

汇添富稳利 60 天滚动持有短债债券型证券投资 基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2022 年 01 月 24 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|---------------|---|
| 基金简称 | 汇添富稳利 60 天短债 |
| 基金主代码 | 012574 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 06 月 24 日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 777,882,635.38 |
| 投资目标 | 在严格控制投资组合风险的前提下，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 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、期限结构配置策略、个券选择策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（1 年以下）指数收益率*85%+ 银行一年期定期存款利率(税后)*15%。 |
| 风险收益特 | 本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合 |

| | | |
|--------------------|----------------|----------------|
| 征 | 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 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富稳利 60 天短债 A | 汇添富稳利 60 天短债 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012574 | 012575 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 51,862,771.28 | 726,019,864.10 |

§ 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(2021 年 10 月 01 日 - 2021 年 12 月 31 日) | |
|-----------------|--|----------------|
| | 汇添富稳利 60 天短债 A | 汇添富稳利 60 天短债 C |
| 1. 本期已实现收益 | 604,873.70 | 4,217,969.27 |
| 2. 本期利润 | 681,901.12 | 4,951,340.47 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0091 | 0.0089 |
| 4. 期末基金资产净值 | 52,856,349.22 | 739,118,845.70 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0192 | 1.0180 |

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、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

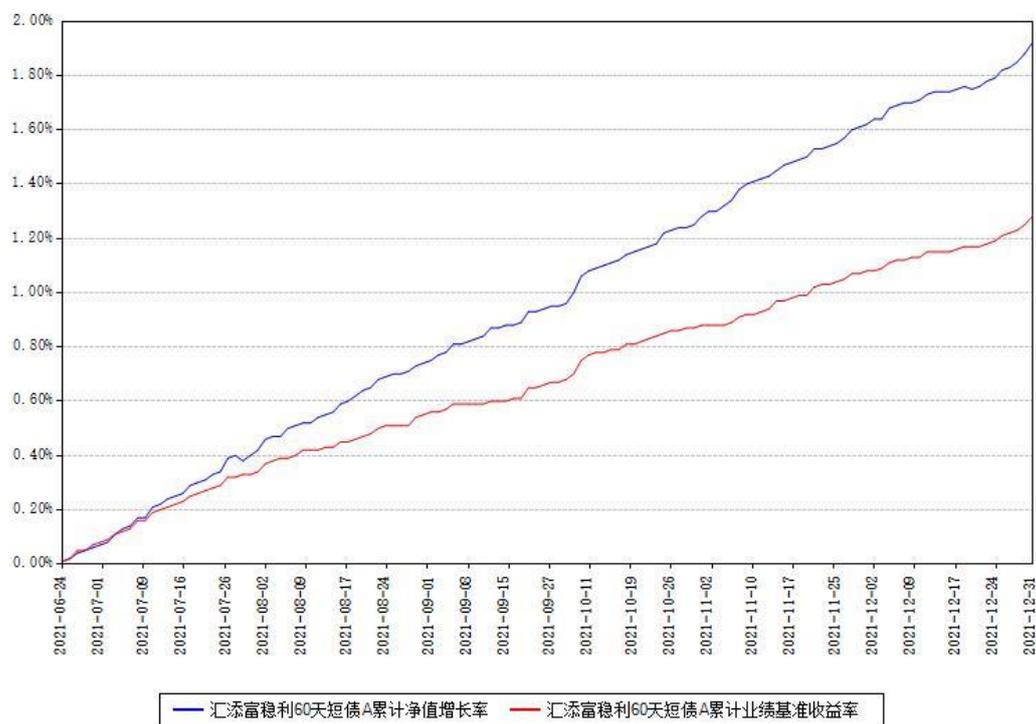
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富稳利 60 天短债 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 |

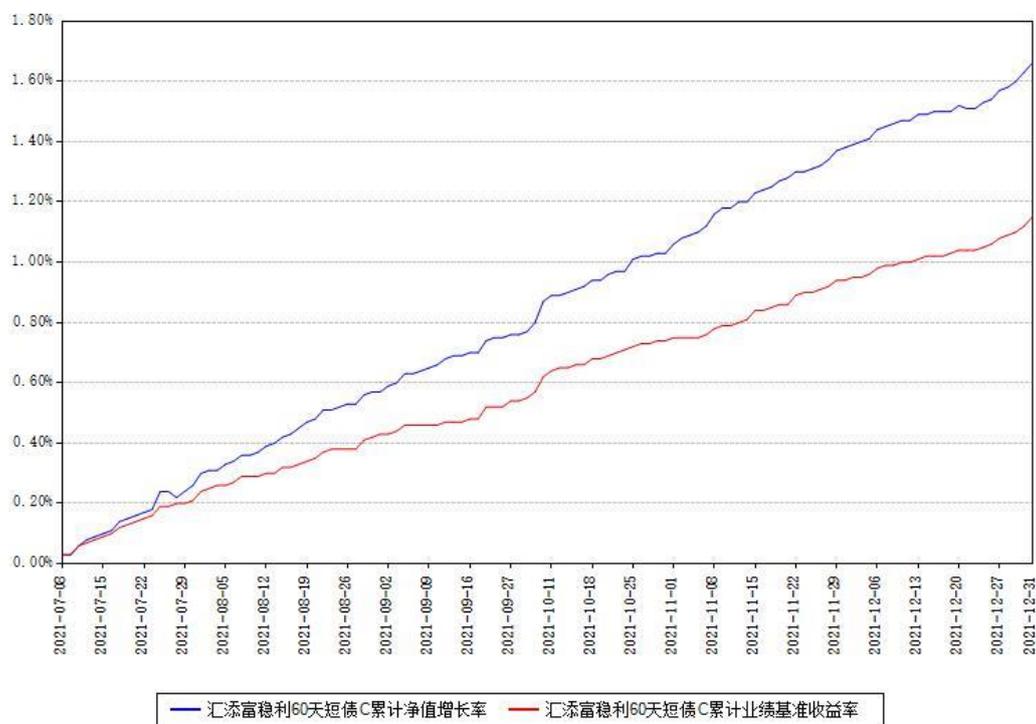
| | | 准差② | 率③ | 率标准差④ | | |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.91% | 0.01% | 0.58% | 0.01% | 0.33% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.86% | 0.01% | 1.21% | 0.01% | 0.65% | 0.00% |
| 自基金合同生效日起至今 | 1.92% | 0.01% | 1.28% | 0.01% | 0.64% | 0.00% |
| 汇添富稳利 60 天短债 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 |
| 过去三个月 | 0.85% | 0.01% | 0.58% | 0.01% | 0.27% | 0.00% |
| 自基金合同生效日起至今 | 1.66% | 0.01% | 1.15% | 0.01% | 0.51% | 0.00% |

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

汇添富稳利60天短债A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富稳利60天短债C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为2021年06月24日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金已完成建

仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3、本基金 C 类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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 | | |
| 徐寅喆 | 本基金的基金经理, 现金管理部主管 | 2021 年 06 月 24 日 | | 13 | 国籍：中国。学历：复旦大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任债券交易员、固定收益基金经理助理，现任现金管理部主管。2014 年 8 月 27 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月 27 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快线货币 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>市场基金的基金经理。</p> <p>2014 年 11 月 26 日至今任汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理。2014 年 12 月 23 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 5 月 4 日至 2020 年 8 月 18 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经</p> |
|--|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>理。2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币市场基金的基金经理。2019 年 9 月 10 日至今任汇添富汇鑫浮动净值型货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。2021 年 6 月 24 日至今任汇添富稳利 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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

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

四季度,海外疫情导致供应链短缺,全球通胀继续高企,各国央行纷纷开始采取进一步应对措施;美联储 12 月宣布加速 Taper 并计划于 2022 年一季度完成全部缩减,同时进一步释放加息信号,引导市场预期;欧洲通胀相对缓和,继续维持三大利率不变;英国央行则在 12 月宣布加息 15BP 至 0.25%,成为疫情以来加息的首个主要发达国家,全球流动性预期继

续边际收紧。

国内方面，地产危机的爆发使得市场对经济增长的担忧进一步加剧，12 月政治局会议重提“六稳”、“六保”，中央经济工作会议也进一步强调了稳增长的诉求。政策环境开始更加偏重稳增长，保预期。央行继 7 月之后于 12 月初再次宣布全面降准 0.5 个百分点，释放整体流动性以应对部分市场债务风险，缓解经济下行压力，从货币政策会议表述来看，也是为进一步发挥总量和结构双重功能，降低企业融资成本，引导市场预期。宏观数据来看，通胀方面，CPI 整体依旧维持低位，PPI 在 10 月创出新高后拐点出现，同比进入下行区间；PMI 在 11 月、12 月重回荣枯线上方；信贷方面，市场整体需求仍较为疲软，结构较差，票据利率显著走低；债券市场，伴随流动性持续宽松及经济下行预期，收益率一路走低，AAA 信用债 1y 期限下行至 2.75%；3y 期限下行至 2.95%，期限利差进一步压缩。

操作上，报告期内本基金配置以高等级信用债为主，同时根据市场情况灵活调整组合仓位，避免净值大幅波动，在流动性相对宽松的环境下维持组合较高杠杆水平，控制组合风险的同时为持有人获取稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 0.91%；C 类基金份额净值增长率为 0.85%。同期业绩比较基准收益率为 0.58%。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 981,796,000.00 | 96.03 |
| | 其中：债券 | 966,784,000.00 | 94.56 |
| | 资产支持证券 | 15,012,000.00 | 1.47 |
| 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 | 1,923,330.93 | 0.19 |
| 8 | 其他资产 | 38,683,797.01 | 3.78 |
| 9 | 合计 | 1,022,403,127.94 | 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

注：本基金报告期末未投资境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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 | 49,470,000.00 | 6.25 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 761,113,000.00 | 96.10 |
| 6 | 中期票据 | 10,081,000.00 | 1.27 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 146,120,000.00 | 18.45 |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|--------|
| 10 | 合计 | 966,784,000.00 | 122.07 |
|----|----|----------------|--------|

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 | 112118301 | 21 华夏银行 CD301 | 1,000,000 | 97,410,000.00 | 12.30 |
| 2 | 219963 | 21 贴现国债 63 | 500,000 | 49,470,000.00 | 6.25 |
| 3 | 112108181 | 21 中信银行 CD181 | 500,000 | 48,710,000.00 | 6.15 |
| 4 | 012103898 | 21 鄂交投 SCP011 | 300,000 | 30,024,000.00 | 3.79 |
| 5 | 042100441 | 21 电网 CP012 | 300,000 | 30,009,000.00 | 3.79 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 193199 | 华能 23 优 | 150,000 | 15,012,000.00 | 1.90 |

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，华夏银行股份有限公司、中信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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,805,591.08 |
| 5 | 应收申购款 | 32,878,205.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 38,683,797.01 |

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：本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 汇添富稳利 60 天短债 A | 汇添富稳利 60 天短债 C |
|---------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 122,331,144.07 | 734,845,142.44 |
| 本报告期基金总申购份额 | 17,371,673.59 | 394,674,745.73 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 87,840,046.38 | 403,500,024.07 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 51,862,771.28 | 726,019,864.10 |

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

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稳利 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳利 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳利 60 天滚动持有短债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、报告期内汇添富稳利 60 天滚动持有短债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

2022 年 01 月 24 日