## 汇添富利率债债券型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025年09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:中国工商银行股份有限公司

送出日期: 2025年10月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 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 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

## §2基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富利率债			
基金主代码	472007			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2020年10月30日			
报告期末基金份额总额(份)	2, 168, 353, 640. 88			
投资目标	在科学严格管理风险的前提下, 本基金力争			
1久页日你	创造超越业绩比较基准的较高收益。			
	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			
投资策略	及组合久期。本基金采取的投资策略主要包			
	括久期策略、骑乘策略、期限结构配置策			
	略、息差策略等。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	中债-总全价(总值)指数收益率×90%+银			
业坝儿权至性	行活期存款利率(税后)×10%			
风险收益特征	本基金为债券型基金, 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	中国工商银行股份有限公司

## §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(2025年07月01日 - 2025年09月30日)
1. 本期已实现收益	8, 769, 663. 62
2. 本期利润	3, 162, 296. 56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0013
4. 期末基金资产净值	2, 277, 669, 307. 91
5. 期末基金份额净值	1.0504

- 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

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	0.12%	0.02%	-1.39%	0.08%	1.51%	-0.06%
过去六 个月	0.71%	0.03%	-0.64%	0.09%	1.35%	-0.06%
过去一年	2.70%	0.05%	0.41%	0.11%	2.29%	-0.06%
过去三	10. 57%	0.06%	4. 10%	0.09%	6. 47%	-0.03%
自基金	18. 21%	0.05%	7.72%	0.08%	10.49%	-0.03%

合同生			
效起至			
今			

# 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



汇添富利率债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(2020年10月30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。

本基金由原汇添富理财7天债券型证券投资基金于2020年10月30日转型而来。

## § 4 管理人报告

### 4.1基金经理(或基金经理小组)简介

抽力	田夕	任本基金的基	基金经理期限	证券从业年限	2H nn
姓名	职务	任职日期	离任日期	(年)	说明
李伟	本基金的	2023年02	_	1.1	国籍:中国。学
子巾	基金经理	月 20 日	_	11	历:上海交通大

學上海高級金融學院应用经济學硕士、  一個			
爾士。从业资格:证券投资基金从业资格:证券投资基金从业资格,期货投资外析资格,期货投资外析资格,对于 2013年7月至1013年7月至1013年7月至1013年7月至1013年7月至1013年7月至1013年2013年2月至1013年2022年2月20日至今任职分司基金经理。2023年2月20日至全分任汇添富债券全经理。2023年2月20日至全分债汇添富债券投资理。2023年2月20日至全债债券组金约223年2月20日至全债债券组金约235年2月20日至少债债费基金的基金经理。2023年2月20日至今债债券指数的基金经理。2023年3月2日至2024年11月19日任汇率周开券投资基金的基金经理。2023年6月1日至2024年11月19日任汇率周开券投资基金的基金经理。2023年6月1日日至今任汇添富中债债券指数的基金经理。2023年6月1日日至今任汇添富中债债券指数的基金经理。2023年6月1日日至今日汇添富中债债券指数的基金经理。2023年6月1日日至今日汇添富中债债券指数。			学上海高级金融
格: 证券投资期 货投资价析资格, CFA, FRM。 从业经历: 2013 年7月4户 (CFA) (C			学院应用经济学
金从业资格,期 货投资分析资格,CFA,FRM。 从业经历;2013 年7月至2018 年8月任厂发基。查管理有限公司 超定收益、部债券 交易人。部值产厂发基。金管理有限公司基金全理理。 2022年8月加入 汇添富基金。 2023年2月20日至今任汽添高证 为华投资基金的基金经理。2023年 2月20日至今任汇添资整型发起。 式证券投资基金的基金经理。 2023年2月20日至今任汽添资数投资基金的基金经理。 2023年2月20日至今任汽添资数投资基金的基金经理。 2023年2月20日至今任汽添资数投资基金的基金经理。 2023年1月1日 1月1日任汇添富中债 为指数基金经理。 2024年11月19日任汇添富中债 为指数基金经理。 2023年6月2日至少位任汇添富中债 有1年1月1日日任汇添富的基金经理。 2023年6月1日日至今任汇添富中债			硕士。从业资
发投资分析资格,CFA,FRM。 从业经开至 2018 年7月至 2018 年7月至 2018 年8月在广发基金管理收益制度收益 600 000 000 000 000 000 000 000 000 00			格:证券投资基
格,CFA、FRM。从业经历: 2013年7月至2018年7月至2018年7月至2018年8月任户股公司固定收益司 宣史收益司 宣史收益司 國際 對於交易 所究 衛佐 中國 學問			金从业资格,期
格,CFA、FRM。从业经历: 2013年7月至2018年7月至2018年7月至2018年8月任户股公司固定收益司 宣史收益司 宣史收益司 國際 對於交易 所究 衛佐 中國 學問			货投资分析资
从业经历: 2013 年7月至2018 年8月日有配价贷为 金管理有限。 2023 研究员管理有理。 2022年8月加入 汇添量基金。 2023年2月20日至今债债基金。 2023年2月20日至今债债基金。 2023年2月20日至今任 汇添 债券登理。 2023年2月20日至今任 汇添 债券投理。 2023年2月20日至今任 汇添 债券投理。 2023年1月19日任 证本金经,2023年2月20日至位, 资券的基金经理。 2024年11月19日任 1月19日任任汇本国开行债 为指数电量。 2023年6月 14日至个任 汽车的传统。 2023年6月 14日至十0年 日子行债, 2023年6月 14日至十0年 日子行债, 2023年6月 14日至十0年 日子行债, 2023年7日至 2024年1日年 1日日代汇本国开行债 2023年7日至 2023年7日月 2023年7日至 2023年7日			
年7月至2018 年8月任广发基金管理有限公司固定收益前债实价。因为交易员证的债产价发基金管理人。因为实验,是有理是公司基金全经理。2022年8月20日至今任人限。2023年2月20日至今任汇汇率债券投资基金。2023年2月20日至今任汇汇率债券投资基金的基金经理。2023年2月20日至今任汇汇资益。10至4年11月19日任汇添型证券投资基金的基金经理。2023年3月2日至今任11月19日任汇添工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工			***
年8月任广发基金管理有限企品的债券收益研究所,管理分别,不是有限的。 国营收益的 医子子 发展 对			
金管理有限公司 固定收益研究部债券 交易员、固定收益研究部债券研究员。管理限公司基金全理理。 2022年8月加入 汇添雪基金。 2023年2月20日至今任元添型 券投票。2023年 2月20日至今任 汇添数投票。 2023年2月20日至今任 汇添数投理。 2023年2月20日至今任 汇添数数理。 2023年2月20日至今任 汇添数数理。 2023年2月20日至今任汇添富 鑫院纯债债券型 证券投资基金的基金全理。 2024年11月19日任汇添富年债 券指数证券经经理。 2023年6月 14日至今任汇添富中债 券指数证券经 理。2023年6月 14日下行债券指数 证券投资基金的			
固定收益部债券交易员、商定收益研究部债券所等。   可見,不可以是有人。   可是在一个发基金。   在			
交易员、固定收益研究部债券研究员,曾任广发基金全理。2022 年8 月加入汇添富基金。2023 年 2 月 20日至今任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 20日至全年汇汇额债券型货基金的基金发起式货基金的基金发起或货工资率。2023 年 2 月 20日至个任汇添富鑫晚纯债债基金的基金经理。2023 年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19日任汇添富开行债券指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 14日至今任汇添富中债7-10 年国开行债券指数证券投资基金的			
益研究部债券研究员,曾任广发基金全理。 2022 年 8 月加入 汇添富基金。 2023 年 2 月 20 日至今任派型富 利率债债券查证 券投资基金的基金经理。 2023 年 2 月 20 日至今任 汇添企业。 2023 年 2 月 20 日至今任 汇添数投资基金的基金经理。 2023 年 2 月 20 日至今任 汇添营大股资基金的基金经理。 2023 年 1月 月9 日任汇添富)。 第次经理。2023年 3 月 2 日至 2024年 11 月 19 日任汇添富)中债 为指数证券经及基金的基金经理。 2023年 6 月 14 日至今任汇添富中债 7-10年 国开行债券指数证券投资基金的			
究员、曾任广发基金管理有限公司基金公理。 2022 年 8 月加入 汇添富基金。 2023 年 2 月 20 日至今任汇添富 利率债费基金的基金经理。 2023 年 2 月 20 日至今任 汇添自塞盛发起式证券投资基金的基金经理。 2023 年 2 月 20 日至今任 汇添券投资基金的基金经理。 2023 年 2 月 20 日至今债债债券型证券投资基金的基金经理。 2024 年 11 月 19 日任汇添富中债 1-3 年国开行债券指数证券经经理。 2024 年 6 月 14 日至今任汇添富中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的			
基金管理有限公司基金经理。 2022年8月加入汇添富基金。 2023年2月20日至今任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2023年2月20日至今任汇添富鑫盛发起式证券投资基金的基金经理。 2023年2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。 2023年2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。2023年3月2日至2024年11月19日任汇添富中债1-3年国开行债券指数百量金经理。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			
司基金经理。 2022 年 8 月加入 汇添富基金。 2023 年 2 月 20 日至今任汇添富 利率债债券型证券投资基金的基 金经理。2023 年 2 月 20 日至今任 汇添富鑫戏定期 开放债券投资基金 的基金经理。 2023 年 2 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。 2023 年 2 月 20 日至今任汇添富鑫悦纯债债券担证券投资基金的基金经理。 2023 年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19 日任汇添富中债 1-3 年国证券投资基金的基金经 理。2023 年 6 月 14 日至今任汇添富中债 7-10 年国开行债券指数 证券投资基金的			
2022 年 8 月加入 汇添富基金。 2023 年 2 月 20 日至今任汇添富 利率债债券型证 券投资基金的基 金经理。2023 年 2 月 20 日至今任 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。 2023 年 2 月 20 日至今任汇添富 鑫悦纯债券型 证券投理。2023 年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19 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。2023 年 6 月 14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
汇添富基金。 2023年2月20日至今任汇添富 利率债债券型证券投资基金的基金经理。2023年2月20日至今任 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。 2023年2月20日至今任汇添富 鑫悦纯债券型 证券投资基金的基金经理。2023年3月2日至 2024年11月19日任汇添富中债 1-3年国干行债券指数证券投资基金的基金经理。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年 国开行债券指数证券投资基金的			* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *
2023 年 2 月 20 日至今任汇添富 利率债债券型证 券投资基金的基 金经理。2023 年 2 月 20 日至今任 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。 2023 年 2 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。2023 年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19 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。2023 年 6 月 14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
日至今任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2023年2月20日至今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。2023年2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。2023年3月2日至2024年11月19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。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			
利率债债券型证券投资基金的基金经理。2023年2月20日至今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。2023年2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。2023年3月2日至2024年11月19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。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			
券投资基金的基金经理。2023年2月20日至今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。2023年2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。2023年3月2日至2024年11月19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。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			
金经理。2023年2月20日至今任 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。 2023年2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。2023年3月2日至 2024年11月19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。2023年6月 14日至今任汇添富中债7-10年 国开行债券指数 证券投资基金的			
2月20日至今任 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。 2023年2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。2023年3月2日至 2024年11月19 日任汇添富中债 1-3年国开行债 券指数证券投资 基金的理。2023年6月 14日至今任汇添富中债7-10年 国开行债券指数 证券投资基金的			
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。 2023 年 2 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。2023 年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19 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。2023 年 6 月 14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
开放债券型发起 式证券投资基金的基金经理。 2023年2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。2023年3月2日至 2024年11月19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。2023年6月 14日至今任汇添 富中债7-10年 国开行债券指数 证券投资基金的			
式证券投资基金的基金经理。 2023年2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。2023年3月2日至2024年11月19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。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			
的基金经理。 2023 年 2 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。2023 年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19 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。2023 年 6 月 14 日至今任汇添富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
2023年2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。2023 年3月2日至 2024年11月19 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。2023年6月 14日至今任汇添 富中债7-10年 国开行债券指数 证券投资基金的			
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。2023年3月2日至2024年11月19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。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			1 1
鑫悦纯债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月2日至2024年11月19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。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			
证券投资基金的基金经理。2023年3月2日至2024年11月19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。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的			
基金经理。2023 年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19 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。2023 年 6 月 14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
年 3 月 2 日至 2024 年 11 月 19 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。2023 年 6 月 14 日至今任汇添富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
2024年11月19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。2023年6月 14日至今任汇添 富中债7-10年 国开行债券指数 证券投资基金的			
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。2023 年 6 月 14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月14 日至今任汇添富中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的			
券指数证券投资基金的基金经理。2023年6月14日至今任汇添富中债7-10年 国开行债券指数证券投资基金的			
基金的基金经 理。2023 年 6 月 14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
理。2023 年 6 月 14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
14 日至今任汇添 富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
富中债 7-10 年 国开行债券指数 证券投资基金的			
国开行债券指数证券投资基金的			
证券投资基金的			
			国开行债券指数
基金经理。2023			证券投资基金的
			基金经理。2023

	1	1	1	1	
					年6月20日至2024年11月19
					2024 年 11 月 19   日任汇添富鑫荣
					口任在你虽鍂未   纯债债券型证券
					投资基金的基金
					投页墨亚的墨亚
					5年。2024年   11 月 19 日至今
					11 万 15 日至 <del> </del>   任汇添富丰穂 60
					天持有期债券型
					证券投资基金的
					基金经理。2025
					年 7 月 23 日至
					今任汇添富稳惠
					6 个月持有期债
					券型证券投资基
					金的基金经理。
					国籍:中国。学
					历:英国伦敦政
					治经济学院金融
					经济学硕士。从
					业资格:证券投
					资基金从业资
					格,CFA,FRM。
					从业经历:曾任
					国泰基金管理有 限公司行业研究
					限公司行业研允
					经理助理、基金
					经理,固定收益
	本基金的	2022年04	2025年08		部负责人; 金元
何旻	基金经理	月 29 日	月 28 日	27	比联基金管理有
					限公司基金经
					理。2011年1月
					加入汇添富资产
					管理 (香港) 有
					限公司,2012年
					2月17日至今任
					汇添富人民币债
					券基金的基金经
					理。2012年8月
					加入汇添富基金
					管理股份有限公
					司。2013年11
					月 22 日至 2024
					年6月5日任汇

		添富安心中国债
		券型证券投资基
		金的基金经理。
		2014年1月21
		日至 2019 年 8
		月 28 日任汇添
		富 6 月红添利定
		期开放债券型证
		券投资基金的基
		金经理。2016年
		3月11日至
		2019年8月28
		日任汇添富盈鑫
		灵活配置混合型
		证券投资基金的
		基金经理。2017
		年4月20日至
		2022年9月2日
		任汇添富精选美
		元债债券型证券
		投资基金的基金
		经理。2017年7
		月 24 日至 2019
		年 8 月 28 日任
		汇添富添福吉祥
		混合型证券投资
		基金的基金经
		理。2017年9月
		6日至2019年8
		月 28 日任汇添
		富盈润混合型证
		券投资基金的基
		金经理。2017年
		9月29日至
		2019年8月28
		日任汇添富弘安
		混合型证券投资
		基金的基金经
		理。2018年7月
		5 日至 2021 年 8
		月3日任汇添富
		3年封闭运作战
		略配售灵活配置
		混合型证券投资
		基金(LOF)的
		基金经理。2019

年4月15日至2023年3月2日任汇添富中债13年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年5月14日至2025年8月28日任汇添富中债7-1年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置清合型证券投资基金
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。 2019 年 6 月 19 日至 2020 年 7 月 8 日任汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。 2020 年 5 月 14 日至 2025 年 8 月 28 日任汇添富申债 7-1 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。 2021 年 8 月 3 日至 2022 年 6 月日任汇添富核心精选灵活配置海
3年国开行债券 指数证券投资基金的基金经理。 2019年6月19 日至2020年7 月8日任汇添富 中债1-3年农发 行债券指数证券 投资基金的基金 经理。2020年1 月14日至2025年8月28日任 汇添富中债7-1 年国开行债券指 数证券投资基金的基金经理。 2021年8月3日 至2022年6月 日任汇添富核心 精选灵活配置海
指数证券投资基金的基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年1月14日至2025年8月28日任汇添富中债7-1年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置流
金的基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年1月14日至2025年8月28日任汇添富中债7-1年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置流
金的基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年1月14日至2025年8月28日任汇添富中债7-1年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置流
2019年6月19 日至2020年7 月8日任汇添富 中债1-3年农发 行债券指数证券 投资基金的基金 经理。2020年 月14日至2025年8月28日任 汇添富中债7-1 年国开行债券指 数证券投资基金 的基金经理。 2021年8月3日 至2022年6月 日任汇添富核心 精选灵活配置流
日至 2020 年 7 月 8 日任汇添富 中债 1-3 年农发 行债券指数证券 投资基金的基金 经理。2020 年 1 月 14 日至 2025 年 8 月 28 日任 汇添富中债 7-1 年国开行债券指 数证券投资基金 的基金经理。 2021 年 8 月 3 日 至 2022 年 6 月 日任汇添富核心 精选灵活配置编
月8日任汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年1月14日至2025年8月28日任汇添富中债7-1年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置流
中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020 年 5 月 14 日至 2025 年 8 月 28 日任汇添富中债 7-1 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 3 日至 2022 年 6 月日任汇添富核心精选灵活配置流
行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年1月14日至2025年8月28日任汇添富中债7-1年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置指
投资基金的基金经理。2020年1月14日至2025年8月28日任 1月14日至2025年8月28日任 汇添富中债7-1年国开行债券指 数证券投资基金的基金经理。 2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心 精选灵活配置指
经理。2020年3月14日至2025年8月28日任 汇添富中债7-1年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。 2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置指
月 14 日至 2025 年 8 月 28 日任 汇添富中债 7-1 年国开行债券指 数证券投资基金 的基金经理。 2021 年 8 月 3 日 至 2022 年 6 月 日任汇添富核心 精选灵活配置派
年8月28日任 汇添富中债7-1 年国开行债券指 数证券投资基金 的基金经理。 2021年8月3日 至2022年6月 日任汇添富核心 精选灵活配置海
汇添富中债 7-1 年国开行债券指 数证券投资基金 的基金经理。 2021 年 8 月 3 日 至 2022 年 6 月 日任汇添富核心 精选灵活配置海
年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。 2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置指
数证券投资基金的基金经理。 2021年8月3日至2022年6月日任汇添富核心精选灵活配置海
的基金经理。 2021 年 8 月 3 日 至 2022 年 6 月 日任汇添富核心 精选灵活配置海
2021 年 8 月 3 日 至 2022 年 6 月 日任汇添富核心 精选灵活配置海
至 2022 年 6 月 日任汇添富核心 精选灵活配置海
日任汇添富核心     精选灵活配置指
精选灵活配置海
△刑:工 <b>坐</b> 机次目
金(LOF)的基
金经理。2021年
8月17日至
2022年11月4
日任汇添富鑫和
定期开放债券型
发起式证券投资
基金的基金经
理。2021年10
月 11 日至 2022
年11月4日任
11 万 ¥ 口位   11 万 ¥ 口位   12 添富鑫成定期
开放债券型发起 1.47.75.45.25.25.25.25.25.25.25.25.25.25.25.25.25
式证券投资基金
的基金经理。
2021 年 10 月 15
日至 2025 年 8
月 28 日任汇添
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

1	1	
		理。2022年4月
		29 日至 2025 年
		8月28日任汇添
		富利率债债券型
		证券投资基金的
		基金经理。2022
		年6月9日至
		2025年8月28
		日任汇添富中短
		债债券型证券投
		资基金的基金经
		理。2022年11
		月9日至2025
		年 8 月 28 日任
		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。
		2022年11月30
		日至 2025 年 9
		月2日任汇添富
		鑫润纯债债券型
		证券投资基金的
		基金经理。2022
		年12月7日至
		2025年8月28
		日任汇添富鑫悦
		<b>纯债债券型证券</b>
		投资基金的基金
		经理。2023年1
		月 17 日至 2025
		年 8 月 28 日任
		汇添富丰和纯债
		债券型证券投资
		基金的基金经
		理。2023年8月
		30 日至 2025 年
		8月28日任汇添
		富稳裕 30 天滚
		动持有债券型证
		券投资基金的基
		会经理。 金经理。
		亚江土。

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內遵守《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。
- 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中的公平交易模块,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 0。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

三季度,债市呈现下跌行情,收益率震荡上行,信用利差走阔,收益率曲线陡峭化。权益市场的持续上涨带动风险偏好抬升,债券市场进一步修复此前的超涨部分。从中期维度来看,国内反内卷的持续推进已将此前市场的通缩预期扭转,接下来关注通胀数据的演变。同时,投资者需要警惕海外与国内宽财政的共振影响。报告期内,组合紧密跟踪市场动向,灵活调节杠杆、久期水平,同时注意控制回撤风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 0.12%。同期业绩比较基准收益率为-1.39%。

#### 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	2, 440, 048, 892. 78	99. 62
	其中:债券	2, 440, 048, 892. 78	99. 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	9, 098, 813. 02	0.37
8	其他资产	183, 576. 76	0.01
9	合计	2, 449, 331, 282. 56	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	16, 231, 791. 78	0.71
2	央行票据	_	-
3	金融债券	2, 423, 817, 101. 00	106. 42
	其中: 政策性金融债	2, 423, 817, 101. 00	106. 42
4	企业债券	_	-
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	2, 440, 048, 892. 78	107. 13

## 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	09240203	24 国 开清发 03	2, 500, 000	250, 957, 534. 25	11.02
2	09240432	24 农 发清发 32	2,000,000	202, 756, 164. 38	8. 90
3	220305	22 进 出 05	1, 500, 000	154, 464, 328. 77	6. 78
4	09240402	24 农 发清发 02	1,500,000	152, 137, 808. 22	6. 68
5	09250402	25 农 发清发 02	1, 500, 000	150, 857, 013. 70	6. 62

# 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、中国农业发展银行、中国进出口银行出现在报告编制目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	应收申购款	183, 576. 76
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	183, 576. 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: 本基金本报告期末未持有股票。

## §6开放式基金份额变动

单位: 份

本报告期期初基金份额总额	2, 404, 758, 991. 71
本报告期基金总申购份额	313, 597, 202. 33
减:本报告期基金总赎回份额	550, 002, 553. 16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2, 168, 353, 640. 88

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未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未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

		报告期	内持有基金份额变化情况			报告期末持有基金情况	
		持有基					
		金份额					
投资		比例达			赎回 份额	持有份额	份额占 比(%)
者类	序号	到或者	期初份额	申购			
别	11. 3	超过		份额			
		20%的					
		时间区					
		间					
		2025					
	1	年8月	477, 736, 480. 03				
机构		18 日		-	_	477, 736, 480. 03	22.03
		至					
		2025					
		年9月					

Г		J			
		30 H			
		90 H			

#### 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。

#### 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理财7天债券型证券投资基金募集的文件:
- 2、《汇添富利率债债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富利率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、报告期内汇添富利率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 2025年10月28日