汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金 2026 年中期报告

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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
§4 管理人报告.....9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....20
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.....21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....22
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....23
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....23
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.....23
§5 托管人报告.....23
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....23
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23
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....24
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....24
6.1 资产负债表.....24
6.2 利润表.....25
6.3 净资产变动表.....26
6.4 报表附注.....28
§7 投资组合报告.....52
7.1 期末基金资产组合情况.....52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....52
7.3 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.....52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....52
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.....53
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.....53
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.....53

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.....53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....53
7.12 投资组合报告附注.....54
§8 基金份额持有人信息.....55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....55
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.....55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....55
§9 开放式基金份额变动.....56
§10 重大事件揭示.....56
10.1 基金份额持有人大会决议.....56
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.....56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....56
10.4 基金投资策略的改变.....56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....57
10.8 其他重大事件.....59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....60
11.1 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.....60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....60
§12 备查文件目录.....61
12.1 备查文件目录.....61
12.2 存放地点.....61
12.3 查阅方式.....61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富鑫永定开债	
基金主代码	005590	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 01 月 25 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（份）	3,420,646,225.43	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富鑫永定开债 A	汇添富鑫永定开债 C
下属分级基金的交易代码	005590	005591
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	3,420,646,225.43	-

注：汇添富鑫永定开债 C 类份额本报告期无份额余额。本报告中《主要财务指标和基金净值表现》、《半年度财务会计报告（未经审计）》、《基金份额持有人信息》、《开放式基金份额变动》等章节中均无汇添富鑫永定开债 C 类份额的相关数据。

2.2 基金产品说明

投资目标	在科学严格管理风险的前提下，本基金力争创造超越业绩比较基准的较高收益。
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。本基金封闭期的投资策略主要包括：类属资产配置策略、利率策略、信用策略、期限结构配置策略、个券选择策略、可转换债券和可交换公司债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。开放运作期内，为满足投资者申赎需求，本基金将保持较高的组合流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
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	林盛
	联系电话	021-28932888	010-58560666
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95568
传真		021-28932998	010-57093382
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200010	100031
法定代表人		鲁伟铭	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告置备地点	上海市黄浦区外马路 728 号　汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

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	上海市黄浦区外马路 728 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)	
	汇添富鑫永定开债 A	汇添富鑫永定开债 C
本期已实现收益	32,330,251.91	-
本期利润	51,531,910.04	-
加权平均基金份额本期利润	0.0144	-
本期加权平均净值利润率	1.37%	-
本期基金份额净值增长率	1.38%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	130,990,524.59	-

期末可供分配基金份额利润	0.0383	-
期末基金资产净值	3,612,542,558.02	-
期末基金份额净值	1.0561	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	34.93%	2.08%

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(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

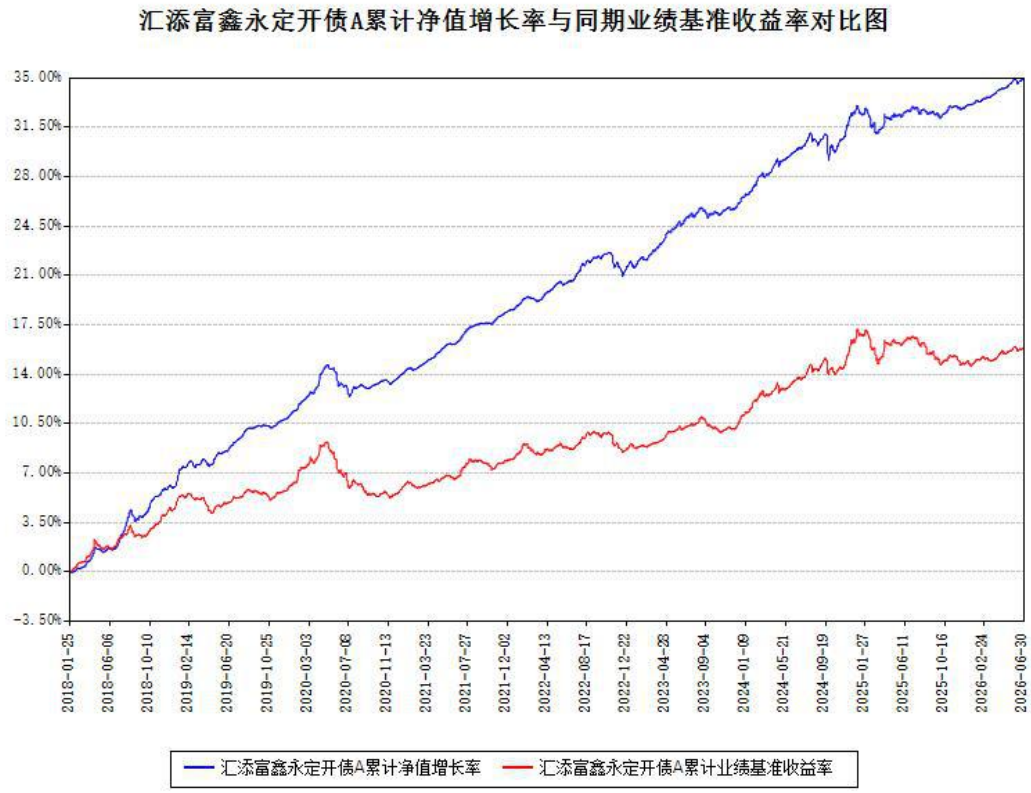
3.2 基金净值表现

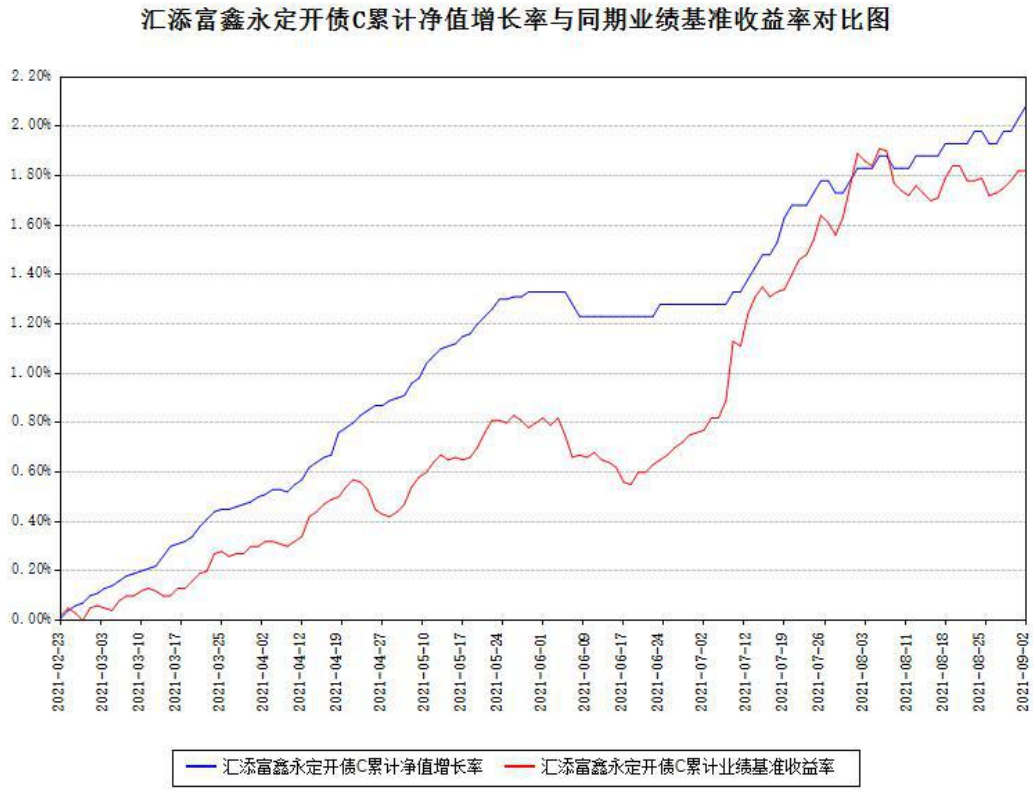
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富鑫永定开债 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.75%	0.03%	0.62%	0.04%	0.13%	-0.01%
过去六个月	1.38%	0.02%	0.91%	0.04%	0.47%	-0.02%
过去一年	1.70%	0.04%	-0.56%	0.06%	2.26%	-0.02%
过去三年	8.02%	0.07%	5.12%	0.08%	2.90%	-0.01%
过去五年	15.97%	0.06%	8.48%	0.07%	7.49%	-0.01%
过去七年	23.80%	0.06%	10.29%	0.07%	13.51%	-0.01%
自基金合同生效起至今	34.93%	0.06%	15.84%	0.07%	19.09%	-0.01%
汇添富鑫永定开债 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自	0.79%	0.03%	1.06%	0.06%	-0.27%	-0.03%

2021-07-01 至 2021-09-02						
自 2021-04-01 至 2021-09-02	1.59%	0.03%	1.52%	0.05%	0.07%	-0.02%
自 2021-02-22 至 2021-09-02	2.08%	0.02%	1.82%	0.04%	0.26%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018 年 01 月 25 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 C 类份额存续期内存在份额为空的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司、汇添富基金销售（上海）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、QFII 基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富基金自成立以来，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。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2026 上半年，汇添富基金新成立 30 只公开募集证券投资基金。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 421 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
彭伟男	本基金的基金经理	2024 年 11 月 15 日	-	9	国籍：中国。学历：上海交通大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2017 年 8 月至 2022 年 7 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益分析师、固定收益高级分析师。2022 年 8 月 8 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富鑫弘定期开放债券型发起式证券投资基金的基

					金经理助理。2022 年 8 月 11 日至今任汇添富丰润中短债债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 11 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富盛安 39 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 11 日至 2024 年 11 月 6 日任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 11 日至 2024 年 3 月 27 日任汇添富鑫和纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 11 日至 2024 年 5 月 28 日任汇添富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 11 日至今任汇添富中

					债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 11 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2022 年 9 月 15 日至 2024 年 11 月 6 日任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 9 月 15 日至今任汇添富精选美元债债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 11 月 22 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 12 月 9 日至 2024 年 11 月 6 日任汇添富鑫悦纯债债券型证券投资基金

					的基金经理助理。2023 年 3 月 10 日至今任汇添富盛和 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 3 月 10 日至今任汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 3 月 10 日至今任汇添富鑫汇债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 3 月 10 日至今任汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 3 月 10 日至今任汇添富稳安三个月持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 3 月 10 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金

					的基金经理助理。2023年6月5日至2024年11月6日任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的基金经理助理。2023年8月9日至2024年11月15日任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2023年8月9日至2024年6月26日任汇添富鑫荣纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。2023年8月9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助理。2024年8月2日至2024年11月6日任汇添富鑫弘定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2024年8月2日至

					2024 年 11 月 6 日任汇添富中债-市场隐含评级 AA+及以上信用债（1-3 年）指数发起式证券投资基金的基金经理助理。2024 年 8 月 2 日至 2024 年 11 月 6 日任汇添富中债优选投资级信用债指数发起式证券投资基金的基金经理助理。2024 年 11 月 15 日至今任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月 15 日至今任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月 15 日至今任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 21 日至今任汇添富彭博中国

					政策性银行债券 1-3 年指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 21 日至今任汇添富中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 21 日至今任汇添富丰和纯债债券型证券投资基金的基金经理。
刘宁	本基金的基金经理助理，纯债部总经理助理	2026 年 02 月 10 日	-	22	国籍：中国。学历：经济学学士，经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2004 年 5 月至 2023 年 6 月就职于嘉实基金管理有限公司，历任债券交易员、投资经理助理、投资经理、基金经理。2023 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任纯债部总经理助理。2025 年 9 月 16 日至 2026 年 1 月

					29 日任汇添富稳宏 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 2 月 10 日至今任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2023 年 12 月 26 日至今任汇添富鑫和纯债债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 26 日至今任汇添富短债债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月 9 日至今任汇添富稳合 4 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月 11 日至今任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 11 日至今任汇添富盛安 39 个月定期开放债券型

					证券投资基金的基金经理。2026 年 1 月 29 日至今任汇添富稳宏 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月 16 日至今任汇添富添添乐双益债券型证券投资基金的基金经理。
李兴元	本基金的基金经理助理	2026 年 03 月 18 日	-	10	国籍：中国。学历：中央财经大学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：之前曾在信达证券固定收益部（自营）、大和证券固定收益部（自营）、博时基金工作。2026 年 2 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2026 年 3 月 13 日至今任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 3 月 13 日至今任汇添富鑫和纯债债券型

					证券投资基金的基金经理助理。2026 年 3 月 13 日至今任汇添富稳宏 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 3 月 13 日至今任汇添富短债债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 3 月 13 日至今任汇添富稳合 4 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 3 月 13 日至今任汇添富盛安 39 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 3 月 18 日至今任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2026 年 5 月 20 日至今任汇添富鑫悦纯债债券型证券投资基

					金的基金经理助理。2026年6月8日至今任汇添富稳安三个月持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。2026年6月8日至今任汇添富鑫润纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。

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。

4.1.3 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

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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 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：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,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。

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中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

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。

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%的情况有 1 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。

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 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

2026 年上半年，全球政治经济不确定性仍然较高，全球地缘政治博弈持续深化。国际大宗商品价格波动加剧。全球贸易格局在产业升级与地缘因素交织下呈现分化态势，外部环境的不确定性仍存。国内经济运行总体处于合理区间，但外需强于内需、生产强于需求的结构特征较为突出。

基本面方面，上半年 GDP 同比增长 4.7%，一季度、二季度分别增长 5.0%和 4.3%。规

模以上工业增加值同比增长 5.4%，新动能保持较快增长；出口累计同比增长 17.6%，延续较强韧性。内需修复相对偏慢，社会消费品零售总额同比增长 1.3%，固定资产投资同比下降 5.7%，房地产开发投资同比下降 18.0%。物价方面，上半年 CPI 同比上涨 1.0%，PPI 由降转涨、同比上涨 1.5%，6 月 PPI 同比升至 4.1%，能源及原材料价格上涨对生产端形成一定传导。融资方面，6 月末 M2 和社会融资规模存量同比分别增长 8.0%和 7.4%，上半年社会融资规模增量 20.84 万亿元。实体融资需求总体偏弱，政府债券和企业债券融资形成支撑。

政策方面，宏观政策坚持稳中求进、提质增效，继续实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。财政赤字率按 4%左右安排，超长期特别国债和地方政府专项债保持较大规模，重点支持“两重”、“两新”、扩大内需及化解地方债务风险。货币政策保持流动性充裕，政策利率和 LPR 总体稳定，通过买断式逆回购、MLF、国债买卖等方式加强总量和结构调节。

债券市场方面，上半年收益率整体震荡下行，主要影响因素包括资金面宽松、信贷需求偏弱和内需不足。以代表品种为例，10 年国债收益率期末较期初下行 10BP，10 年国开债收益率下行 21BP，30 年国债收益率下行 2BP；短端品种中，1 年 AAA 级同业存单收益率下行 15BP。信用债方面，3 年 AAA 级中短期票据收益率下行 24BP。

本报告期内，本基金以金融债、企业债和利率债配置为主，并根据市场变化灵活调整组合久期、杠杆和券种结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富鑫永定开债 A 类份额净值增长率为 1.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。本报告期汇添富鑫永定开债 C 类份额为 0。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年，经济预计保持平稳运行，全年有望处于既定增长目标区间。外需方面，在高新技术产业竞争力的支撑下，出口有望继续保持韧性。内需修复仍需财政支出加快、重大项目落地和消费政策持续支持。政策方面，预计货币政策维持适度宽松基调，根据经济运行情况灵活施策。财政政策将加快支出节奏，扩大有效投资，着力提振内需，持续推进债务风险化解，为经济高质量发展提供坚实支撑。对债券市场而言，偏弱的内需和充裕的流动性仍构成支撑，但当前收益率处于低位，政府债供给节奏、通胀预期变化等因素可能加大市场波动。策略方面，本基金将紧密跟踪基本面、政策和资金面变化，灵活调整组合久期和杠杆，持续优化利率债与信用债的配置结构，精选高资质信用品种严控信用风险，择机参与利率债

波段交易。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，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。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，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约定进行。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“关联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”和“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,378,069.29	30,679,844.98
结算备付金		5,052,254.67	1,063.79
存出保证金		5,231.30	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,572,853,022.10	5,522,705,431.72
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,572,853,022.10	5,522,705,431.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		19,978,206.45	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,608,266,783.81	5,553,386,340.49
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		984,110,471.16	945,953,337.08
应付清算款		10,000,442.50	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		889,992.88	1,171,954.56
应付托管费		296,664.31	390,651.52
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		223,515.54	230,495.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	203,139.40	396,427.80
负债合计		995,724,225.79	948,142,866.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	3,420,646,225.43	4,420,869,281.24
未分配利润	6.4.7.9	191,896,332.59	184,374,192.40
净资产合计		3,612,542,558.02	4,605,243,473.64
负债和净资产总计		4,608,266,783.81	5,553,386,340.49

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,420,646,225.43 份。本基金下属汇添富鑫永定开债 A 基金份额净值 1.0561 元，基金份额总额 3,420,646,225.43 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		**66,666,621.85**	**13,900,831.05**
1.利息收入		130,557.43	87,979.99
其中：存款利息收入	6.4.7.10	54,560.09	44,987.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		75,997.34	42,992.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		47,334,406.29	56,478,163.56
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	47,300,295.69	56,478,163.56
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	34,110.60	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列）	6.4.7.18	19,201,658.13	-42,665,312.50
4.汇兑收益(损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
减：二、营业总支出		**15,134,711.81**	**21,053,653.42**
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,576,092.26	8,347,599.99
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,858,697.45	2,782,533.40
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,405,731.72	9,648,128.44
其中：卖出回购金融资产支出		7,405,731.72	9,648,128.44
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		142,419.92	123,556.56
8. 其他费用	6.4.7.21	151,770.46	151,835.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**51,531,910.04**	**-7,152,822.37**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**51,531,910.04**	**-7,152,822.37**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**51,531,910.04**	**-7,152,822.37**

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,420,869,281.24	184,374,192.40	4,605,243,473.64
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	4,420,869,281.24	184,374,192.40	4,605,243,473.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,000,223,055.81	7,522,140.19	-992,700,915.62
（一）、综合收益总额	-	51,531,910.04	51,531,910.04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,000,223,055.81	-44,009,769.85	-1,044,232,825.66
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-1,000,223,055.81	-44,009,769.85	-1,044,232,825.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	3,420,646,225.43	191,896,332.59	3,612,542,558.02
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,422,030,856.40	215,152,904.07	5,637,183,760.47
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	5,422,030,856.40	215,152,904.07	5,637,183,760.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-111,572.98	-7,156,738.67	-7,268,311.65
（一）、综合收益总额	-	-7,152,822.37	-7,152,822.37
（二）、本期基	-111,572.98	-3,916.30	-115,489.28

金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-111,572.98	-3,916.30	-115,489.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	5,421,919,283.42	207,996,165.40	5,629,915,448.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金（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〔2017〕2356 号文《关于准予汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2018 年 1 月 25 日生效。首次设立基金募集规模为 2,009,999,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2018）验字第 60466941_B03 号验资报告予以验证。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 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

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

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‰；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、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

2.增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易

计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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法》、《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）及地方教育附加。

4.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《财政部 国家税务总局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〔2008〕1 号《财政部 国家税务总局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。

5.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《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《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《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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	10,378,069.29
等于：本金	10,377,900.49
加：应计利息	168.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,378,069.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	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	144,020,413.43	738,281.65	145,689,281.65	930,586.57
	银行间市场	4,367,369,439.14	35,066,240.45	4,427,163,740.45	24,728,060.86
	其他	-	-	-	-
	合计	4,511,389,852.57	35,804,522.10	4,572,853,022.10	25,658,647.43
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,511,389,852.57	35,804,522.10	4,572,853,022.10	25,658,647.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 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	-
应付交易费用	94,660.45
其中：交易所市场	-
银行间市场	94,660.45
应付利息	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	9,300.00
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	203,139.40

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富鑫永定开债 A		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,420,869,281.24	4,420,869,281.24
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1,000,223,055.81	-1,000,223,055.81
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	3,420,646,225.43	3,420,646,225.43
汇添富鑫永定开债 C		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
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	-	-

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富鑫永定开债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	129,534,094.38	54,840,098.02	184,374,192.40
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	129,534,094.38	54,840,098.02	184,374,192.40
本期利润	32,330,251.91	19,201,658.13	51,531,910.04
本期基金份额交易产生的变动数	-30,873,821.70	-13,135,948.15	-44,009,769.85
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-30,873,821.70	-13,135,948.15	-44,009,769.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	130,990,524.59	60,905,808.00	191,896,332.59
汇添富鑫永定开债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-	-	-
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	-	-	-

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	38,050.99
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	16,504.55
其他	4.55
合计	54,560.09

注:“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	43,592,699.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,707,596.29
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	47,300,295.69

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,398,406,236.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,325,985,596.48
减：应计利息总额	68,582,331.63
减：交易费用	130,712.50
买卖债券差价收入	3,707,596.29

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
外汇期货投资收益	-
股指期货投资收益	-
国债期货投资收益	34,110.60
外汇远期投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	19,201,658.13
——股票投资	-
——债券投资	19,201,658.13
——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	-
——期货投资	-
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	19,201,658.13

6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	27,900.00
银行费用	24,691.51
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	151,770.46

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、关联关系

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,基金销售机构,基金注册登记机构,基金发起人
中国民生银行股份有限公司（"民生银行"）	基金托管人
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东,基金销售机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券	74,097,393.43	100.00	-	-

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
东方证券	351,200,000.00	100.00	-	-

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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不存在向关联方支付佣金的情况。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,576,092.26	8,347,599.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	1.81	1.81
应支付基金管理人的净管理费	5,576,090.45	8,347,598.18

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

H = E × 0.30% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	1,858,697.45	2,782,533.40

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

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于 3 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

单位：人民币元

本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	-	-	-	-	305,000,000.00	12,678.08
上年度可比期间 **2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日**						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	55,337,333.56	-	-	-	500,000,000.00	60,000.00

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限

费率的证券出借业务。

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

汇添富鑫永定开债 A		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 01 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	100.00	100.00
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	100.00	100.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	0.00	0.00
汇添富鑫永定开债 C		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 01 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	10,378,069.29	38,050.99	6,227,042.66	44,979.88

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直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2026 年 06 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：本基金本报告期末无因认购新发/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 2026 年 06 月 30 日止，本基金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 984,110,471.16 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102583367	25 京国资 MTN009	2026 年 07 月 01 日	101.91	500,000	50,954,920.55
102583816	25 汇金	2026 年 07 月	102.27	300,000	30,680,365.4

	MTN005	02 日			8
102681772	26 河钢集 MTN011	2026 年 07 月 01 日	100.56	500,000	50,278,416.44
102680512	26 南昌交投 MTN001	2026 年 07 月 02 日	101.23	300,000	30,370,336.44
102583747	25 越秀集团 MTN006	2026 年 07 月 01 日	102.10	600,000	61,258,671.78
102585025	25 新华水力 MTN004A	2026 年 07 月 02 日	102.42	100,000	10,241,613.70
102485075	24 陕延油 MTN013	2026 年 07 月 01 日	103.57	600,000	62,144,074.52
102585368	25 电网 MTN045(科创债)	2026 年 07 月 02 日	102.58	84,000	8,617,082.70
102680843	26 国开投 MTN003	2026 年 07 月 02 日	101.17	400,000	40,469,304.11
102584626	25 鲁高速 MTN009	2026 年 07 月 01 日	102.02	700,000	71,411,035.07
102680345	26 南电 MTN001(科创债)	2026 年 07 月 02 日	101.39	200,000	20,278,378.08
102681849	26 河钢集 MTN013	2026 年 07 月 01 日	100.39	477,000	47,887,051.95
102681873	26 榆林能源 MTN001	2026 年 07 月 02 日	100.15	300,000	30,046,027.40
102680395	26 张家经开 MTN001	2026 年 07 月 02 日	101.50	200,000	20,299,260.27
102584613	25 蓉城轨交 MTN003	2026 年 07 月 01 日	101.89	1,000,000	101,885,906.85
102581881	25 鲁钢铁 MTN005	2026 年 07 月 02 日	101.85	200,000	20,370,657.53
102582344	25 苏交通 MTN004	2026 年 07 月 02 日	100.65	200,000	20,130,219.18
102584017	25 江西交投 MTN006	2026 年 07 月 01 日	101.92	600,000	61,152,654.25
102680665	26 巨化 MTN001(科创债)	2026 年 07 月 02 日	100.96	300,000	30,287,643.29
102585368	25 电网 MTN045(科创债)	2026 年 07 月 01 日	102.58	416,000	42,675,076.20
102584219	25 广州地铁 MTN010	2026 年 07 月 01 日	102.13	500,000	51,065,641.10
102680224	26 越秀资本	2026 年 07 月	101.34	200,000	20,267,636.1

	MTN001A	02 日			6
102580354	25 电网 MTN002	2026 年 07 月 01 日	101.35	400,000	40,541,830.14
102681909	26 巨化 MTN002(科创债)	2026 年 07 月 02 日	100.10	400,000	40,038,917.26
102584687	25 招商局港 MTN001	2026 年 07 月 01 日	101.44	1,000,000	101,438,805.48
合计				10,477,000	1,064,791,525.93

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 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 2026 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	401,911,452.05
合计	-	401,911,452.05

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均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

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同业存单投资。

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	984,773,465.78	1,093,170,632.88
AAA 以下	50,735,240.00	51,785,082.74
未评级	3,537,344,316.32	3,975,838,264.05
合计	4,572,853,022.10	5,120,793,979.67

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

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。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 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							
货币资金	10,378,069.29	-	-	-	-	-	10,378,069.29
结算备付金	5,052,254.67	-	-	-	-	-	5,052,254.67
存出保证金	5,231.30	-	-	-	-	-	5,231.30
交易性金融资产	-	-	22,209,408.77	3,907,441,035.92	643,202,577.41	-	4,572,853,022.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	19,978,206.45	19,978,206.45
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,435,555.26	-	22,209,408.77	3,907,441,035.92	643,202,577.41	19,978,206.45	4,608,266,783.81
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	984,110,471.16	-	-	-	-	-	984,110,471.16
应付清算款	-	-	-	-	-	10,000,442.50	10,000,442.50
应付赎回	-	-	-	-	-	-	-

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	889,992.88	889,992.88
应付托管费	-	-	-	-	-	296,664.31	296,664.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	223,515.54	223,515.54
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	203,139.40	203,139.40
负债总计	984,110,471.16	-	-	-	-	11,613,754.63	995,724,225.79
利率敏感度缺口	-968,674,915.90	-	22,209,408.77	3,907,441,035.92	643,202,577.41	8,364,451.82	3,612,542,558.02
上年度末 2025 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							
货币资金	30,679,844.98	-	-	-	-	-	30,679,844.98
结算备付金	1,063.79	-	-	-	-	-	1,063.79
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	3,091,754.79	1,535,835,005.72	3,983,778,671.21	-	-	5,522,705,431.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,680,908.77	3,091,754.79	1,535,835,005.72	3,983,778,671.21	-	-	5,553,386,340.49
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	945,953,337.08	-	-	-	-	-	945,953,337.08
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,171,954.56	1,171,954.56
应付托管费	-	-	-	-	-	390,651.52	390,651.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	230,495.89	230,495.89
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	396,427.80	396,427.80
负债总计	945,953,337.08	-	-	-	-	2,189,529.77	948,142,866.85
利率敏感度缺口	-915,272,428.31	3,091,754.79	1,535,835,005.72	3,983,778,671.21	-	-2,189,529.77	4,605,243,473.64

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和可交换债券。		
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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	42,324,186.08	24,080,202.24
	基准利率增加 25 个基点	-41,247,256.80	-23,892,409.82

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

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

于本期末及上年度末，本基金持有的交易性权益投资、可转换债券及可交换债券公允价值占基金资产净值的比例小于 10%，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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属

的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	-
第二层次	4,572,853,022.10
第三层次	-
合计	4,572,853,022.10

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-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”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

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（元）	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	4,572,853,022.10	99.23
	其中：债券	4,572,853,022.10	99.23
	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	15,430,323.96	0.33
8	其他各项资产	19,983,437.75	0.43
9	合计	4,608,266,783.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

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

注:本基金本报告期未投资股票。

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	360,507,966.45	9.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	469,456,878.91	13.00
	其中：政策性金融债	221,704,997.26	6.14
4	企业债券	94,856,544.66	2.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,597,198,895.09	99.58
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	地方政府债	50,832,736.99	1.41
10	其他	-	-
11	合计	4,572,853,022.10	126.58

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	102584232	25 北控 MTN001	1,800,000	183,700,296.99	5.09
2	102583997	25 中航集 MTN001	1,500,000	153,497,161.64	4.25
3	2600002	26 超长特别国债 02	1,300,000	129,860,551.91	3.59
4	102584613	25 蓉城轨交 MTN003	1,000,000	101,885,906.85	2.82
5	102584687	25 招商局港 MTN001	1,000,000	101,438,805.48	2.81

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投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货交易。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和

定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险，符合既定的投资政策和投资目标。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行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。

7.12.2

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。

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	5,231.30
2	应收清算款	19,978,206.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,983,437.75

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。

§8 基金份额持有人信息

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（%）
汇添富鑫永定开债 A	221	15,478,037.22	3,420,646,225.43	100.00	0.00	0.00
汇添富鑫永定开债 C	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	221	15,478,037.22	3,420,646,225.43	100.00	0.00	0.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	汇添富鑫永定开债 A	0
	汇添富鑫永定开债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富鑫永定开债 A	0
	汇添富鑫永定开债 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	100.00	0.00	100.00	0.00	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	

基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	100.00	0.00	100.00	0.00	

注：本基金成立后有 10,000,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2018 年 01 月 25 日起 3 年。截至本报告期期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 100.00 份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富鑫永定开债 A	汇添富鑫永定开债 C
基金合同生效日（2018 年 01 月 25 日）基金份额总额	2,009,999,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	4,420,869,281.24	-
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	1,000,223,055.81	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,420,646,225.43	-

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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	2	-	-	-	-	
东吴证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国盛证券	2	-	-	-	-	
华源证券	2	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	
甬兴证券	2	-	-	-	-	

注: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 基金租用或者通过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		基金交易	
	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（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
东方证券	74,097,393.43	100.00	351,200,000.00	100.00	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

（2）交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

（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门决定。

（6）交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

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

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旗下部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,深交所	2026 年 01 月 16 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,深交所	2026 年 01 月 16 日
3	关于汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金第三十一次开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,证券时报	2026 年 01 月 19 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 04 月 22 日
8	关于汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金第三十二次开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,证券时报	2026 年 04 月 24 日
9	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026 年 04 月 30 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证监会基金电子	2026 年 06 月 06 日

	于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	披露网站,公司网站,上证报	

§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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	4,420,639,148.55	-	1,000,000,000.00	3,420,639,148.55	100.00
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、转换运作方式或与其他基金合并。							

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、中国证监会批准汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富鑫永定期开放债券型发起式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、报告期内汇添富鑫永定期开放债券型发起式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。

12.2 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

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 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 08 月 31 日