汇添富理财60天债券型证券投资基金2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022年10月26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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富理财 60 天债券
基金主代码	470060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 04 月 18 日
报告期末基金份额总额(份)	217,486,250.58
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在 180 天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。本基金的投资策略主要包括：利率策略、信用策略、个券选择策略、其他衍生工具投资策略。
业绩比较	七天通知存款利率(税后)

基准			
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。		
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	汇添富理财 60 天债券 A	汇添富理财 60 天债券 B	汇添富理财 60 天债券 E
下属分级基金的交易代码	470060	471060	005503
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	74,410,263.38	-	143,075,987.20

注：本基金本报告期无 B 类份额。

§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(2022 年 07 月 01 日 - 2022 年 09 月 30 日)		
	汇添富理财 60 天债券 A	汇添富理财 60 天债券 B	汇添富理财 60 天债券 E
1.本期已实现收益	200,281.32	-	447,556.32
2.本期利润	240,641.53	-	524,803.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0032	-	0.0036
4.期末基金资产净值	79,748,713.98	-	154,141,823.18
5.期末基金份额净值	1.0717	-	1.0773

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

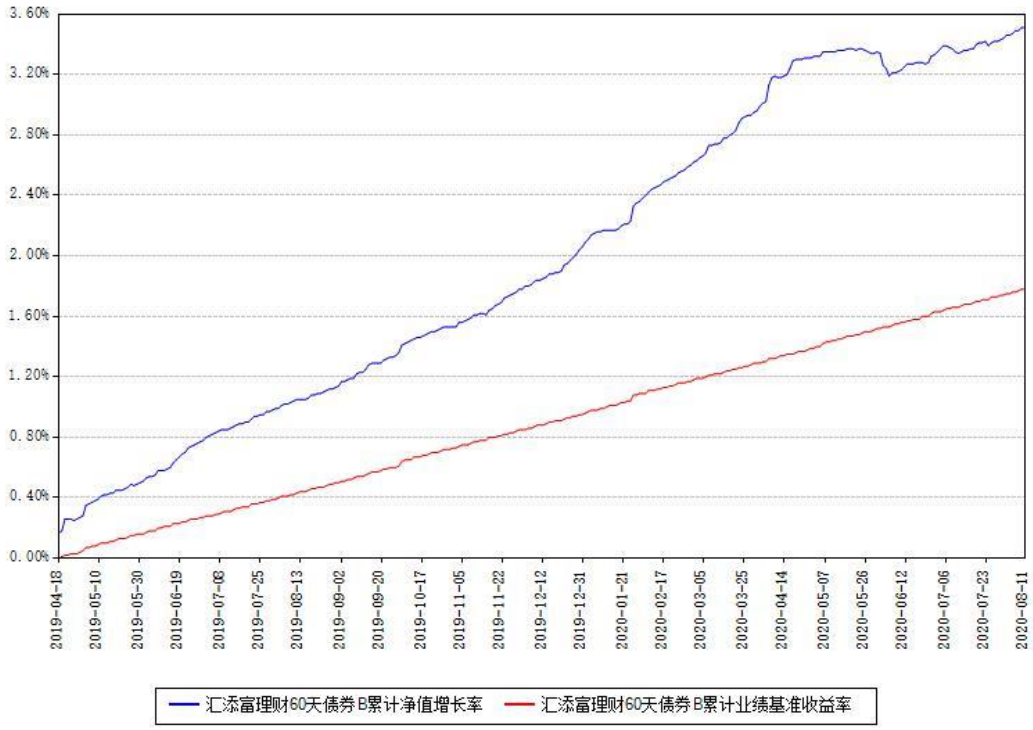
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财 60 天债券 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	0.29%	0.01%	0.34%	0.00%	-0.05%	0.01%
过去六个月	0.85%	0.01%	0.68%	0.00%	0.17%	0.01%
过去一年	1.86%	0.01%	1.35%	0.00%	0.51%	0.01%
过去三年	5.93%	0.02%	4.05%	0.00%	1.88%	0.02%
自基金合同生效日起至今	7.17%	0.02%	4.66%	0.00%	2.51%	0.02%
汇添富理财 60 天债券 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
自 2020-06-01 至 2020-08-11	0.16%	0.02%	0.27%	0.00%	-0.11%	0.02%
自 2020-03-01 至 2020-08-11	0.89%	0.02%	0.61%	0.00%	0.28%	0.02%
自 2019-09-01 至 2020-08-11	2.34%	0.02%	1.28%	0.00%	1.06%	0.02%
自 2019-04-18 至 2020-08-11	3.51%	0.02%	1.78%	0.00%	1.73%	0.02%
汇添富理财 60 天债券 E						
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①－③	②－④

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	0.34%	0.01%	0.34%	0.00%	0.00%	0.01%
过去六个月	0.92%	0.01%	0.68%	0.00%	0.24%	0.01%
过去一年	2.02%	0.01%	1.35%	0.00%	0.67%	0.01%
过去三年	6.41%	0.02%	4.05%	0.00%	2.36%	0.02%
自基金合同生效日起至今	7.73%	0.02%	4.66%	0.00%	3.07%	0.02%

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

汇添富理财60天债券B累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富理财60天债券E累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注：1、本基金由原汇添富理财 60 天债券型证券投资基金于 2019 年 04 月 18 日转型而来；2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起五日，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		
温开强	本基金的基金经理	2020 年 02 月 26 日		10	国籍：中国。学历：天津大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格,CFA。从业经历：曾任长城基金债券交易员、中金基金交易主管，高级经理。2016 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2016 年 8 月 30 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富货币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2022 年 3 月 31 日任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富添富通货币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至今任汇添富现金宝货

					币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2018 年 8 月 7 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理助理。2018 年 8 月 7 日至今任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 25 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2019 年 1 月 25 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理。2022 年 3 月 31 日至今任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月 10 日至今任汇添富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 26

					日至今任汇添富稳瑞 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理。
徐寅喆	本基金的基金经理，现金管理部总经理	2018 年 05 月 04 日		14	国籍：中国。学历：复旦大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任债券交易员、固定收益基金经理助理，现任现金管理部总经理。2014 年 8 月 27 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月 27 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。2014 年 11 月 26 日至今任汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理。2014 年 12 月 23 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富全额宝货币市场基金的基金

					经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至 2022 年 3 月 31 日任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至 2020 年 8 月 18 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币市场基金的基金经理。2019 年 9 月 10 日至今任汇添富汇鑫浮动净值型货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。2021 年 6 月 24 日至今任汇添富稳利 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 25 日至今任汇添富稳福 60 天滚

					动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理。2022年5月9日至今任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理。

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。

4.1.1 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 15 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

2022 年三季度国内经济运行较二季度有明显改善。尽管面临的外部环境依然复杂严峻，但国内经济发展坚持稳中求进的总基调，有效巩固了经济回升的向好趋势。宏观政策持续发力，扩大需求，积极用好地方政府专项债券，高效使用政策性银行新增信贷和基础设施建设投资基金。货币政策加大稳健的实施力度，保持流动性合理充裕，8 月中旬进行了降息，加大对企业的信贷支持。

本报告期内银行间市场流动性整体充裕，资金利率中枢稳中有降，季末因国庆长假资金利率短暂飙升。报告期内，债券市场出现显著的投资机会。短端债券品种收益率 7 月快速下行后进入窄幅波动行情。本基金根据对货币政策和宏观经济的研究，投资操作灵活稳健，采取滚动到期滚动配置的策略。资产选择上，注重信用风险的控制，以配置短久期的高等级信用债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富理财 60 天债券 A 类份额净值增长率为 0.29%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。本报告期汇添富理财 60 天债券 B 类份额为 0。本报告期汇添富理财 60 天债券 E 类份额净值增长率为 0.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

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	219,658,606.34	93.81
	其中：债券	219,658,606.34	93.81
	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	10,000,863.01	4.27
	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	4,459,970.59	1.90
8	其他资产	21,801.32	0.01
9	合计	234,141,241.26	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	21,980,117.58	9.40

2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,806,182.25	26.00
	其中：政策性金融债	50,624,678.14	21.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,494,149.04	30.14
6	中期票据	56,511,956.98	24.16
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,866,200.49	4.22
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	219,658,606.34	93.92

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	101901449	19 汇金 MTN017	200,000	20,619,733.70	8.82
2	102001078	20 沪港务 MTN001	200,000	20,199,940.82	8.64
3	220206	22 国开 06	200,000	20,125,358.90	8.60
4	229917	22 贴现国债 17	120,000	11,983,948.35	5.12
5	1282400	12 汉城投 MTN2	100,000	10,519,252.05	4.50

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、中国农业发展银行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	1,791.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,010.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	21,801.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富理财 60 天债券 A	汇添富理财 60 天债券 B	汇添富理财 60 天债券 E
本报告期期初基金份额总额	76,511,886.53	-	148,107,801.72
本报告期基金总申购份额	364,453.05	-	4,379,746.70
减：本报告期基金总赎回份额	2,466,076.20	-	9,411,561.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	74,410,263.38	-	143,075,987.20

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理财 60 天债券型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富理财 60 天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、报告期内汇添富理财 60 天债券型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号　汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 10 月 26 日