## 汇添富稳安三个月持有期债券型证券投资基 金 2024 年第 1 季度报告

2024年03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: 中国建设银行股份有限公司

送出日期: 2024年04月22日

#### §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2024 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024年01月01日起至2024年03月31日止。

#### § 2 基金产品概况

#### 2.1基金基本情况

基金简称	汇添富稳安三个月持有债券
基金主代码	015853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生 效日	2022年07月04日
报告期末基金份额总额(份)	691, 907, 549. 13
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略、 期限结构配置策略、个券选择策略、可转换债券和可交换债券投资策略、 国债期货投资策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。
业绩比较基 准	本基金的业绩比较基准为:中债总指数收益率*80%+银行一年期定期存款 利率(税后)*20%。
风险收益特 征	本基金为债券型基金,其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人	中国建设银行股份有限公司				
下属分级基金的基金简称	汇添富稳安三个 月持有债券 A	汇添富稳安三个 月持有债券 B	汇添富稳安三个 月持有债券 C	汇添富稳安三个 月持有债券 E	
下属分级基 金的交易代 码	015853	016636	015854	015855	
报告期末下 属分级基金 的份额总额 (份)	388, 525, 974. 49	109, 201, 788. 17	194, 166, 135. 28	13, 651. 19	

## §3主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期	报告期(2024年01月01日 - 2024年03月31日)				
	汇添富稳安三	汇添富稳安三	汇添富稳安三	汇添富稳安三		
	个月持有债券 A	个月持有债券 B	个月持有债券 C	个月持有债券 E		
1. 本期已实现 收益	3, 821, 416. 93	884, 390. 37	4, 809, 958. 81	121.76		
2. 本期利润	4, 385, 978. 75	848, 235. 31	5, 567, 001. 36	141. 28		
3. 加权平均基 金份额本期利 润	0. 0186	0. 0187	0. 0199	0. 0193		
4. 期末基金资 产净值	414, 342, 553. 8	116, 417, 590. 3	207, 031, 044. 5	14, 548. 88		
5. 期末基金份 额净值	1.0664	1.0661	1.0663	1. 0658		

- 注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平 要低于所列数字。

#### 3.2基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 汇添富稳安三个月持有债券 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	1.86%	0.05%	1. 07%	0.08%	0.79%	-0.03%
过去六个 月	2. 96%	0.05%	1.82%	0.06%	1.14%	-0.01%
过去一年	4.90%	0.05%	2. 78%	0.06%	2. 12%	-0.01%
自基金合 同生效日 起至今	6.64%	0.04%	3. 24%	0.06%	3.40%	-0.02%
		汇添富科	急安三个月持续	有债券 B		
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	1.86%	0.05%	1. 07%	0.08%	0.79%	-0.03%
过去六个 月	2. 97%	0.05%	1.82%	0.06%	1.15%	-0.01%
过去一年	4.88%	0.05%	2. 78%	0.06%	2.10%	-0.01%
自基金合 同生效日 起至今	5. 50%	0.04%	2.70%	0.06%	2.80%	-0.02%
		汇添富和	急安三个月持	有债券 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	1)-3	2-4
过去三个 月	1.87%	0.05%	1.07%	0.08%	0.80%	-0.03%
过去六个 月	2. 96%	0.05%	1.82%	0.06%	1.14%	-0.01%
过去一年	4. 89%	0.05%	2. 78%	0.06%	2.11%	-0.01%
自基金合						
同生效日 起至今	6. 63%	0.04%	3. 24%	0.06%	3.39%	-0.02%
		汇添富和	急安三个月持	有债券 E		
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	1.87%	0.05%	1.07%	0.08%	0.80%	-0.03%

月						
过去六个 月	2. 99%	0.05%	1.82%	0.06%	1. 17%	-0.01%
过去一年	4.84%	0.05%	2.78%	0.06%	2.06%	-0.01%
自基金合 同生效日 起至今	6. 58%	0.04%	3. 24%	0.06%	3. 34%	-0.02%

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

汇添富稳安三个月持有债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



#### 汇添富稳安三个月持有债券B累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



#### 汇添富稳安三个月持有债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





汇添富稳安三个月持有债券E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(2022年07月04日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2023 年 01 月 06 日新增 B 类份额。

## §4管理人报告

#### 4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年	说明
Д <u>т</u> -П	7/1/3	任职日期	离任日期	限(年)	60.71
杨靖	本基金的基 金经理,纯债 部总经理	2022 年 07 月 04 日	_	13	国籍:中南京中南京一大州亚泰州亚东 一中南京一大州亚泰州亚 一种

员、2016年 7月加入汇 溶富量合同人汇 溶富量合同。 理假公司、价值 固定收量。 2019年2月22日第二点经理。 2019年2月22日第二点经理。 2019年2月22日第二点经验,现在结理。 2019年6月22日第二点经验,是全国企业。 2019年2日至2022年8月8日在汇率期型企会理。 2019年3月8日在汇率期型企会理。 2019年3月28日至2021年8月28日至2021年8月28日至2021年8月23日至2021年8月23日至2021年8月11日和《企业》	 		 
添配分			员。2016年
理股份有限公司收益部专户、经验部。			7月加入汇
公司、历益部专户投资债理,历益部专户投资债理,现任国定收货债理,总经纯理。总经纯理。总经纯理。2019年2月至2日至高 AAA 级信用型金理。2019年8月28日至月28日至月28日至年8月次野型基金理。2019年8月在汇灾野型基金理。是19年至今长下证金理。月28日至高市,发资基金年8月在汇产,发达。2020年1月6日至今中代,1一3年次发行债券投资金经年8月6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6			添富基金管
國定投資價部 副定收經價部 副定收經價部 息經理。 2019年2月 22日年20日至 2019年2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2021年 2020年 3月23日 2020年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日			理股份有限
國定投資價部 副定收經價部 副定收經價部 息經理。 2019年2月 22日年20日至 2019年2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2022年 2019年至2021年 2020年 3月23日 2020年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日 2021年 3月23日			公司,历任
专户独领部副总任经理。 2019年2月22日至至今任 汇除经理债部。 2019年2月22日至至今任 汇除富和4人债债型证金理。 2019年8月28日至2022年8月8日在汇产期型金差。 2019年8月28日至2022年8月8日在汇产期型金率的。 2019年至8月28日高湖广港,投资基金中1月28日高湖广港,投资基金中1月6日至富在大街、大厅,是一个大厅,是一个大厅,是一个大厅,是一个大厅,是一个一个大厅,是一个一个大厅,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			
理、纯债部副总经债部总经理年2月22日车2019年2月在汽车2019年2月在汽车2019年2月22日车后车2022年8月至8月至8月至8月至8日在汇产期型金型。2019年8月28日车后流,上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上上			
副总经理。 2019年2月 22日至宫 AAA 2019年2月 22日至宫 AAA 级信那延金卿。 2019年2月 22日至宫 AAA 级信舞型企理。 2019年8月 28日至 2022年8月 富濟 放债资金经理。 2019年8月 28日至公司9年8月 28日至后来 利炭野型企业。 2019年8月 28日至后来 利炭野型企业。 2020年1月 6日至帝市发持资金经理。 2020年1月 6日日至帝市发持资基金的。 2020年3月23日8月 17日日系濟			1
现任纯债部总经理。 2019年2月 22日至今任 汇添富 AAA 级债券型金。 2019年8月 28日至 2022年8月 28日至 2022年8月 8			1
总经理。 2019 年 2 月 22 日至今任 汇添富 AAA 级信用型证券 债债 债券型金。 2019 年 8 月 28 日至 2022 年 8 月 8 日 在汇添期证券 投资基理。 2019 年 8 月 28 日至全人。 为量经验。 2019 年 8 月 28 日至全人。 和定数, 是公理。 2019 年 8 月 28 日至全人。 和定数, 是公理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券收资金经 理。 2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添富鑫利 定期			
2019 年 2 月 22 日至今任 汇添富 AAA 级信用纯证债 债券型基金的 基金经理。 2019 年 8 月 28 日至 2022 年 8 月 8 日 在汇源更放 债券基金的 基金理。 2019 年 8 月 28 日至合长添利定期证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今中债 1-3 年农发 行债券投资基 金的基金经理。 2020 年 3 月 2020 年 3 月 2020 年 3 月 2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			
22 日至今任 汇添富 AAA 级信用纯债 债券型证券 投资基金理。 2019 年 8 月 28 日至 2022 年 8 月 8 日 任汇定期开放 债券型金理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富期开放 债券型基金的 基金经年 8 月 28 日至今任 汇添率期延券 投资基金。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添之中债 1-3 年农发 行债券投资基 金的基金全理。 2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			
汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金的基金经理。 2019 年8 月 28 日至 2022 年 8 月 8 日 任汇添富鑫 汇定期开放债券登基金的基金经理。 2019 年8 月 28 日至今任汇添高丰水放债券资基金的基金经理。 2019 年8 月 28 日至今任汇添利定期型证券投资基金的基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任汇添有债券投资经理。 2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添富鑫利定期			
级信用纯债债券型证券 投资基金的基金全理。 2019年8月 28日至2022年8月8届 在汇定费型基金的 基金型。 2019年8月 28日至富长液 利定第期亚券 投资金型。 2020年1月 6日至全今任 汇添车中债 1-3年次发 行债券指数 证券投资金处 理。 2020年3月 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			
债券型证券 投资基金的基金全理。 2019年8月 28日至2022年8月8日 任汇滞期面查 汇定期开放 债券型业金的基金9年8月 28日至令任 汇定期证券 投资基金9年3月 28日至高来 利定数基金9年1月 6日至高中债 1-3年券投 行债券投资上金的 建金9年1月 6日至高中债 1-3年次数 行债券投资上金约 理。2020年3月 3月23日至 2021年8月 17日任汇添富鑫利定期			
投资基金的基金经理。 2019年8月 28日至2022年8月8日在汇率富鑫汇定期开放债券基金理。 2019年8月 28日至金班为投资基金理。 2019年8月 28日至今任汇添期开放债券型基金的基金经理。 2020年1月6日至今任汇添富中依1-3年次发行债券指数基金的基金经理。 2020年3月23日至2021年8月17日任汇添富鑫利定期			
基金经理。 2019 年 8 月 28 日至 2022 年 8 月 8 日 任汇添富鑫 汇定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富期开放 债券型证券 投资基全。 和定期证券 投资基金。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基金。 金的基金经理。 2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添富鑫利定期			
2019 年 8 月 28 日至 2022 年 8 月 8 日 任汇添富鑫 汇定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添高 共流 利定期开放 债券型证券 投资基金的 基金2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			1
28 日至 2022 年 8 月 8 日 任汇添富鑫 汇定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富长添 利定期证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富官中债 1-3 年农发 行债券投资基 金的基金经 理。 2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			1
年8月8日 任汇添富鑫 汇定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2019年8月 28日至今任 汇添富长添 利定期开放 债券型证券 投资基金四。 2020年1月 6日至今任 汇添富官本货 行债券投资基金的基金经 理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			
任汇添富鑫 汇定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富于放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			
汇定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富长添 利定期证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			1
债券型证券 投资基金的 基金经理。 2019年8月 28日至今任 汇添富长添 利定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020年1月 6日至今任 汇添富中债 1-3年农发 行债券指数 证券投基金 全理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			1
投资基金的基金经理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富长添 利定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			1
基金经理。 2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富长添 利定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			
2019 年 8 月 28 日至今任 汇添富长添 利定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			1
28 日至今任 汇添富长添 利定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020 年 1 月 6 日至今任 汇添 富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			1
汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020年1月6日至今任汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年3月23日至2021年8月17日任汇添富鑫利定期			1
利定期开放 债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020年1月 6日至今任 汇添富中债 1-3年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			
债券型证券 投资基金的 基金经理。 2020年1月 6日至今任 汇添富中债 1-3年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			1
投资基金的基金经理。 2020年1月6日至今任 汇添富中债 1-3年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			
基金经理。 2020年1月6日至今任 汇添富中债 1-3年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			
2020年1月 6日至今任 汇添富中债 1-3年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			
6 日至今任 汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			
汇添富中债 1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			1
1-3 年农发 行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020 年 3 月 23 日至 2021 年 8 月 17 日任汇添 富鑫利定期			
行债券指数 证券投资基 金的基金经 理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			
证券投资基金的基金经理。2020年3月23日至2021年8月17日任汇添富鑫利定期			1
金的基金经理。2020年3月23日至2021年8月17日任汇添富鑫利定期			
理。2020年 3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			1
3月23日至 2021年8月 17日任汇添 富鑫利定期			1
2021 年 8 月   17 日任汇添   富鑫利定期			
17 日任汇添			
富鑫利定期			1
			1
一			
			开放债券型

		发起式证券
		投资基金的
		基金经理。
		2020年6月
		10 日至 2022
		年 3 月 21 日
		任汇添富民
		安增益定期
		开放混合型
		证券投资基
		金的基金经
		理。2020年
		9月1日至
		2021年10
		月 11 日任汇
		添富鑫成定
		期开放债券
		型发起式证
		券投资基金
		的基金经理。
		2020年11
		月4日至今
		任汇添富稳
		健汇盈一年
		持有期混合
		型证券投资
		基金的基金
		经理。2020
		年11月6日
		至今任汇添
		富盛和66个
		月定期开放
		债券型证券
		投资基金的
		基金经理。
		2021年8月
		20 日至今任
		汇添富丰润
		中短债债券
		型证券投资
		基金的基金
		经理。2022
		年5月13日
		至今任汇添
		富短债债券
		型证券投资
		<b>ユール 10</b> 久久

		基金的基金
		经理。2022
		年6月27日
		至今任汇添
		富鑫和纯债
		债券型证券
		投资基金的
		基金经理。
		2022年7月
		4日至今任
		汇添富稳安
		三个月持有
		期债券型证
		券投资基金
		的基金经理。
		2022年8月
		9 日至今任
		汇添富鑫汇
		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相关规定。
- 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律 法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金 资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、 违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

- 一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。
- 二、本着"时间优先、价格优先"的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。
- 三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合 判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行 了公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 1 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

#### 4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年一季度,债券利率显著下行,市场呈现较强走势。1-2月,在债券供给相对不多、市场配置需求较强的情况下,债券市场的"资产荒"现象较为明显。叠加准备金率下调、5年期 LPR 利率下调等因素,市场资金面总体偏宽松,以1年期 AAA 存单为代表的短端利率从年初的2.45%下行至2.25%附近。做多情绪在长端利率品种上更为明显,10年期国债从年初的2.55%下行至2.35%附近,30年国债更是成为市场关注焦点,交投活跃度明

显抬升。至 2 月底,在多方力量追逐下,各类债券的品种利差、评级利差、期限利差基本都降至历史较低水平。进入 3 月后,市场总体有所降温,转入窄幅震荡走势,围绕两会政策预期、特别国债发行节奏、季末资金走势等展开博弈。与此同时,从国际视角看,10 年期美债利率在一季度震荡走高,由年初的 3.85%附近上行至 3 月底的 4.20%附近,人民币兑美元的离岸汇率相应从 7.10 左右震荡走高至 7.25 附近。

本报告期内,本基金配置以高等级债券为主,同时灵活参与市场交易,整体操作以获取稳健收益为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富稳安三个月持有债券 A 类份额净值增长率为 1.86%,同期业绩比较基准收益率为 1.07%。本报告期汇添富稳安三个月持有债券 B 类份额净值增长率为 1.86%,同期业绩比较基准收益率为 1.07%。本报告期汇添富稳安三个月持有债券 C 类份额净值增长率为 1.87%,同期业绩比较基准收益率为 1.07%。本报告期汇添富稳安三个月持有债券 E 类份额净值增长率为 1.87%,同期业绩比较基准收益率为 1.07%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	_	_
	其中: 股票	_	_
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	754, 579, 034. 00	96. 65
	其中:债券	754, 579, 034. 00	96. 65
	资产支持证券	_	_
4	贵金属投资	_	_
5	金融衍生品投资	_	_
6	买入返售金融资产	_	_
	其中: 买断式回购的买入返	_	_

	售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	4, 436, 422. 62	0. 57
8	其他资产	21, 712, 070. 87	2. 78
9	合计	780, 727, 527. 49	100.00

- 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金报告期末未投资境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

- 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
- 注: 本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	_	_
2	央行票据	_	-
3	金融债券	736, 900, 839. 75	99. 88
	其中: 政策性金融债	91, 327, 202. 18	12. 38
4	企业债券	_	_
5	企业短期融资券	_	_
6	中期票据	10, 208, 597. 27	1. 38
7	可转债 (可交换债)	7, 469, 596. 98	1.01
8	同业存单	_	_
9	地方政府债	_	_
10	其他	_	_
11	合计	754, 579, 034. 00	102. 27

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
1	2028018	20 交通银行 二级	400,000	41, 507, 160. 66	5. 63
2	2028013	20 农业银行 二级 01	400,000	41, 437, 136. 61	5. 62
3	190311	19 进出 11	400,000	40, 863, 868. 85	5. 54
4	2028038	20 中国银行 二级 01	300,000	31, 440, 540. 98	4. 26
5	2028041	20 工商银行 二级 01	300, 000	31, 435, 278. 69	4. 26

# 5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

- **5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细** 注:本基金本报告期末未持有权证投资。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 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。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	力も	持仓量(买/	合约市值	公允价值变	风险指标说
1 (4号	<b>名称</b>	卖)	(元)	动 (元)	明
		_	_	_	
公允价值变动总额合计(元)					_
国债期货投资本期收益(元)					-325, 239. 91
国债期货投资本期公允价值变动(元)				_	

#### 5.10.3 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,符合既定的投资政策和投资目标。

#### 5.11 投资组合报告附注

#### 5. 11. 1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,交通银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国进出口银行、中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 5. 11. 2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	230. 58
2	应收证券清算款	_

3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	21, 711, 840. 29
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	21, 712, 070. 87

## 5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	<b>佳坐</b> 42 70	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净
<b>分</b> 5	债券代码			值比例(%)
1	127018	本钢转债	1, 194, 143. 01	0.16
2	113021	中信转债	1, 154, 654. 79	0.16
3	110079	杭银转债	1, 116, 578. 90	0.15
4	132026	G 三峡 EB2	601, 483. 15	0.08
5	110075	南航转债	597, 322. 88	0.08
6	113061	拓普转债	596, 244. 11	0.08
7	127045	牧原转债	572, 648. 90	0.08
8	110067	华安转债	551, 978. 77	0.07
9	110059	浦发转债	544, 985. 62	0.07
10	110047	山鹰转债	539, 556. 85	0.07

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

## §6开放式基金份额变动

单位: 份

项目	汇添富稳安三	汇添富稳安三	汇添富稳安三	汇添富稳安三
	个月持有债券 A	个月持有债券 B	个月持有债券 C	个月持有债券 E
本报告期期初	200, 550, 272. 2	15, 769, 929. 22	260, 920, 720. 7	6, 345. 87

基金份额总额	4		8	
本报告期基金	277, 604, 044. 6	00 700 170 01	FC 100 7C0 00	7 205 20
总申购份额	4	96, 783, 179. 01	56, 100, 762. 88	7, 305. 32
减:本报告期			100 055 040 0	
基金总赎回份	89, 628, 342. 39	3, 351, 320. 06	122, 855, 348. 3	_
额			8	
本报告期基金				
拆分变动份额	_			_
本报告期期末	388, 525, 974. 4	109, 201, 788. 1	194, 166, 135. 2	10 051 10
基金份额总额	9	7	8	13, 651. 19

注: 总申购份额含红利再投、转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

### §7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

#### §8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注:无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富稳安三个月持有期债券型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富稳安三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富稳安三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》:
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内汇添富稳安三个月持有期债券型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告;
  - 6、中国证监会要求的其他文件。

#### 9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号

汇添富基金管理股份有限公司

#### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站 www. 99fund. com 查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话: 400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司 2024年04月22日