

# 汇添富双利增强债券型证券投资基金 2022 年 第 2 季度报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 07 月 21 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|               |                                                                                                                                                           |
|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称          | 汇添富双利增强债券                                                                                                                                                 |
| 基金主代码         | 000406                                                                                                                                                    |
| 基金运作方式        | 契约型开放式                                                                                                                                                    |
| 基金合同生效日       | 2013 年 12 月 03 日                                                                                                                                          |
| 报告期末基金份额总额(份) | 160,905,776.75                                                                                                                                            |
| 投资目标          | 本基金主要投资于债券资产，通过精选信用债券，并适度参与权益类品种投资，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上，力争实现资产的长期稳定增值。                                                                                     |
| 投资策略          | 本基金将主要投资于债券资产，同时密切关注一、二级股票市场的运行状况与风险收益特征，把握相对确定性的投资机会，从而在严格控制基金资产运作风险的基础上，力争实现组合的稳健增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、信用策略、利率策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股票投资策略、权证投资策略。 |

|                    |                                                                         |               |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------|---------------|
| 业绩比较基准             | 银行三年期存款利率(税后)+1.5%                                                      |               |
| 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。 |               |
| 基金管理人              | 汇添富基金管理股份有限公司                                                           |               |
| 基金托管人              | 上海浦东发展银行股份有限公司                                                          |               |
| 下属分级基金的基金简称        | 汇添富双利增强债券 A                                                             | 汇添富双利增强债券 C   |
| 下属分级基金的交易代码        | 000406                                                                  | 000407        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 120,234,375.31                                                          | 40,671,401.44 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2022 年 04 月 01 日 - 2022 年 06 月 30 日) |               |
|-----------------|------------------------------------------|---------------|
|                 | 汇添富双利增强债券 A                              | 汇添富双利增强债券 C   |
| 1. 本期已实现收益      | 615,440.89                               | 151,691.31    |
| 2. 本期利润         | 2,645,602.86                             | 948,704.96    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0306                                   | 0.0227        |
| 4. 期末基金资产净值     | 142,954,146.52                           | 47,864,971.05 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.189                                    | 1.177         |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富双利增强债券 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       | 2.15%    | 0.17%       | 1.06%      | 0.01%         | 1.09%  | 0.16% |
| 过去六个月       | 0.34%    | 0.19%       | 2.11%      | 0.01%         | -1.77% | 0.18% |
| 过去一年        | -4.42%   | 0.28%       | 4.25%      | 0.01%         | -8.67% | 0.27% |
| 过去三年        | 11.23%   | 0.33%       | 12.75%     | 0.01%         | -1.52% | 0.32% |
| 过去五年        | 23.76%   | 0.32%       | 21.25%     | 0.01%         | 2.51%  | 0.31% |
| 自基金合同生效日起至今 | 59.29%   | 0.31%       | 38.65%     | 0.01%         | 20.64% | 0.30% |
| 汇添富双利增强债券 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       | 1.99%    | 0.17%       | 1.06%      | 0.01%         | 0.93%  | 0.16% |
| 过去六个月       | 0.17%    | 0.18%       | 2.11%      | 0.01%         | -1.94% | 0.17% |
| 过去一年        | -4.77%   | 0.27%       | 4.25%      | 0.01%         | -9.02% | 0.26% |
| 过去三年        | 10.00%   | 0.32%       | 12.75%     | 0.01%         | -2.75% | 0.31% |
| 过去五年        | 21.55%   | 0.31%       | 21.25%     | 0.01%         | 0.30%  | 0.30% |
| 自基金合同生效日起至今 | 57.40%   | 0.31%       | 38.65%     | 0.01%         | 18.75% | 0.30% |

### 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

汇添富双利增强债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富双利增强债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 12 月 03 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务           | 任本基金的基金经理期限         |      | 证券从业年限<br>(年) | 说明                                                                         |
|----|--------------|---------------------|------|---------------|----------------------------------------------------------------------------|
|    |              | 任职日期                | 离任日期 |               |                                                                            |
| 徐光 | 本基金的<br>基金经理 | 2020 年 07 月<br>08 日 |      | 10            | 国籍：中国。学历：美国伊利诺伊理工学院金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2012 年 12 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>任债券交易员、高级债券交易员。</p> <p>2018 年 8 月 21 日至今任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 8 月 21 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 9 月 28 日至今任汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 9 月 28 日至 2020 年 9 月 1 日任汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 24 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富丰润中短债债券</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |          |                  |  |    |                                                                                                                                                                                                                                                           |
|----|----------|------------------|--|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |          |                  |  |    | <p>型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月 22 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 15 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 30 日至 2022 年 1 月 7 日任汇添富鑫福债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月 9 日至今任汇添富中短债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 8 日至今任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 李超 | 本基金的基金经理 | 2022 年 05 月 25 日 |  | 10 | <p>国籍：中国。学历：清华大学工学学士，斯坦福大学管理系以及材料系双硕士。从业资格：证券投</p>                                                                                                                                                                                                        |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>资基金从业<br/>资格。从业<br/>经历：2013<br/>年至 2019 年<br/>历任创金合<br/>信基金研究<br/>员，安邦资<br/>产管理有限<br/>责任公司研<br/>究员、投资<br/>经理助理、<br/>投资经理，<br/>国金基金管<br/>理有限公司<br/>基金经理<br/>（拟任）<br/>等，2019 年<br/>7 月至 2021<br/>年 7 月任大<br/>家资产管理<br/>有限责任公<br/>司高级投资<br/>经理。2021<br/>年 7 月至<br/>2022 年 3 月<br/>任汇添富基<br/>金管理有限<br/>公司专户投<br/>资经理。<br/>2022 年 3 月<br/>7 日至今任汇<br/>添富稳健添<br/>益一年持有<br/>期混合型证<br/>券投资基金<br/>的基金经<br/>理。2022 年<br/>3 月 7 日至今<br/>任汇添富稳<br/>健添盈一年<br/>持有期混合<br/>型证券投资<br/>基金的基金<br/>经理。2022<br/>年 5 月 25 日<br/>至今任汇添</p> |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                  |
|--|--|--|--|--|----------------------------------|
|  |  |  |  |  | 富双利增强<br>债券型证券<br>投资基金的<br>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。

#### 4.1.1 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

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人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，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 11 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

上海疫情的持续时间和波及范围都大幅超过了市场的预期。固定资产和地产投资全面下滑，供应链受损影响工业生产，消费也继续走弱。上海疫情缓解之后，供应链快速修复，赶工需求下出口改善明显，但服务业和消费的需求修复仍然需要时间。信贷总量较强但结构不佳，企业和居民中长期贷款需求较弱。政府债券加速发行对社融构成一定的支撑，但 M2-社融剪刀差继续走阔，反映资金淤积在银行间市场的现象仍在继续。

资金面宽松，短端资金价格大幅下行。Shibor 3M 下行至 2% 附近；3 年 AAA 企业债下行 20bp 到 2.9% 附近；10 年国开债在 3% 附近震荡。期限利差有所扩大，疫情修复和稳增长的预期有待进一步验证。

本基金债券部分以优质 AAA 配置为主。

权益方面，报告期内，市场出现较大程度的波动，既因为受到国内疫情影响与海外通胀压力等影响，在 4 月中经历了较大的调整，又因为国内复工复产恢复等因素显著提振了市场信心，市场在 4 月底以来反弹较多。

总体操作看，本基金自一季度末以来持续的逢低增加了股票仓位，尤其是在 4 月市场出现持续性下跌时，基于对估值合理、长期有竞争力的优质公司的中长期认可，以及对宏观政策的对冲力度将加大的判断，持续进行了较大幅度的加仓，并期间在结构上主动加大了对成长能力较强的优质公司的仓位暴露，因为我们坚信，疫情终将过去，而长期看，筛选出好企业，以合理的估值买入或持有，并赚取公司成长带来的回报，才能创造长期可持续的收益率。同时，出于绝对收益的考虑，阶段性的对部分上涨较大、估值偏贵的股票进行了适度的止盈操作。

本基金目前整体的股票仓位，相比本产品的股票资产的上限，仍然有一定空间，因为目前宏观变量短期看仍然存在一定的不确定性，需要更明朗的数据或信号，或者有更具吸引力的估值来给予风险补偿。

在板块配置与个股选择上，我们中长期看好中国先进制造业，通过拥有完整的产业链积累、工程师红利、优秀的管理层、狼性的机制与文化等，一大批优秀的制造业企业在全中国具备越来越强的竞争力。其次，我们也看好部分具有较高成长性 or 较强品牌力的公司，如医药、消费龙头公司等。同时，国内稳增长政策将持续发力，我们也看好随之带来的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富双利增强债券 A 类份额净值增长率为 2.15%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%。本报告期汇添富双利增强债券 C 类份额净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 28,549,680.94  | 11.39        |
|    | 其中：股票             | 28,549,680.94  | 11.39        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 199,158,261.37 | 79.48        |
|    | 其中：债券             | 199,158,261.37 | 79.48        |
|    | 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      | 22,519,130.56  | 8.99         |
| 8  | 其他资产              | 346,401.76     | 0.14         |
| 9  | 合计                | 250,573,474.63 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 594,300.60    | 0.31         |
| B  | 采矿业              | 335,880.00    | 0.18         |
| C  | 制造业              | 14,963,223.34 | 7.84         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 725,968.00    | 0.38         |
| E  | 建筑业              | 1,962,661.00  | 1.03         |
| F  | 批发和零售业           | 121,551.00    | 0.06         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,322,644.00  | 0.69         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 573,654.00    | 0.30         |
| J  | 金融业              | 5,633,145.00  | 2.95         |
| K  | 房地产业             | 1,191,306.00  | 0.62         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 559,032.00    | 0.29         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 93,591.00     | 0.05         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —             | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —            |
| P  | 教育               | —             | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 472,725.00    | 0.25         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —             | —            |
| S  | 综合               | —             | —            |
|    | 合计               | 28,549,680.94 | 14.96        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 1,000   | 2,045,000.00 | 1.07         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 3,200   | 1,708,800.00 | 0.90         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 35,100  | 1,481,220.00 | 0.78         |
| 4  | 002541 | 鸿路钢构 | 37,550  | 1,254,170.00 | 0.66         |
| 5  | 601390 | 中国中铁 | 197,500 | 1,212,650.00 | 0.64         |
| 6  | 600048 | 保利发展 | 63,500  | 1,108,710.00 | 0.58         |
| 7  | 002142 | 宁波银行 | 30,500  | 1,092,205.00 | 0.57         |
| 8  | 002179 | 中航光电 | 15,740  | 996,656.80   | 0.52         |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 48,200  | 959,180.00   | 0.50         |
| 10 | 300122 | 智飞生物 | 7,100   | 788,171.00   | 0.41         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | 10,164,621.92 | 5.33         |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 2  | 央行票据      | -              | -      |
| 3  | 金融债券      | 10,408,268.49  | 5.45   |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -      |
| 4  | 企业债券      | 102,347,539.74 | 53.64  |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -      |
| 6  | 中期票据      | 76,237,831.22  | 39.95  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -      |
| 8  | 同业存单      | -              | -      |
| 9  | 地方政府债     | -              | -      |
| 10 | 其他        | -              | -      |
| 11 | 合计        | 199,158,261.37 | 104.37 |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 1480527   | 14 京保障房债      | 100,000 | 10,533,500.82 | 5.52         |
| 2  | 1922034   | 19 建信金融债 02   | 100,000 | 10,408,268.49 | 5.45         |
| 3  | 1480229   | 14 首发债        | 100,000 | 10,341,915.07 | 5.42         |
| 4  | 102101769 | 21 国电 MTN004  | 100,000 | 10,319,870.68 | 5.41         |
| 5  | 102101794 | 21 中车集 MTN001 | 100,000 | 10,312,876.16 | 5.40         |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 45,613.94  |
| 2  | 应收证券清算款 | 266,915.30 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 33,872.52  |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 9 | 合计 | 346,401.76 |
|---|----|------------|

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目            | 汇添富双利增强债券 A    | 汇添富双利增强债券 C   |
|---------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 78,518,557.87  | 42,657,393.70 |
| 本报告期基金总申购份额   | 54,679,333.19  | 1,279,933.76  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 12,963,515.75  | 3,265,926.02  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | —              | —             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 120,234,375.31 | 40,671,401.44 |

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。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富双利增强债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富双利增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富双利增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富双利增强债券型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 9.3 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

2022 年 07 月 21 日