

# 汇添富鑫瑞债券型证券投资基金 2021 年年度 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 29 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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 .....                         | 5  |
| 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、基金净值表现及利润分配情况 .....                | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....                       | 12 |
| § 4 管理人报告 .....                               | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 17 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 17 |
| 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 .....             | 19 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 19 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....                 | 20 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 21 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 21 |
| 4.9 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 .....       | 22 |
| § 5 托管人报告 .....                               | 22 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 22 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 22 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....      | 22 |
| § 6 审计报告 .....                                | 22 |
| 6.1 审计报告的基本信息 .....                           | 22 |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                           | 23 |
| § 7 年度财务报表 .....                              | 24 |
| 7.1 资产负债表 .....                               | 24 |
| 7.2 利润表 .....                                 | 26 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 27 |
| 7.4 报表附注 .....                                | 28 |
| § 8 投资组合报告 .....                              | 62 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 62 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 62 |
| 8.3 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 .....         | 63 |

|  |    |
|--|----|
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 63 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 63 |
| 8.6 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.....    | 63 |
| 8.7 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..... | 64 |
| 8.8 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..... | 64 |
| 8.9 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.....    | 64 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 64 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 64 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                         | 65 |
| § 9 基金份额持有人信息 .....                        | 65 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 65 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 66 |
| 9.3 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.....      | 66 |
| § 10 开放式基金份额变动 .....                       | 67 |
| § 11 重大事件揭示 .....                          | 67 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 67 |
| 11.2 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.....      | 67 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 67 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                        | 68 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 68 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 68 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 68 |
| 11.8 其他重大事件.....                           | 70 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 72 |
| 12.1 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.....   | 72 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 74 |
| § 13 备查文件目录 .....                          | 74 |
| 13.1 备查文件目录.....                           | 74 |
| 13.2 存放地点 .....                            | 74 |
| 13.3 查阅方式 .....                            | 74 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                        |                  |           |
|------------------------|------------------|-----------|
| 基金名称                   | 汇添富鑫瑞债券型证券投资基金   |           |
| 基金简称                   | 汇添富鑫瑞债券          |           |
| 基金主代码                  | 004089           |           |
| 基金运作方式                 | 契约型开放式           |           |
| 基金合同生效日                | 2016 年 12 月 26 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   |           |
| 报告期末基金份额总额<br>(份)      | 1,045,384,459.27 |           |
| 基金合同存续期                | 不定期              |           |
| 下属分级基金的基金简称            | 汇添富鑫瑞债券 A        | 汇添富鑫瑞债券 C |
| 下属分级基金的交易代码            | 004089           | 004090    |
| 报告期末下属分级基金的<br>份额总额(份) | 1,045,379,379.34 | 5,079.93  |

### 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。本基金的投资策略还包括：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。 |
| 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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |

|             |      |                             |                  |
|-------------|------|-----------------------------|------------------|
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                          | 胡波               |
|             | 联系电话 | 021-28932888                | 021-61618888     |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com          | Hub5@spdb.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918                | 95528            |
| 传真          |      | 021-28932998                | 021-63602540     |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室 | 上海市中山东一路12号      |
| 办公地址        |      | 上海市黄浦区外马路728号               | 上海市北京东路689号      |
| 邮政编码        |      | 200010                      | 200001           |
| 法定代表人       |      | 李文                          | 郑杨               |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》                     |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com              |
| 基金年度报告备置地点          | 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                    |
|--------|--------------------|-------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1<br>期间数据和指标 | 2021年         |          | 2020年         |          | 2019年          |          |
|------------------|---------------|----------|---------------|----------|----------------|----------|
|                  | 汇添富鑫瑞债券A      | 汇添富鑫瑞债券C | 汇添富鑫瑞债券A      | 汇添富鑫瑞债券C | 汇添富鑫瑞债券A       | 汇添富鑫瑞债券C |
| 本期已实             | 19,986,102.44 | 79.10    | 52,088,765.13 | 21.05    | 188,302,148.65 | 42.46    |

|               |                  |          |                |          |                  |          |
|---------------|------------------|----------|----------------|----------|------------------|----------|
| 现收益           |                  |          |                |          |                  |          |
| 本期利润          | 19,691,502.81    | 75.37    | 29,097,386.47  | 21.78    | 180,728,203.83   | 41.81    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0359           | 0.0400   | 0.0105         | 0.0189   | 0.0356           | 0.0344   |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.47%            | 3.79%    | 1.01%          | 1.81%    | 3.45%            | 3.27%    |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.51%            | 3.10%    | 1.82%          | 1.50%    | 3.54%            | 3.30%    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末          |          | 2020 年末        |          | 2019 年末          |          |
| 期末可供分配利润      | 55,636,015.27    | 352.79   | 3,436,333.12   | 27.62    | 141,676,784.50   | 63.70    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0532           | 0.0694   | 0.0050         | 0.0249   | 0.0295           | 0.0523   |
| 期末基金资产净值      | 1,101,015,394.61 | 5,432.72 | 697,659,885.33 | 1,152.32 | 5,001,470,445.30 | 1,297.63 |
| 期末基金份额        | 1.0532           | 1.0694   | 1.0175         | 1.0372   | 1.0431           | 1.0657   |

|              |         |        |         |        |         |        |
|--------------|---------|--------|---------|--------|---------|--------|
| 净值           |         |        |         |        |         |        |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021 年末 |        | 2020 年末 |        | 2019 年末 |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 19.38%  | 16.55% | 15.33%  | 13.04% | 13.27%  | 11.37% |

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（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

| 汇添富鑫瑞债券 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     | 1.22%    | 0.03%       | 0.60%      | 0.05%         | 0.62%  | -0.02% |
| 过去六个月     | 2.00%    | 0.04%       | 1.44%      | 0.05%         | 0.56%  | -0.01% |
| 过去一年      | 3.51%    | 0.04%       | 2.10%      | 0.05%         | 1.41%  | -0.01% |
| 过去三年      | 9.13%    | 0.07%       | 3.37%      | 0.07%         | 5.76%  | 0.00%  |
| 过去五年      | 19.31%   | 0.06%       | 4.65%      | 0.07%         | 14.66% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起 | 19.38%   | 0.06%       | 5.21%      | 0.07%         | 14.17% | -0.01% |



| 汇添富鑫瑞债券 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       | 1.12%    | 0.02%       | 0.60%      | 0.05%         | 0.52%  | -0.03% |
| 过去六个月       | 1.75%    | 0.04%       | 1.44%      | 0.05%         | 0.31%  | -0.01% |
| 过去一年        | 3.10%    | 0.04%       | 2.10%      | 0.05%         | 1.00%  | -0.01% |
| 过去三年        | 8.11%    | 0.07%       | 3.37%      | 0.07%         | 4.74%  | 0.00%  |
| 过去五年        | 16.49%   | 0.06%       | 4.65%      | 0.07%         | 11.84% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至今 | 16.55%   | 0.06%       | 5.21%      | 0.07%         | 11.34% | -0.01% |

### 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

汇添富鑫瑞债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



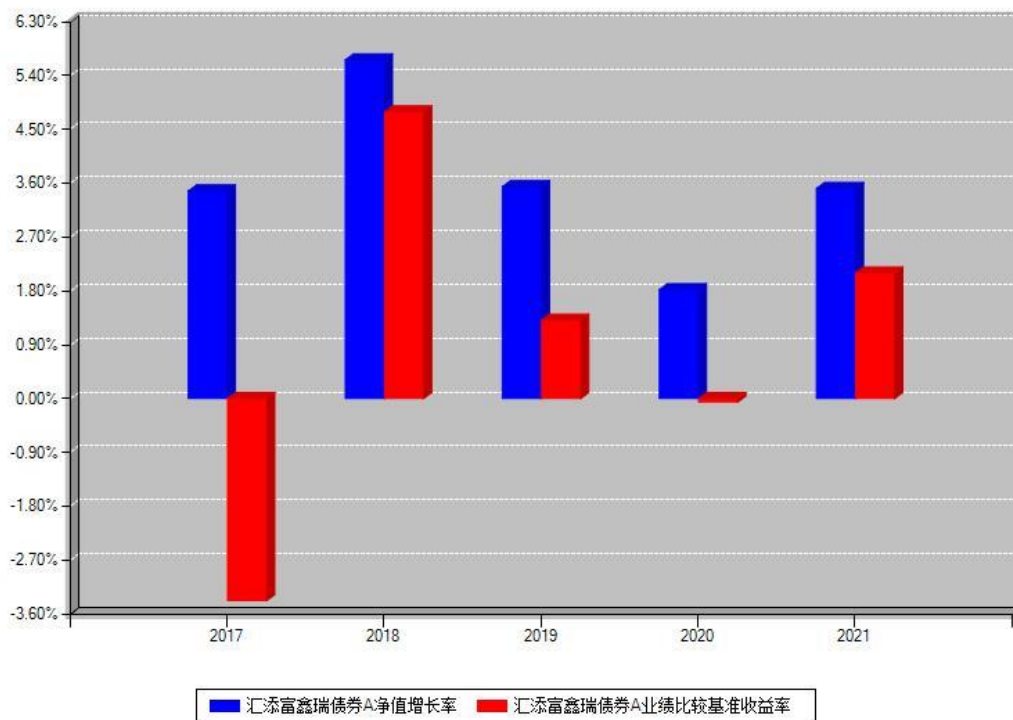
汇添富鑫瑞债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



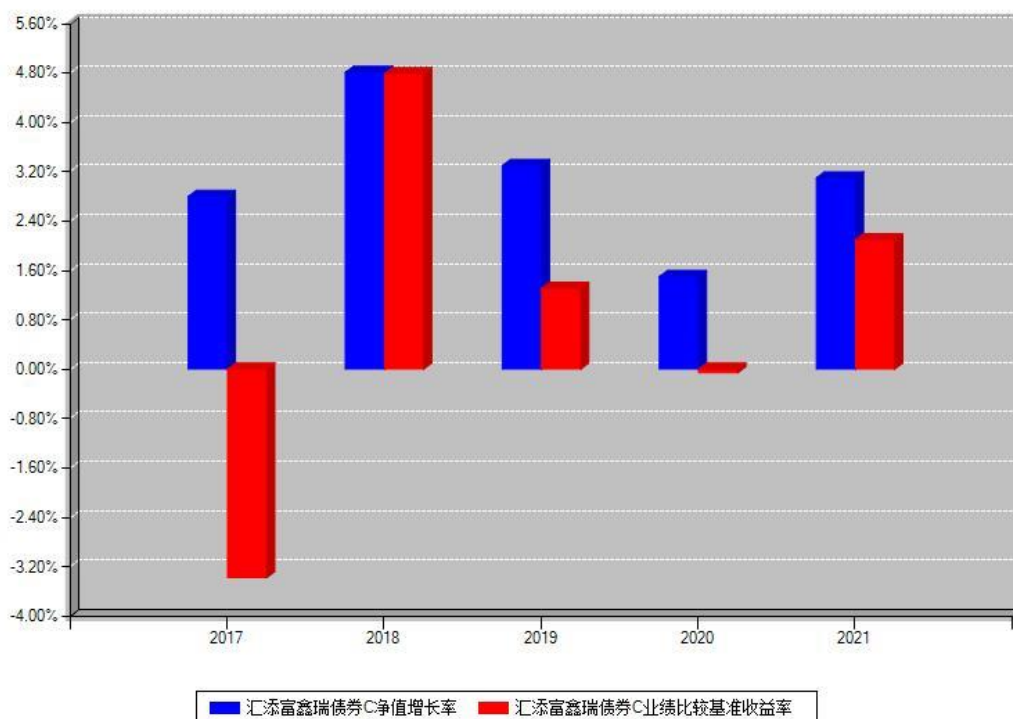
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年12月26日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富鑫瑞债券A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富鑫瑞债券C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2016 年 12 月 26 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 汇添富鑫瑞债券 A |                       |                |               |                |    |
|-----------|-----------------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 年度        | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发<br>放总额 | 本期利润分配合计       | 备注 |
| 2021 年    | 0.0000                | 0.00           | 0.00          | 0.00           | -  |
| 2020 年    | 0.4500                | 172,964,135.84 | 24.76         | 172,964,160.60 | -  |
| 2019 年    | 0.5000                | 253,923,824.63 | 571,616.68    | 254,495,441.31 | -  |
| 合计        | 0.9500                | 426,887,960.47 | 571,641.44    | 427,459,601.91 | -  |
| 汇添富鑫瑞债券 C |                       |                |               |                |    |
| 年度        | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发<br>放总额 | 本期利润分配合计       | 备注 |
| 2021 年    | 0.0000                | 0.00           | 0.00          | 0.00           | -  |
| 2020 年    | 0.4500                | 45.16          | 4.70          | 49.86          | -  |
| 2019 年    | 0.1000                | 10.94          | 1.04          | 11.98          | -  |
| 合计        | 0.5500                | 56.10          | 5.74          | 61.84          | -  |

## § 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。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、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2021 年，汇添富基金荣获“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。

2021 年，汇添富基金新成立 58 只公募基金，包括 31 只混合型基金，21 只股票型基金，6 只债券型基金。2021 年底，公司公募基金产品总数达 226 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2021 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。业内开创性地打造基于社区的大社交板块，涵盖视频、直播、资讯等各个维度，为客户架设可链接的投资及资讯服务桥梁；推出包括资产分析、基金转购、亲情宝等在内的多个重磅功能，全方面提升客户体验。汇添富基金于年内取得投顾资格，展业后着力打造全自研的投顾体系，引导客户升级，上线一个月以来升级金额超十亿元，为公司业务拓展打下坚实的基础。全年自有平台精准营销体系初见成效，实现了客户数、活跃度、保有量的齐头并进，力争形成长期增长的良好循环。对外合作上，进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作，继续大力开拓新型互联网销售及服务模式，实现与平台的合作共赢。

2021 年，汇添富基金持续推进大机构战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任：与银行理财公司合作深入，为银行理财净值化转型提供综合解决方案；获得所有大型银行及保险委外专户组合，且保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模、受托管理组合账户数量持续增加。

2021 年，公司以具有长久生命力、高辨识度的多策略产品体系为基础，通过“前瞻性”、“多层次”、“体系化”、“全方位”的渠道服务和投资者教育，积极利用银行以及券商线上化数字营销工具，力争切实做好客户触达、深入织好连接网络、扎实做好客户服务。全年合计开展超 4000 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。持续大力开展目标收益定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动，营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2021 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2021 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式继续深化，并发挥显著成效，国际业务总资产管理规模稳步进步，QDII 及港股通项下公募基金业绩优秀，“港

股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2021年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星五星评级；根据彭博统计，基金在最近三年、五年同类港股基金中业绩分别列第三、第一位。

2021年，汇添富基金全力助推“共同富裕”，深耕“河流·孩子”项目支持中西部乡村教育发展，投身农业升级、旅游扶持、人才培育等项目赋能乡村全面振兴；同时，在河南、山西灾情发生后第一时间支援灾区抢险防汛、重建家园。在乡村教育发展方面，汇添富连续第十四年开展“河流·孩子”公益助学计划，项目组在做好疫情防护的同时积极邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”提供公益服务，并顺利开展第十四届“河流·孩子”2021乡村优秀青年教师培训，邀请不同领域的专家为来沪的88名乡村青年教师和校长们讲授多元化课程。截至目前，“河流·孩子”项目先后援建10所“添富小学”，培训乡村教师、校长超1,400人次，受益学生超10,000名，累计组织80多场“添富之爱”公益行，1,000多人次志愿者提供公益服务3万多小时。在乡村产业振兴方面，汇添富先后在汾西县开展建档立卡贫困学生资助项目，支持内蒙古兴和县开展乡村旅游扶贫项目和返乡青年创业发展特色种植业项目，捐助云南省普洱市孟连县芒信镇海东村开展“千户万头”肉牛养殖场示范产业项目基础设施建设，为推动当地产业脱贫而不懈努力。在应急救援方面，2021年7月，汇添富第一时间捐赠300万元人民币紧急驰援河南特大水灾，全力支持鹤壁、新乡等灾区抢险救灾工作；2021年10月，汇添富再次迅速展开山西水灾支援工作，紧急筹措了6000多件总价值100万元的救援物资和生活物资，连夜送至山西省临汾市、晋中市、运城市14个汛情重灾县的最前线；同时向孝义市捐赠100万元，帮助受灾地区群众尽快恢复正常生活，以及灾区灾后重建、生产恢复、防疫消杀等工作。

2022年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

#### 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 |           |                       |
| 刘通 | 本基金的基金经理 | 2020年03月23日     |      | 10        | 国籍：中国。<br>学历：浙江大学金融学硕 |

|    |                    |                  |  |    |  |
|----|--------------------|------------------|--|----|--|
|    |                    |                  |  |    | <p>士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 7 月至 2015 年 8 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益分析师，2015 年 8 月至 2019 年 7 月任汇添富基金管理股份有限公司专户投资经理。2020 年 3 月 23 日至今任汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 23 日至今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。2020 年 4 月 1 日至今任汇添富多策略纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 宋鹏 | 本基金的基金经理, 养老金投资部总监 | 2021 年 08 月 26 日 |  | 15 | <p>国籍：中国。学历：复旦大学金融工程硕士。从业资格：证券投资</p>   |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>基金从业资格, 特许金融分析师 CFA。</p> <p>从业经历:</p> <p>2006 年 7 月至 2007 年 10 月任招商基金固收研究员, 2007 年 11 月至 2011 年 2 月任摩根大通研究部策略分析师, 2011 年 2 月至 2019 年 5 月历任平安资产管理公司固收投资部投资经理、部门总经理。2019 年 5 月至今任汇添富基金养老金投资部总监。</p> <p>2021 年 8 月 26 日至今任汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 11 日至今任汇添富稳健睿享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 20 日至今任汇添富稳鑫 120 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 23 日至今任汇添富</p> |
|--|--|--|--|--|---|



|  |  |  |  |  |                     |
|--|--|--|--|--|---------------------|
|  |  |  |  |  | 双享回报债券型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------|

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。

#### 4.1.3 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,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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系,覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合;涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:(1)在研究分析环节,公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。(2)在投资决策环节,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限,合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外,公司

还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离,且不能互相授权投资事宜。(3)在交易执行环节,本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门,实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易,内部制定了相应的交易管理规则,保证各投资组合获得公平的交易执行机会;对于银行间市场的现券、回购等场外交易,交易部在交易市场开展独立、公平的询价,确保交易得到公平执行;对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保公平对待各投资组合。(4)在日常监控环节,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5)在报告分析环节,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估,并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 29 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 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

2021 年一季度国内经济的环比动能有所放缓,核心在于信用冲量的放缓,同时也是海外耐用品消费向服务消费转换的间歇期。数据上财新 PMI 连续 4 个月下行,也能证明环比动能的放缓。央行整体上维持了中性的货币政策,除 1 月中下旬资金有所波动外,资金面相对宽松。一季度信用事件导致市场情绪对信用风险相对谨慎。在资金稳定,环比动能略有放缓,信用偏好降低的情况下,中短久期的优质信用债成为市场的主流品种。二季度资金是影响市场的主旋律,尽管 PPI 处于连续上行态势,全球通胀预期升温,但是央行维持了资金的相对宽松格局,核心原因可能在于经济复苏的不平衡性导致 PPI 和核心 CPI 大幅背离,叠加上半年经济的环比动能放缓,导致央行收紧的必要性降低。在资金宽松的影响下,债券收益率维持了区间震荡,信用利差收缩。三季度债券波动加大。7 月降准后,市场改变了此前略偏谨慎的态度,收益率大幅下行,10 年国债收益率重回 3%以下的水平。但 8、9 月,大宗商品加速上行,市场对债券由乐观转为中性甚至略偏谨慎,债券收益率震荡上行。四季度债券市场呈现分化态势。以部分地产债为代表的偏弱资质的债券在四季度经历了较大幅度的下跌,而以利率债为代表的资质较好的债券价格则呈现普涨状态。四季度地产销售偏弱,部分地产公司出现信用事件,使得市场对基本面的预期转弱,引发了债券市场的分化。报告期内,组合在上半年维持了中性略偏长的久期,从三季度考虑到基本面的环境相对更明确,逐步开始拉长组合久期。

##### 4.4.2 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 3.51%;C 类基金份额净值增长率为 3.10%。同期业绩比较基准收益率为 2.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

稳增长是 2022 年的重要议题,因此财政前置和信用宽松成为一致预期,但资产的走势通常很难完全按照一致预期进行演化。回看历史的路径,信用宽松主要伴随地产的走强以及城投公司资产负债表的扩张,信用宽松的节奏一般较快,数据的反馈迅速,资产价格和宽信用的预期有较强的相关关系。对 2022 年的一致预期中,市场也多数参考历史的路径来跟踪

和审视相关数据。但我们认为，本轮的节奏和路径较以往有较大的区别。首先，地产有别于过去几轮周期都是快速反弹，本轮地产可能将以缓慢修复的行态出现，在信用贡献上难以出现脉冲式的冲高。我们认为地产行业的模式可能出现逐步转变，由以前的本质是资金业务转变为真正的制造业，对信用扩张的乘数效应本身就是一种限制，同时节奏上也不是以往大开大合的状态。其次，隐性债务的控制也会使得城投公司的资产负债表扩张变得有序。同时我们看到，本轮央行对绿色信贷等为主的贷款给予了大力支持，体现在信用扩张的主体上以制造业为主，本身会充分兼顾盈利以及行业协同，也是一种逐步向上的信用扩张模式。因此，我们本轮将看到缓步上行的宽信用而非过去的快节奏宽信用。对应到资产价格上，债券过去在宽信用的初期长债就会有所压力，而缓步向上的宽信用节奏，将促使债券更多呈现震荡的形式，而非过去大波动走势。同时，考虑到高增速向高质量经济增长的过度，债券长期也会呈现低波低收益率的状态。综上，我们认为 2022 年债券更多可能呈现低波震荡的格局。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规法务管理

深入践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，持续宣导“正直”、“客户第一”的公司价值观，不断强化公司合规文化体系建设；持续完善各项制度和流程，制定多项合规审核标准，形成多项合规管理指引，对重点业务流程实施关键风险把控，有效保障各项业务规范开展；积极为各部门提供全面的合规咨询与法务支持，加强一线合规执行；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；严格执行合规考核问责机制，认真组织和落实合规培训，不断提升全体员工的合规执业意识及合规履职能力。

##### 2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易

情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

### 3、加强稽核内审工作

通过开展日常风险排查，以及对重点业务开展专项稽核检查，尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患，并采取防范措施，督促责任部门落实整改；对风险事件和差错事件开展稽核审查，加强问责力度，促进业务合法合规开展；实施关键岗位离任审查，督促人员勤勉尽责、合规展业；配合监管检查与会计师事务所审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，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，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

## 4.8 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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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相应类别的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该类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。

#### 4.9 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本信息

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                            |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                      |
| 审计报告编号     | 安永华明（2022）审字第 60466941_B73 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

|                 |  |
|-----------------|--|
| 审计报告标题          | 审计报告   |
| 审计报告收件人         | 汇添富鑫瑞债券型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>我们审计了汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富鑫瑞债券型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>  |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富鑫瑞债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>   |
| 强调事项            | 不适用  |
| 其他事项            | 不适用  |
| 其他信息            | <p>汇添富鑫瑞债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>  |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大</p>  |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富鑫瑞债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富鑫瑞债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  |
| 注册会计师的姓名  | 许培菁   韩云  |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层   |
| 审计报告日期    | 2022年03月29日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富鑫瑞债券型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 21,013,375.35      | 338,157.65          |



|               |          |                    |                     |
|---------------|----------|--------------------|---------------------|
| 结算备付金         |          | 17,745,788.55      | 2,285,714.29        |
| 存出保证金         |          | 13,564.70          | -                   |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2  | 1,429,463,327.70   | 922,302,000.00      |
| 其中：股票投资       |          | -                  | -                   |
| 基金投资          |          | -                  | -                   |
| 债券投资          |          | 1,419,451,327.70   | 922,302,000.00      |
| 资产支持证券投资      |          | 10,012,000.00      | -                   |
| 贵金属投资         |          | -                  | -                   |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3  | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4  | -                  | -                   |
| 应收证券清算款       |          | -                  | -                   |
| 应收利息          | 7.4.7.5  | 18,863,972.54      | 13,269,052.54       |
| 应收股利          |          | -                  | -                   |
| 应收申购款         |          | 77,713.12          | -                   |
| 递延所得税资产       |          | -                  | -                   |
| 其他资产          | 7.4.7.6  | -                  | -                   |
| 资产总计          |          | 1,487,177,741.96   | 938,194,924.48      |
| 负债和所有者权益      | 附注号      | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
| <b>负 债：</b>   |          |                    |                     |
| 短期借款          |          | -                  | -                   |
| 交易性金融负债       |          | -                  | -                   |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3  | -                  | -                   |
| 卖出回购金融资产款     |          | 366,499,255.00     | 239,999,440.00      |
| 应付证券清算款       |          | 18,752,138.71      | -                   |
| 应付赎回款         |          | 12,578.25          | -                   |
| 应付管理人报酬       |          | 255,334.27         | 176,206.60          |
| 应付托管费         |          | 42,555.72          | 58,735.54           |
| 应付销售服务费       |          | 1.63               | 0.31                |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 23,394.33          | 12,389.86           |
| 应交税费          |          | 99,571.35          | -                   |
| 应付利息          |          | 272,085.37         | 87,114.52           |
| 应付利润          |          | -                  | -                   |
| 递延所得税负债       |          | -                  | -                   |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 200,000.00         | 200,000.00          |
| 负债合计          |          | 386,156,914.63     | 240,533,886.83      |
| <b>所有者权益：</b> |          |                    |                     |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 1,045,384,459.27   | 685,647,811.73      |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 55,636,368.06      | 12,013,225.92       |
| 所有者权益合计       |          | 1,101,020,827.33   | 697,661,037.65      |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,487,177,741.96   | 938,194,924.48      |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,045,384,459.27 份。本基金下属 A 类

基金份额净值 1.0532 元，基金份额总额 1,045,379,379.34 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.0694 元，基金份额总额 5,079.93 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富鑫瑞债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2021 年 01 月 01 日<br>至 2021 年 12 月 31<br>日 | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01<br>日至 2020 年 12<br>月 31 日 |
|------------------------|------------|---|---|
| <b>一、收入</b>            |            | <b>24,699,429.31</b>                            | <b>47,368,571.07</b>                                |
| 1. 利息收入                |            | 21,634,709.34                                   | 99,639,410.76                                       |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 173,919.00                                      | 680,062.55  |
| 债券利息收入                 |            | 21,394,794.40                                   | 98,785,750.24                                       |
| 资产支持证券利息收入             |            | 46,031.48                                       | -   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 19,964.46                                       | 173,597.97  |
| 证券出借利息收入               |            | -   | -   |
| 其他利息收入                 |            | -   | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 3,339,128.12                                    | -29,279,462.07                                      |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -   | -   |
| 基金投资收益                 | 7.4.7.13   | -   | -   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.14   | 3,302,477.64                                    | -29,279,462.07                                      |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.14.2 | -   | -   |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.15   | -   | -   |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.16   | 36,650.48                                       | -   |
| 股利收益                   | 7.4.7.17   | -   | -   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -294,603.36                                     | -22,991,377.93                                      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19   | 20,195.21                                       | 0.31  |
| <b>减：二、费用</b>          |            | <b>5,007,851.13</b>                             | <b>18,271,162.82</b>                                |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 1,723,385.48                                    | 8,712,453.53  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 470,021.57                                      | 2,904,151.23  |
| 3. 销售服务费               |            | 6.90  | 3.66  |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.20   | 45,458.03                                       | 83,050.00   |
| 5. 利息支出                |            | 2,478,048.71                                    | 6,321,014.02  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 2,478,048.71                                    | 6,321,014.02  |
| 6. 税金及附加               |            | 31,347.32                                       | -   |
| 7. 其他费用                | 7.4.7.21   | 259,583.12                                      | 250,490.38  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b> |            | <b>19,691,578.18</b>                            | <b>29,097,408.25</b>                                |

|                   |  |               |               |
|-------------------|--|---------------|---------------|
| 号填列)              |  |               |               |
| 减：所得税费用           |  | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 19,691,578.18 | 29,097,408.25 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富鑫瑞债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日      |                |                  |
|--|---|----------------|------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 685,647,811.73                                | 12,013,225.92  | 697,661,037.65   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 19,691,578.18  | 19,691,578.18    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 359,736,647.54                                | 23,931,563.96  | 383,668,211.50   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,195,013,682.54                              | 51,298,947.68  | 1,246,312,630.22 |
| 2. 基金赎回款                               | -835,277,035.00                               | -27,367,383.72 | -862,644,418.72  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -   | -              | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,045,384,459.27                              | 55,636,368.06  | 1,101,020,827.33 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |                |                  |
|  | 实收基金  | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 4,794,673,772.05                              | 206,797,970.88 | 5,001,471,742.93 |
| 二、本期经营活动产生的基金净                         | -   | 29,097,408.25  | 29,097,408.25    |

|  |                   |                 |                   |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|
| 值变动数（本期利润）                             |                   |                 |                   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -4,109,025,960.32 | -50,917,942.75  | -4,159,943,903.07 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 494,468,039.97    | 5,537,995.95    | 500,006,035.92    |
| 2. 基金赎回款                               | -4,603,494,000.29 | -56,455,938.70  | -4,659,949,938.99 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                 | -172,964,210.46 | -172,964,210.46   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 685,647,811.73    | 12,013,225.92   | 697,661,037.65    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| <u>张晖</u> | <u>李骁</u> | <u>雷青松</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富鑫瑞债券型证券投资基金（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[2015]2819号文《关于准予汇添富鑫瑞债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2016年12月26日正式生效，首次设立募集规模为200,422,613.81份基金份额。本基金为契约型开放式，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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、可转换债券、可交换公司债券、可分离

交易债券、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款等固定收益类品种，国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

#### 7.4.2 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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》、《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益

的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资和资产支持证券投资等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券和资产支持证券，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

### (4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

### (6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

## 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最小层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变



动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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相应类别的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；

(3) 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该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》

的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 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暂行条例（2011 年修订）》、《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）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《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。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税的通知》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 号文《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 号文《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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末              | 上年度末             |
|----------------|------------------|------------------|
|                | 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
| 活期存款           | 21,013,375.35    | 338,157.65       |
| 定期存款           | -                | -                |
| 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           | -                | -                |
| 合计             | 21,013,375.35    | 338,157.65       |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末              |                  |                  |              |
|---------------|------------------|------------------|------------------|--------------|
|               | 2021 年 12 月 31 日 |                  |                  |              |
|               | 成本               | 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            | 378,062,871.68   | 377,573,227.70   | -489,643.98  |
|               | 银行间市场            | 1,038,902,032.26 | 1,041,878,100.00 | 2,976,067.74 |
|               | 其他               | -                | -                | -            |
|               | 合计               | 1,416,964,903.94 | 1,419,451,327.70 | 2,486,423.76 |
| 资产支持证券        | 10,000,000.00    | 10,012,000.00    | 12,000.00        |              |
| 基金            | -                | -                | -                |              |
| 其他            | -                | -                | -                |              |
| 合计            | 1,426,964,903.94 | 1,429,463,327.70 | 2,498,423.76     |              |

| 项目            | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                |                |
|---------------|--------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                       | 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                    | -              | -              |
|               | 银行间市场                    | 919,508,972.88 | 922,302,000.00 |
|               | 其他                       | -              | -              |
|               | 合计                       | 919,508,972.88 | 922,302,000.00 |
| 资产支持证券        | -                        | -              | -              |
| 基金            | -                        | -              | -              |
| 其他            | -                        | -              | -              |
| 合计            | 919,508,972.88           | 922,302,000.00 | 2,793,027.12   |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 754.60                  | 81.05                    |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 8,784.05                | 1,131.46                 |
| 应收债券利息     | 18,807,014.58           | 13,267,840.03            |
| 应收资产支持证券利息 | 47,412.60               | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 应收出借证券利息   | -                       | -                        |
| 其他         | 6.71                    | -                        |
| 合计         | 18,863,972.54           | 13,269,052.54            |

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 23,394.33          | 12,389.86           |
| 合计          | 23,394.33          | 12,389.86           |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31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    | -                  | -                   |
| 应付审计费        | 80,000.00          | 80,000.00           |
| 应付信息披露费      | 120,000.00         | 120,000.00          |
| 应付指数使用费      | -                  | -                   |
| 应付账户维护费      | -                  | -                   |
| 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 | -                  | -                   |
| 其他           | -                  | -                   |
| 合计           | 200,000.00         | 200,000.00          |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 汇添富鑫瑞债券 A     |                                       |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| 项目            | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日 |                  |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 685,646,700.76                        | 685,646,700.76   |
| 本期申购          | 1,195,001,349.89                      | 1,195,001,349.89 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -835,268,671.31                       | -835,268,671.31  |
| 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           | 1,045,379,379.34                      | 1,045,379,379.34 |
| 汇添富鑫瑞债券 C     |                                       |                  |
| 项目            | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日 |                  |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,110.97                              | 1,110.97         |
| 本期申购          | 12,332.65                             | 12,332.65        |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,363.69                             | -8,363.69        |
| 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           | 5,079.93                              | 5,079.93         |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 汇添富鑫瑞债券 A      |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 3,436,333.12   | 8,576,851.45   | 12,013,184.57  |
| 本期利润           | 19,986,102.44  | -294,599.63    | 19,691,502.81  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 37,273,587.10  | -13,342,259.21 | 23,931,327.89  |
| 其中：基金申购款       | 58,674,106.37  | -7,375,930.41  | 51,298,175.96  |
| 基金赎回款          | -21,400,519.27 | -5,966,328.80  | -27,366,848.07 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 60,696,022.66  | -5,060,007.39  | 55,636,015.27  |
| 汇添富鑫瑞债券 C      |                |                |                |
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 27.62          | 13.73          | 41.35          |
| 本期利润           | 79.10          | -3.73          | 75.37          |



|                |         |        |         |
|----------------|---------|--------|---------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 273.41  | -37.34 | 236.07  |
| 其中：基金申购款       | 871.62  | -99.90 | 771.72  |
| 基金赎回款          | -598.21 | 62.56  | -535.65 |
| 本期已分配利润        | -       | -      | -       |
| 本期末            | 380.13  | -27.34 | 352.79  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 107,490.53                        | 674,001.46                             |
| 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 | 66,375.52                         | 6,061.09                               |
| 其他        | 52.95                             | -                                      |
| 合计        | 173,919.00                        | 680,062.55                             |

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|------------------------|-----------------------------------|--|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,476,083,444.78                  | 9,724,222,782.37                       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,438,667,737.77                  | 9,588,292,302.07                       |
| 减：应收利息总额               | 34,113,229.37                     | 165,209,942.37                         |
| 买卖债券差价收入               | 3,302,477.64                      | -29,279,462.07                         |

**7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金无衍生工具买卖权证差价收入。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

| 项目       | 本期收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间收益金额 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|----------|---|--|
| 国债期货投资收益 | 36,650.48                                 | -  |
| 股指期货投资收益 | -   | -  |
| 外汇期货投资收益 | -   | -  |
| 外汇远期投资收益 | -   | -  |

**7.4.7.17 股利收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称             | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产       | -294,603.36                           | -22,991,377.93                             |
| ——股票投资           | -                                     | -  |
| ——债券投资           | -306,603.36                           | -22,991,377.93                             |
| ——资产支持证券投资       | 12,000.00                             | -  |
| ——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     | -294,603.36 | -22,991,377.93 |

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|---------|-------------------------|-------------------------|
|         | 2021年01月01日至2021年12月31日 | 2020年01月01日至2020年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 20,195.21               | 0.31                    |
| 替代损益    | -                       | -                       |
| 其他      | -                       | -                       |
| 合计      | 20,195.21               | 0.31                    |

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
|           | 2021年01月01日至2021年12月31日 | 2020年01月01日至2020年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,225.53                | -                       |
| 银行间市场交易费用 | 44,232.50               | 83,050.00               |
| 合计        | 45,458.03               | 83,050.00               |

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目            | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|---------------|-------------------------|-------------------------|
|               | 2021年01月01日至2021年12月31日 | 2020年01月01日至2020年12月31日 |
| 审计费用          | 80,000.00               | 80,000.00               |
| 信息披露费         | 120,000.00              | 120,000.00              |
| 证券出借违约金       | -                       | -                       |
| 账户维护费         | 37,200.00               | 37,200.00               |
| 银行费用          | 22,383.12               | 13,290.38               |
| 指数使用费         | -                       | -                       |
| 持有人大会-<br>公证费 | -                       | -                       |
| 持有人大会-<br>律师费 | -                       | -                       |
| 开户费           | -                       | -                       |
| 上市费           | -                       | -                       |
| 其他            | -                       | -                       |

|    |            |            |
|----|------------|------------|
| 合计 | 259,583.12 | 250,490.38 |
|----|------------|------------|

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 (“浦发银行”) | 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                |
| 上海上报资产管理有限公司            | 基金管理人的股东                |
| 上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)    | 基金管理人的股东                |
| 东航金控有限责任公司              | 基金管理人的股东                |
| 汇添富资本管理有限公司             | 基金管理人的全资子公司             |
| 汇添富资产管理 (香港) 有限公司       | 基金管理人的全资子公司             |
| 汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司     | 基金管理人的全资子公司             |
| 上海汇添富公益基金会              | 与基金管理人同一批关键管理人员         |
| 东方证券承销保荐有限公司            | 基金管理人的股东的全资子公司          |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日 |        | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |        |
|-------|---------------------------------------|--------|--|--------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券成 | 成交金额                                       | 占当期债券成 |
|       |                                       |        |  |        |

|      |                | 交总额的比例<br>(%) |   | 交总额的比例<br>(%) |
|------|----------------|---------------|---|---------------|
| 东方证券 | 305,839,404.74 | 100.00        | - | -             |

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日 |                          | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |                          |
|-----------|---------------------------------------|--------------------------|--|--------------------------|
|           | 成交金额                                  | 占当期回购<br>成交总额的<br>比例 (%) | 成交金额                                       | 占当期回购<br>成交总额的<br>比例 (%) |
| 东方证<br>券  | 8,367,700,000.00                      | 100.00                   | 895,000,000.00                             | 100.00                   |

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,723,385.48                                | 8,712,453.53                                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,224.27                                   | -  |

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

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                    | 上年度可比期间                               |
|----------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
|                | 2021 年 01 月 01 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 01 月 01 日至<br>2020 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 470,021.57                            | 2,904,151.23                          |

注：2021 年 10 月 13 日前，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2021 年 10 月 13 日期，本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性提取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

本基金自 2021 年 10 月 13 日起将年托管费率由 0.10% 降低至 0.05%。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日      |           |    |
|----------------|--|-----------|----|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |    |
|                | 汇添富鑫瑞债券 A                                  | 汇添富鑫瑞债券 C | 合计 |
| 合计             | -  | -         | -  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |           |    |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |    |
|                | 汇添富鑫瑞债券 A                                  | 汇添富鑫瑞债券 C | 合计 |
| 合计             | -  | -         | -  |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支

付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 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<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 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      |
| 上海浦东发展银行股份有限公司                                | 9,999,593.15   | 419,439,898.75 | -     | -    | 240,000,000.00 | 12,065.75 |
| 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 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      |
| 上海浦东发展银行股份有限公司                                | 288,328,271.63 | 70,377,984.38  | -     | -    | 210,000,000.00 | 8,112.33  |

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |            |
|-------|---------------------------------------|------------|--|------------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入     | 期末余额                                       | 当期利息收入     |
| 浦发银行  | 21,013,375.35                         | 107,490.53 | 338,157.65                                 | 674,001.46 |

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。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。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |             |             |        |        |        |          |              |              |    |
|----------------------|------|-------------|-------------|--------|--------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日       | 可流通日        | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|                      |      |             |             |        | -      | -      | -        | -            | -            |    |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |      |             |             |        |        |        |          |              |              |    |
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日       | 可流通日        | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 113052               | 兴业转债 | 2021 年 12 月 | 2022 年 01 月 | 新债流通   | 100.00 | 100.00 | 12,620   | 1,262,000.00 | 1,262,000.00 |    |



|                          |      | 29<br>日 | 14<br>日 | 受<br>限 |      |        |          |        |        |    |
|--------------------------|------|---------|---------|--------|------|--------|----------|--------|--------|----|
| 7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券 |      |         |         |        |      |        |          |        |        |    |
| 证券代码                     | 证券名称 | 成功认购日   | 可流通日    | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|                          |      |         |         |        | -    | -      | -        | -      | -      |    |

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 149,999,255.00 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        |
|-----------|----------------|------------------|--------|---------|---------------|
| 101800459 | 18 鲁招金 MTN001  | 2022 年 01 月 04 日 | 102.87 | 100,000 | 10,287,000.00 |
| 102102066 | 21 瀚蓝 MTN002   | 2022 年 01 月 04 日 | 100.63 | 100,000 | 10,063,000.00 |
| 102100337 | 21 泰州城建 MTN001 | 2022 年 01 月 04 日 | 102.96 | 100,000 | 10,296,000.00 |
| 101801315 | 18 福建漳州 MTN002 | 2022 年 01 月 04 日 | 103.29 | 100,000 | 10,329,000.00 |
| 102000751 | 20 新华报业 MTN001 | 2022 年 01 月 04 日 | 100.28 | 200,000 | 20,056,000.00 |
| 210206    | 21 国开 06       | 2022 年 01 月 04 日 | 100.07 | 250,000 | 25,017,500.00 |
| 102000409 | 20 许继电气 MTN001 | 2022 年 01 月 04 日 | 101.00 | 200,000 | 20,200,000.00 |

|           |                    |                        |        |           |                |
|-----------|--------------------|------------------------|--------|-----------|----------------|
|           |                    | 日                      |        |           |                |
| 101901715 | 19 平高<br>MTN001    | 2022 年<br>01 月 04<br>日 | 100.82 | 100,000   | 10,082,000.00  |
| 101900384 | 19 温公用<br>MTN001   | 2022 年<br>01 月 04<br>日 | 104.31 | 100,000   | 10,431,000.00  |
| 012105369 | 21 江西建<br>材 SCP004 | 2022 年<br>01 月 04<br>日 | 100.00 | 100,000   | 10,000,000.00  |
| 012105076 | 21 知识城<br>SCP005   | 2022 年<br>01 月 04<br>日 | 100.07 | 80,000    | 8,005,600.00   |
| 101659012 | 16 京汽集<br>MTN001B  | 2022 年<br>01 月 04<br>日 | 99.99  | 100,000   | 9,999,000.00   |
| 102001124 | 20 南昌工<br>业 MTN002 | 2022 年<br>01 月 04<br>日 | 101.27 | 100,000   | 10,127,000.00  |
| 合计        |                    |                        |        | 1,630,000 | 164,893,100.00 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款共人民币 216,500,000.00 元，于 2022 年 01 月 04 日, 2022 年 01 月 06 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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的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。

#### 7.4.13.2.1 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 133,239,427.70          | -                        |
| 合计     | 133,239,427.70          | -                        |

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。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位:人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | -                       | 9,722,000.00             |
| 合计     | -                       | 9,722,000.00             |

注:本表列示期限在一年以内的同业存单。短期信用评级 A-1 所填列的为主体评级 AAA 的同业存单,短期信用评级 A-1 以下所填列的为主体评级 AAA 以下的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
|--------|-------------------------|--------------------------|

|        |                  |                |
|--------|------------------|----------------|
| AAA    | 675,978,000.00   | -              |
| AAA 以下 | 418,520,900.00   | -              |
| 未评级    | 191,713,000.00   | 912,580,000.00 |
| 合计     | 1,286,211,900.00 | 912,580,000.00 |

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 10,012,000.00           | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | -                       | -                        |
| 合计     | 10,012,000.00           | -                        |

#### 7.4.13.2.6 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。

#### 7.4.13.3 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随时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。

##### 7.4.13.3.1 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。

本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的资产均能及

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和资产支持证券等；生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年<br>12月<br>31日 | 1个月以<br>内     | 1-3个月 | 3个月-1<br>年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计            |
|----------------------------|---------------|-------|------------|------|------|-----|---------------|
| 资产                         |               |       |            |      |      |     |               |
| 银行存款                       | 21,013,375.35 | -     | -          | -    | -    | -   | 21,013,375.35 |
| 结算备付金                      | 17,745,788.55 | -     | -          | -    | -    | -   | 17,745,788.55 |
| 存出                         | 13,564.70     | -     | -          | -    | -    | -   | 13,564.70     |

|          |               |               |                |                |               |               |                  |
|----------|---------------|---------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 保证金      |               |               |                |                |               |               |                  |
| 交易性金融资产  | 10,559,491.40 | 42,450,250.00 | 336,784,558.52 | 946,755,027.78 | 92,914,000.00 | -             | 1,429,463,327.70 |
| 应收股利     | -             | -             | -              | -              | -             | -             | -                |
| 应收利息     | -             | -             | -              | -              | -             | 18,863,972.54 | 18,863,972.54    |
| 应收申购款    | -             | -             | -              | -              | -             | 77,713.12     | 77,713.12        |
| 衍生金融资产   | -             | -             | -              | -              | -             | -             | -                |
| 应收证券清算款  | -             | -             | -              | -              | -             | -             | -                |
| 买入返售金融资产 | -             | -             | -              | -              | -             | -             | -                |

|           |                |               |                |                |               |               |                  |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 其他资产      | -              | -             | -              | -              | -             | -             | -                |
| 资产总计      | 49,332,200.00  | 42,450,250.00 | 336,784,558.52 | 946,755,027.78 | 92,914,000.00 | 18,941,685.66 | 1,487,177,741.96 |
| 负债        |                |               |                |                |               |               |                  |
| 应付赎回款     | -              | -             | -              | -              | -             | 12,578.25     | 12,578.25        |
| 应付管理人报酬   | -              | -             | -              | -              | -             | 255,334.27    | 255,334.27       |
| 应付托管费     | -              | -             | -              | -              | -             | 42,555.72     | 42,555.72        |
| 应付证券清算款   | -              | -             | -              | -              | -             | 18,752,138.71 | 18,752,138.71    |
| 卖出回购金融资产款 | 366,499,255.00 | -             | -              | -              | -             | -             | 366,499,255.00   |
| 应         | -              | -             | -              | -              | -             | 1.63          | 1.63             |

|         |                 |               |                |                |               |               |                  |
|---------|-----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 付销售服务费  |                 |               |                |                |               |               |                  |
| 应付交易费用  | -               | -             | -              | -              | -             | 23,394.33     | 23,394.33        |
| 应交税费    | -               | -             | -              | -              | -             | 99,571.35     | 99,571.35        |
| 应付利息    | -               | -             | -              | -              | -             | 272,085.37    | 272,085.37       |
| 应付利润    | -               | -             | -              | -              | -             | -             | -                |
| 其他负债    | -               | -             | -              | -              | -             | 200,000.00    | 200,000.00       |
| 负债总计    | 366,499,255.00  | -             | -              | -              | -             | 19,657,659.63 | 386,156,914.63   |
| 利率敏感度缺口 | -317,167,035.00 | 42,450,250.00 | 336,784,558.52 | 946,755,027.78 | 92,914,000.00 | -715,973.97   | 1,101,020,827.33 |
| 上年度末    | 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               |
| 20      |                 |               |                |                |               |               |                  |



|                               |                  |                   |                    |                    |   |                   |                    |
|-------------------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---|-------------------|--------------------|
| 20<br>年<br>12<br>月<br>31<br>日 |                  |                   |                    |                    |   |                   |                    |
| 资产                            |                  |                   |                    |                    |   |                   |                    |
| 银行存款                          | 338,157.<br>65   | -                 | -                  | -                  | - | -                 | 338,157.6<br>5     |
| 结算备付金                         | 2,285,71<br>4.29 | -                 | -                  | -                  | - | -                 | 2,285,714<br>.29   |
| 存出保证金                         | -                | -                 | -                  | -                  | - | -                 | -                  |
| 交易性金融资产                       | -                | 30,036,0<br>00.00 | 170,987,<br>000.00 | 721,279,<br>000.00 | - | -                 | 922,302,0<br>00.00 |
| 应收股利                          | -                | -                 | -                  | -                  | - | -                 | -                  |
| 应收利息                          | -                | -                 | -                  | -                  | - | 13,269,0<br>52.54 | 13,269,05<br>2.54  |
| 应收申购款                         | -                | -                 | -                  | -                  | - | -                 | -                  |
| 衍生                            | -                | -                 | -                  | -                  | - | -                 | -                  |

|          |              |               |                |                |   |               |                |
|----------|--------------|---------------|----------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 金融资产     |              |               |                |                |   |               |                |
| 应收证券清算款  | -            | -             | -              | -              | - | -             | -              |
| 买入返售金融资产 | -            | -             | -              | -              | - | -             | -              |
| 其他资产     | -            | -             | -              | -              | - | -             | -              |
| 资产总计     | 2,623,871.94 | 30,036,000.00 | 170,987,000.00 | 721,279,000.00 | - | 13,269,052.54 | 938,194,924.48 |
| 负债       |              |               |                |                |   |               |                |
| 应付赎回款    | -            | -             | -              | -              | - | -             | -              |
| 应付管理人报酬  | -            | -             | -              | -              | - | 176,206.60    | 176,206.60     |
| 应付托      | -            | -             | -              | -              | - | 58,735.54     | 58,735.54      |

|           |                |   |   |   |   |           |                |
|-----------|----------------|---|---|---|---|-----------|----------------|
| 管费        |                |   |   |   |   |           |                |
| 应付证券清算款   | -              | - | - | - | - | -         | -              |
| 卖出回购金融资产款 | 239,999,440.00 | - | - | - | - | -         | 239,999,440.00 |
| 应付销售服务费   | -              | - | - | - | - | 0.31      | 0.31           |
| 应付交易费用    | -              | - | - | - | - | 12,389.86 | 12,389.86      |
| 应交税费      | -              | - | - | - | - | -         | -              |
| 应付利息      | -              | - | - | - | - | 87,114.52 | 87,114.52      |
| 应付利润      | -              | - | - | - | - | -         | -              |
| 其他        | -              | - | - | - | - | 200,000.  | 200,000.0      |

|                                 |                         |                   |                    |                    |   |                   |                    |
|---------------------------------|-------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---|-------------------|--------------------|
| 他<br>负<br>债                     |                         |                   |                    |                    |   | 00                | 0                  |
| 负<br>债<br>总<br>计                | 239,999,<br>440.00      | -                 | -                  | -                  | - | 534,446.<br>83    | 240,533,8<br>86.83 |
| 利<br>率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口 | -<br>237,375,<br>568.06 | 30,036,0<br>00.00 | 170,987,<br>000.00 | 721,279,<br>000.00 | - | 12,734,6<br>05.71 | 697,661,0<br>37.65 |

上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|               |  |                             |                       |
|---------------|--|-----------------------------|-----------------------|
| 假<br>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<br>析        | 相<br>关<br>风<br>险<br>变<br>量<br>的<br>变<br>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 2021 年 12 月 31 日        | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|               | 基准利率减少 25 个基点  | 8,690,893.86                | 3,959,221.53          |
| 基准利率增加 25 个基点 | -8,512,401.50  | -3,926,919.18               |                       |

#### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和资产支持证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，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%（于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券），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。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 1,429,463,327.70 元，无划分为第一层次和第三层次余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 922,302,000.00 元，无划分为第一层次和第三层次余额）。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券等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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。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。

###### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期末未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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            | 1,429,463,327.70 | 96.12        |
|    | 其中：债券             | 1,419,451,327.70 | 95.45        |
|    | 资产支持证券            | 10,012,000.00    | 0.67         |
| 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      | 38,759,163.90    | 2.61         |
| 8  | 其他各项资产            | 18,955,250.36    | 1.27         |
| 9  | 合计                | 1,487,177,741.96 | 100.00       |

### 8.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

注：本基金本报告期末投资股票。

### 8.5 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      | 105,973,827.70   | 9.63         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 243,477,000.00   | 22.11        |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,012,000.00    | 3.63         |
| 4  | 企业债券      | 600,209,400.00   | 54.51        |
| 5  | 企业短期融资券   | 78,116,600.00    | 7.09         |
| 6  | 中期票据      | 390,412,500.00   | 35.46        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,262,000.00     | 0.11         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 地方政府债     | -                | -            |
| 10 | 其他        | -                | -            |
| 11 | 合计        | 1,419,451,327.70 | 128.92       |

### 8.6 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（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 210009  | 21 付息国债 09   | 300,000 | 30,498,000.00 | 2.77         |
| 2  | 2128039 | 21 中国银行二级 03 | 300,000 | 30,408,000.00 | 2.76         |
| 3  | 2128042 | 21 兴业银行二级 02 | 300,000 | 30,297,000.00 | 2.75         |
| 4  | 2128049 | 21 建设银行二级 05 | 300,000 | 30,225,000.00 | 2.75         |
| 5  | 210206  | 21 国开 06     | 300,000 | 30,021,000.00 | 2.73         |

### 8.7 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称   | 数量（份）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 193788 | 裕泽 4A2 | 100,000 | 10,012,000.00 | 0.91         |

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理原则，以套期保值为目的，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。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险指标说明    |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-----------|
|                   |    | -        | -       | -         |           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -         |
| 国债期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | 36,650.48 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | -         |

#### 8.11.3 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，符合既定的投资策略和投资目标。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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   | 13,564.70     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 18,863,972.54 |
| 5  | 应收申购款   | 77,713.12     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 18,955,250.36 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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(%) |
| 汇添富鑫瑞债券 A | 534      | 1,957,639.29 | 1,044,105,480.63 | 99.88     | 1,273,898.71 | 0.12      |
| 汇添富鑫瑞债券 C | 32       | 158.75       | 0.00             | 0.00      | 5,079.93     | 100.00    |
| 合计        | 566      | 1,846,969.01 | 1,044,105,480.63 | 99.88     | 1,278,978.64 | 0.12      |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|------------------|-----------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 汇添富鑫瑞债券 A | 23,321.61 | 0.00        |
|                  | 汇添富鑫瑞债券 C | 882.04    | 17.36       |
|                  | 合计        | 24,203.65 | 0.00        |

### 9.3 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 | 汇添富鑫瑞债券 A | 0~10              |
|                                | 汇添富鑫瑞债券 C | 0                 |
|                                | 合计        | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放                   | 汇添富鑫瑞债券 A | 0~10              |

|     |           |      |
|-----|-----------|------|
| 式基金 | 汇添富鑫瑞债券 C | 0    |
|     | 合计        | 0~10 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                         | 汇添富鑫瑞债券 A        | 汇添富鑫瑞债券 C |
|----------------------------|------------------|-----------|
| 基金合同生效日（2016年12月26日）基金份额总额 | 200,421,913.81   | 700.00    |
| 本报告期期初基金份额总额               | 685,646,700.76   | 1,110.97  |
| 本报告期基金总申购份额                | 1,195,001,349.89 | 12,332.65 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 835,268,671.31   | 8,363.69  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                | -         |
| 本报告期末基金份额总额                | 1,045,379,379.34 | 5,079.93  |

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内未发生涉及公募基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2016 年 12 月 26 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 80,000.00 元。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。  
本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用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   | 3      | -    | -                | -         | -              |    |
| 东北证券   | 2      | -    | -                | -         | -              |    |
| 申万宏源证券 | 2      | -    | -                | -         | -              |    |
| 浙商证券   | 1      | -    | -                | -         | -              |    |
| 中信证券   | 3      | -    | -                | -         | -              |    |

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。

##### 11.7.2 基金租用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 | 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 | 成交金额   | 占当期债券回 | 成交   | 占当期权 | 成交   | 占当期基 |

| 称              |                | 交总额的<br>比例<br>(%) |                  | 购成交<br>总额的<br>比例<br>(%) | 金<br>额 | 证成<br>交总<br>额的<br>比例<br>(%) | 金<br>额 | 金成<br>交总<br>额的<br>比例<br>(%) |
|----------------|----------------|-------------------|------------------|-------------------------|--------|-----------------------------|--------|-----------------------------|
| 东方<br>证券       | 305,839,404.74 | 100.00            | 8,367,700,000.00 | 100.00                  | -      | -                           | -      | -                           |
| 东北<br>证券       | -              | -                 | -                | -                       | -      | -                           | -      | -                           |
| 申万<br>宏源<br>证券 | -              | -                 | -                | -                       | -      | -                           | -      | -                           |
| 浙商<br>证券       | -              | -                 | -                | -                       | -      | -                           | -      | -                           |
| 中信<br>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投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (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决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 3 个交易单元：东北证券（上交所单元，深交所单元）、浙商证券（上交所单元）。

## 11.8 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关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告 | 上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所 | 2021 年 01 月 09 日 |
| 2  | 汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告           | 上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所     | 2021 年 01 月 22 日 |
| 3  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告            | 上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所     | 2021 年 03 月 30 日 |
| 4  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告     | 上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所 | 2021 年 04 月 20 日 |
| 5  | 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及基金产品资料概要     | 上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所     | 2021 年 04 月 21 日 |
| 6  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告        | 上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所     | 2021 年 04 月 22 日 |
| 7  | 汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告               | 上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所 | 2021 年 06 月 24 日 |
| 8  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告        | 上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所     | 2021 年 07 月 21 日 |

|    |   |                                   |                  |
|----|---|-----------------------------------|------------------|
| 9  | 汇添富基金管理股份有限公司关于获准设立子公司的公告                           | 上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所 | 2021 年 08 月 26 日 |
| 10 | 汇添富鑫瑞债券型证券投资基金基金经理变更公告                              | 中证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站           | 2021 年 08 月 28 日 |
| 11 | 汇添富鑫瑞债券型证券投资基金更新招募说明书 (2021 年 8 月 30 日更新)           | 公司网站及中国证监会基金电子披露网站                | 2021 年 08 月 30 日 |
| 12 | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年中期报告                        | 上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所      | 2021 年 08 月 31 日 |
| 13 | 汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告                      | 上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所 | 2021 年 09 月 16 日 |
| 14 | 关于汇添富鑫瑞债券型证券投资基金开放转换业务的公告                           | 中证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站           | 2021 年 09 月 25 日 |
| 15 | 汇添富基金管理股份有限公司关于本公司及上海分公司办公地址变更的公告                   | 上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所 | 2021 年 10 月 09 日 |
| 16 | 汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富鑫瑞债券型证券投资基金降低年托管费率并修改基金合同和托管协议的公告 | 中证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站           | 2021 年 10 月 12 日 |
| 17 | 汇添富鑫瑞债券型证券投资基金更新法律文件 (2021 年 10 月 12 日更新)           | 公司网站及中国证监会基金电子披露网站                | 2021 年 10 月 12 日 |
| 18 | 汇添富鑫瑞债券型证券投资基金更新招募说明书 (2021 年 10 月 13 日更新)          | 公司网站及中国证监会基金电子披露网站                | 2021 年 10 月 13 日 |
| 19 | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告                    | 上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所      | 2021 年 10 月 27 日 |
| 20 | 关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金开通线上直销系统申购、转换和定期定额投资业务的公告      | 中证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站           | 2021 年 11 月 19 日 |
| 21 | 关于汇添富基金管理股份有限公司投顾业务中通过投资者投顾账户交易本公司旗下基金免除相关          | 上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网       | 2021 年 12 月 23 日 |

|       |        |
|-------|--------|
| 费用的公告 | 站, 深交所 |
|-------|--------|

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 2021 年 9 月 10 日至 2021 年 9 月 13 日 | -    | 47,919,302.28 | -             | 47,919,302.28 | 4.58     |
|       | 2              | 2021 年 9 月 8 日                   | -    | 47,920,260.69 | 17,920,260.69 | 30,000,000.00 | 2.87     |



|   |  |                    |                   |                    |   |   |
|---|--|--------------------|-------------------|--------------------|---|---|
|   | 至<br>202<br>1年<br>9月<br>13<br>日                          |                    |                   |                    |   |   |
| 3 | 202<br>1年<br>1月<br>1日<br>至<br>202<br>1年<br>3月<br>18<br>日 | 191,142,735.5<br>3 | -                 | 191,142,735.5<br>3 | - | - |
| 4 | 202<br>1年<br>1月<br>1日<br>至<br>202<br>1年<br>7月<br>5日      | 494,461,036.3<br>9 | -                 | 494,461,036.3<br>9 | - | - |
| 5 | 202<br>1年<br>7月<br>6日<br>至<br>202<br>1年<br>9月<br>8日      | -                  | 48,420,491.9<br>6 | 48,420,491.96      | - | - |

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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富鑫瑞债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富鑫瑞债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富鑫瑞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、报告期内汇添富鑫瑞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。

### 13.2 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

### 13.3 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 03 月 31 日