

汇添富稳健回报债券型证券投资基金 2026 年 第 2 季度报告

2026 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：恒丰银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 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 2026 年 04 月 01 日起至 2026 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	汇添富稳健回报债券
基金主代码	018830
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 09 月 01 日
报告期末基金份额总额(份)	237,406,643.72
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取目标波动风险预算技术进行资产配置，量化与基本面相结合的股票投资策略进行权益部分投资，以及采用多种策略进行固定收益部分投资。通过综合运用以上技术，本基金将优化投资过程，力争将组合整体预期波动率限定在合适范围，实现风险约束下投资组合预期收益的最大化，从而实现较好的稳健回报。从长期来看，目标波动风险预算技术在风险控制方面效果显著，能够提高风险调整后收益。本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、多因子量化选股策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、可转债及可交换债投资策略及国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债-1-3 年政策性金融债财富(总值)指数*80%+中证 800 指数收益

	率*15%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%		
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	恒丰银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富稳健回报债券 A	汇添富稳健回报债券 C	汇添富稳健回报债券 D
下属分级基金的交易代码	018830	018831	025463
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	171,871,072.32	10,752,822.99	54,782,748.41

§ 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(2026 年 04 月 01 日 – 2026 年 06 月 30 日)		
	汇添富稳健回报债券 A	汇添富稳健回报债券 C	汇添富稳健回报债券 D
1.本期已实现收益	226,733.57	-17,974.73	50,498.03
2.本期利润	754,327.44	124,900.62	246,896.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0080	0.0039
4.期末基金资产净值	189,294,755.61	11,710,170.35	60,346,478.67
5.期末基金份额净值	1.1014	1.0890	1.1016

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

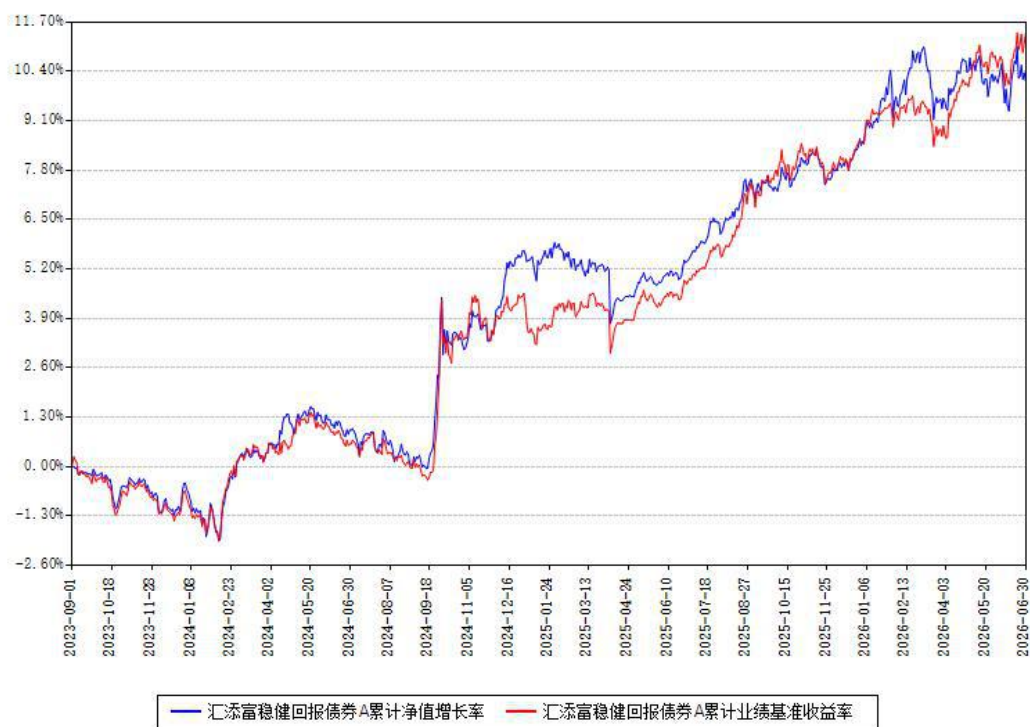
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富稳健回报债券 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①－③	②－④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个 月	0.66%	0.25%	2.48%	0.20%	-1.82%	0.05%
过去六个 月	1.51%	0.25%	2.65%	0.19%	-1.14%	0.06%
过去一年	4.46%	0.19%	6.20%	0.16%	-1.74%	0.03%
自基金合 同生效起 至今	10.14%	0.19%	11.39%	0.18%	-1.25%	0.01%
汇添富稳健回报债券 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	0.55%	0.25%	2.48%	0.20%	-1.93%	0.05%
过去六个 月	1.31%	0.25%	2.65%	0.19%	-1.34%	0.06%
过去一年	4.04%	0.19%	6.20%	0.16%	-2.16%	0.03%
自基金合 同生效起 至今	8.90%	0.19%	11.39%	0.18%	-2.49%	0.01%
汇添富稳健回报债券 D						
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	0.66%	0.25%	2.48%	0.20%	-1.82%	0.05%
过去六个 月	1.52%	0.25%	2.65%	0.19%	-1.13%	0.06%
自基金合 同生效起 至今	2.51%	0.21%	3.65%	0.17%	-1.14%	0.04%

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

汇添富稳健回报债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富稳健回报债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富稳健回报债券D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（2023 年 09 月 01 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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2025 年 09 月 12 日新增 D 类份额。

§ 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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2023 年 09 月 01 日	—	20	国籍：中国。 学历：中国科学技术大学管理学博士。 从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研

					究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理, 现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资
--	--	--	--	--	---

					基金的基金 经理。2013 年 8 月 23 日 至 2015 年 11 月 2 日任中 证能源交易 型开放式指 数证券投资 基金的基金 经理。2013 年 8 月 23 日 至 2015 年 11 月 2 日任中 证医药卫生 交易型开放 式指数证券 投资基金的 基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日 任中证主要 消费交易型 开放式指数 证券投资基金 的基金经 理。2013 年 11 月 6 日至 今任汇添富 沪深 300 安 中动态策略 指数型证券 投资基金的 基金经理。 2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日 任汇添富成 长多因子量 化策略股票 型证券投资 基金的基金 经理。2015 年 3 月 24 日 至 2022 年 6 月 13 日任汇
--	--	--	--	--	---

					添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至 2025 年 10 月 30 日任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经
--	--	--	--	--	--

					理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证
--	--	--	--	--	--

					券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至 2025 年 11 月 10 日任汇添富量化选股混合型证券
--	--	--	--	--	---

					投资基金的基金经理。 2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。 2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。 2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2024 年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任汇添富中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理。 2024 年 12 月 12 日至 2026 年 5 月 26 日任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
--	--	--	--	--	--

					的基金经理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 31 日至 2026 年 5 月 26 日任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2026 年 3 月 31 日至今任汇添富中证港股通综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月 26 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 5 月 26 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
邵蕴奇	本基金的基金经理	2025 年 11 月 26 日	-	9	国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证

					券投资基金从业资格。从业经历：2017 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司行业分析师、高级行业分析师。2023 年 8 月 7 日至 2026 年 4 月 10 日任汇添富上证 50 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 26 日至今任汇添富行业整合主题混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月 26 日至今任汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月 15 日至今任汇添富优选价值混合型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月 29 日至今任汇添富弘悦回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月
--	--	--	--	--	--

					10 日至今任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 5 日至今任汇添富港股通红利回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月 26 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月 28 日至今任汇添富港股通周期精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注: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。

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。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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,力争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，保障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，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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% 的次数为 1。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。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年第二季度，全球地缘政治形势复杂，但中国经济受到出口强劲增长和科技产业

快速发展的支撑，仍然维持了较强的韧性。二季度以来，中东局势逐步缓和，原油价格高位回落，但仍然存在反复风险。中国由于有着较大规模的原油战略库存、多元化的原油采购来源，以及有着新能源、煤化工等能源替代的优势行业，受到的影响相对较小。本次中东冲突后，中国的地缘环境、经济韧性和产业优势将进一步凸显。另一方面，全球 AI 产业发展如火如荼，中国在 AI 产业发展上具有诸多优势，例如完整的上下游供应链、充足稳定的电力供应、强大的软件工程化能力等，因此我们认为未来随着 AI 产业的进一步发展，中国经济高质量发展的动能将更加持续。

本基金定位为股债混合类基金，根据对宏观环境的判断，进行股债大类资产配置比例的调整，以及股债内部结构的调整，希望在较低波动率与回撤的基础上，实现长期稳健的复合收益。

2026 年第二季度，权益市场整体呈现震荡中上行的特征。4 月以来，随着美伊冲突逐步缓和，市场风险偏好回升，加之中国经济的韧性较强，股市呈现出指数震荡上行、结构性机会显著的特征。我们认为，中国股市的中长期投资价值仍然突出。一方面，中国的制造业全球竞争优势进一步加强，尤其是 AI 带动的科技产业高速发展，一批优质公司具备全球竞争力和显著的投资价值；另一方面，中国的利率水平较低，权益类资产的吸引力整体上升，尤其是对于低估值高股息资产，一批优质上市公司的分红、回购意愿持续提升。

对于本基金的股票类资产，我们当前主要配置于以下几个方向。一是高股息红利类资产，在当前国债收益率中枢较低的背景下，我们认为股票市场上的高股息资产具有较高性价比。二是稳定消费类资产，消费类资产普遍具有健康的资产负债表、良好的自由现金流，分红及回购创造的股东回报较好，在消费刺激政策逐步发力的背景下，行业景气度也有望逐步改善。三是出海方向，中国一批优质企业持续走出去，相比于海外企业竞争力较强，市场份额持续提升，带来新的盈利增长点。四是科技创新类资产，中国的 AI 科技产业高速发展，出海和国产替代的趋势明确，其中一些核心公司具备长期投资价值。五是逆向类投资，我们寻找一些行业景气度与股价均处于底部、下行风险较小的周期类资产，进行逆向布局，希望在行业及公司景气反转后实现较好的投资回报。

2026 年二季度，从大类资产表现看，股市内部分化加大，商品和原油价格震荡下行，国内债券市场延续偏强走势，债基收益普遍较好。报告期内，资金面维持宽松充裕，为全市场债券估值提供了良好支撑。各期限、各评级的债券收益率普遍小幅下行，中低评级的信用利差维持在历史较低水平，超长国债的期限利差维持在历史较高水平。从机构行为看，市场

在中短端的需求仍然较为拥挤，对超长端的分歧依然较大。6 月末，央行推出隔夜逆回购操作，旨在进一步完善短端流动性调控框架，引发市场高度关注，预计后续的货币政策调控将更加精细。总体来看，二季度债市在流动性托底下稳步运行，估值空间进一步压缩。

本报告期内，本基金债券部分配置以 AAA 高等级信用债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富稳健回报债券 A 类份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.48%。本报告期汇添富稳健回报债券 C 类份额净值增长率为 0.55%，同期业绩比较基准收益率为 2.48%。本报告期汇添富稳健回报债券 D 类份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.48%。

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	47,704,701.51	16.37
	其中：股票	47,704,701.51	16.37
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	238,855,099.36	81.94
	其中：债券	238,855,099.36	81.94
	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	4,521,405.94	1.55
8	其他资产	411,986.31	0.14

9	合计	291,493,193.12	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	—	—
B	采矿业	5,674,491.00	2.17
C	制造业	27,826,429.00	10.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,265,381.00	0.48
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	2,471,830.00	0.95
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	8,135,943.51	3.11
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	2,330,627.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	47,704,701.51	18.25

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	002484	江海股份	27,200	2,856,000.00	1.09
2	300750	宁德时代	6,700	2,633,167.00	1.01
3	000333	美的集团	32,900	2,484,937.00	0.95
4	600153	建发股份	293,900	2,330,627.00	0.89
5	601857	中国石油	259,900	2,255,932.00	0.86
6	601899	紫金矿业	89,400	2,247,516.00	0.86
7	000657	中钨高新	16,600	1,588,952.00	0.61
8	600141	兴发集团	33,700	1,582,889.00	0.61
9	600030	中信证券	53,987	1,551,046.51	0.59
10	600919	江苏银行	134,000	1,444,520.00	0.55

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	51,478,542.61	19.70
2	央行票据	—	—
3	金融债券	156,953,499.21	60.05
	其中：政策性金融债	105,862,638.38	40.51
4	企业债券	30,423,057.54	11.64
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
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	238,855,099.36	91.39

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	220215	22 国开 15	200,000	22,100,427.40	8.46
2	220210	22 国开 10	200,000	21,624,301.37	8.27
3	232580026	25 建行二级 资本债 02A(BC)	200,000	20,499,990.14	7.84
4	243291	25GTHT04	200,000	20,340,027.40	7.78
5	019827	26 国债 01	150,000	15,097,228.77	5.78

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,国家开发银行、中国建设银行股份有限公司、中国农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约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	98,444.19
2	应收证券清算款	313,326.15
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	215.97
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	411,986.31

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	汇添富稳健回报债券 A	汇添富稳健回报债券 C	汇添富稳健回报债券 D
本报告期期初基金份额总额	136,419,918.72	16,734,849.74	63,418,182.49
本报告期基金总申购份额	47,187,046.44	904,308.38	31,693,964.71
减：本报告期基金总赎回份额	11,735,892.84	6,886,335.13	40,329,398.79
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	171,871,072.32	10,752,822.99	54,782,748.41

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

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	2026 年 4 月 1 日至	80,561,889.99	—	—	80,561,889.99	33.93

		2026 年 6 月 30 日					
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 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。 2、巨额赎回的风险 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。 3、基金规模较小导致的风险 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。 4、基金净值大幅波动的风险 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。 5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。							

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稳健回报债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳健回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳健回报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、报告期内汇添富稳健回报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 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

2026 年 07 月 21 日