汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）2021年第4季度报告

2021年12月31日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022年01月24日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021年10月01日起至2021年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富养老2030三年持有混合（FOF）
基金主代码	006763
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月27日
报告期末基金份额总额(份)	364,069,250.03
投资目标	本基金随着所设定目标日期的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例，采用成熟的资产配置策略，合理控制投资组合波动风险，追求养老资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用目标日期策略，即随着所设定目标日期2030年的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例。 在严格控制投资组合下行风险的前提下确定大类资产配置比例，并通过全方位的定量和定性分析方法精选出优质基金组成投资组合，以期达到风险收益的优化平衡，实现基

	金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*X+中债综合指数收益率*（1-X）。 X 值详见本基金招募说明书（更新）。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金中基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年10月01日 - 2021年12月31日)
1.本期已实现收益	29,615,512.20
2.本期利润	-3,332,312.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0075
4.期末基金资产净值	557,850,078.09
5.期末基金份额净值	1.5323

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.41%	0.55%	1.44%	0.41%	-1.85%	0.14%

过去六个月	-6.60%	0.82%	-0.66%	0.53%	-5.94%	0.29%
过去一年	2.39%	1.08%	0.81%	0.61%	1.58%	0.47%
过去三年	53.20%	0.95%	37.90%	0.72%	15.30%	0.23%
自基金合同生效日起至今	53.23%	0.95%	38.05%	0.72%	15.18%	0.23%

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

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018 年 12 月 27 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
蔡健林	本基金的基金经理	2018年12月27日		11	国籍:中国。学历:上海交通大学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任太平洋资产管理有限责任公司高级投资经理。2017年8月加入汇添富基金管理股份有限公司。2018年12月27日至今任汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2019年4月29日至今任汇添富养老目标日期2040五年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2019年5月17日至今任汇添富养老目标日期2050五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2021年8月20日至今任汇添富添福睿选稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2021年9月13日至今任汇添富添福盈和稳健养老目标一年持有期混合型

					基金中基金(FOF)的基金经理。2021年10月15日至今任汇添富添福汇盈稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2021年11月9日至今任汇添富添福增长稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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。

4.1.1 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，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和流程，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、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有11次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年四季度，沪深300指数上涨1.5%，创业板指数上涨2.4%，中证500指数上涨3.6%，中证转债指数上涨7.0%；股票基金指数上涨2.1%，纯债基金指数上涨0.8%；恒生指数下跌4.8%。本基金目前是一只偏权益的混合型FOF产品，本期小幅下跌0.41%，表现一般。

回顾四季度，煤炭、钢铁和有色等上游资源品在政策引导下价格回归理性，上游资源品涨幅巨大带动PPI持续上行的情况发生扭转，核心CPI比较温和，央行实施了降准和小幅度降息，流动性保持宽松。出口和制造业投资保持向上趋势，地产投资和社零增速较差，基建投资开始回升，但是力度有限。整体来看，四季度经济压力较大，稳增长的重要性在提高。陆续有高杠杆地产公司破产，坚持房住不炒的大基调不变，结构性政策松动防止地产系统性风险发生。

A股市场延续中小市值风格占优的局面，板块表现结构差异较大。受政策影响的煤炭、钢铁等上游资源品回调幅度较大。医药板块分化较大，高估值的创新药和受集采影响的医疗服务继续下跌，而估值低位的医药流通和中成药表现突出。表现比较好的主要在科技、汽车

和消费板块。元宇宙概念带动，估值相对处于底部的消费电子和传媒游戏行业表现突出。白酒消费税担忧的逐渐淡化，陆续出现食品企业产品提价，消费板块超跌反弹。地产行业系统性风险解除，稳增长预期提升地产产业链配置价值，相关的建筑、建材和轻工制造也表现较好。海外市场，受互联网企业监管政策影响，市场对这类企业长期盈利模式进行修正，中概股可能的退市风险进一步加剧了相关资产的下跌。港股市场也受到一定程度的影响，表现不佳。四季度本基金业绩表现一般，主要受到QDII基金和港股基金的影响，部分沪港深基金的港股资产对净值有影响。另外，美元债基金有小幅拖累；可转债投资有收益贡献。

随着对权益市场不断学习和积累，我对股票资产的价值判断有了更全面的认知，会从行业政策、商业模式质量、估值和行业景气度等多维度去综合评价；组合构建上也会更加注重板块和行业的均衡配置。FOF 投资专注于资产配置和精选基金。资产配置是建立在底层股、债资产深入的基本面研究基础之上，通过对宏观经济和政策的理解和把握，对中观行业和微观公司的跟踪和价值判断，做出前瞻性的价值评估，最终落实到构建合适的组合。科学的基本面研究和价值判断需要建立稳定的投资框架体系，通过多维度的数据指标跟踪和逻辑验证，最终形成严谨的投资判断。

2022 年继续砥砺前行，力求为持有人获取较好回报。衷心感谢广大投资者一如既往的理解和信任。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-0.41%。同期业绩比较基准收益率为1.44%。

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	492,681,803.45	63.83
3	固定收益投资	43,613,700.00	5.65
	其中：债券	43,613,700.00	5.65

	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	80,000,000.00	10.36
	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	83,869,879.18	10.87
8	其他资产	71,733,239.09	9.29
9	合计	771,898,621.72	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	32,506,500.00	5.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	11,107,200.00	1.99

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,613,700.00	7.82

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	019649	21国债01	325,000	32,506,500.00	5.83
2	110082	宏发转债	80,000	11,107,200.00	1.99

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、中国银

保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

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	54,897.00
2	应收证券清算款	70,302,575.46
3	应收股利	-
4	应收利息	752,564.73
5	应收申购款	623,201.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,733,239.09

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基

							金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	004424	汇添富文体娱乐混合	契约型开放式	16,444,968.54	38,967,997.45	6.99	是
2	006408	添富消费升级混合	契约型开放式	13,854,422.47	34,037,545.12	6.10	是

3	501188	汇添富核心精选混合(LOF)	契约型开放式	27,000,000.00	29,632,500.00	5.31	是
4	001061	华夏海外收益债券A(QDII)	契约型开放式	22,963,522.68	29,577,017.21	5.30	否
5	001576	国泰智能装备股票A	契约型开放式	7,165,156.60	24,232,559.62	4.34	否
6	001222	鹏华外延成长混合	契约型开放式	9,343,847.93	21,958,042.64	3.94	否
7	000628	大成高新技术产业股票A	契约型开放	5,286,249.16	21,441,026.59	3.84	否

			式				
8	519918	华夏兴和混合	契约型开放式	4,403,156.54	20,597,966.29	3.69	否
9	006591	广发景明中短债A	契约型开放式	19,553,120.65	20,192,507.70	3.62	否
10	006740	工银尊利中短债债券A	契约型开放式	18,946,475.94	20,119,262.80	3.61	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年10月01日至2021年12月31日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	23,600.00	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	471,130.01	169,651.39
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	2,149.12	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,759,621.28	808,092.03
当期持有基金产生的应支付托	326,396.40	138,768.16

管费（元）		
当期交易基金产生的交易费（元）	8,559.06	1,283.53
当期交易基金产生的转换费（元）	-	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

注：本基金本报告期持有的基金无重大影响事件。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	437,159,596.46
本报告期基金总申购份额	14,286,623.39
减：本报告期基金总赎回份额	87,376,969.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	364,069,250.03

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件；

2、《汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）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。

10.2 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

10.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2022年01月24日