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金注册募集的文件；
- 2、《汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集注册汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金之法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2020 年 8 月 28 日