

汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 | 汇添富鑫利定开债 |
| 基金主代码 | 003532 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 01 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 1,016,834,256.04 |
| 投资目标 | 在追求本金安全的基础上，本基金力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。 |
| 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、可转换债券及可交换债券投资策略、中小企业私募债投 |

| | | |
|--------------------|---|------------|
| | 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。 | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富鑫利定开债 A | 汇添富鑫利定开债 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003532 | 003533 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 1,016,802,386.68 | 31,869.36 |

§ 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) | |
|-----------------|--------------------------------|------------|
| | 汇添富鑫利定开债 A | 汇添富鑫利定开债 C |
| 1. 本期已实现收益 | 10,010,875.03 | 294.58 |
| 2. 本期利润 | 12,340,378.43 | 371.57 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0121 | 0.0117 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,074,387,987.01 | 35,438.05 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0566 | 1.1120 |

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

| 汇添富鑫利定开债 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 | 1.16% | 0.03% | 0.73% | 0.05% | 0.43% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.94% | 0.03% | 1.03% | 0.04% | 0.91% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.42% | 0.03% | 1.73% | 0.05% | 1.69% | -0.02% |
| 过去三年 | 9.90% | 0.03% | 3.81% | 0.07% | 6.09% | -0.04% |
| 自基金合同生效日起至今 | 12.55% | 0.04% | 3.99% | 0.06% | 8.56% | -0.02% |
| 汇添富鑫利定开债 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 | 1.06% | 0.03% | 0.73% | 0.05% | 0.33% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.75% | 0.03% | 1.03% | 0.04% | 0.72% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.02% | 0.03% | 1.73% | 0.05% | 1.29% | -0.02% |
| 过去三年 | 8.60% | 0.03% | 3.81% | 0.07% | 4.79% | -0.04% |
| 自基金合同生效日起至今 | 10.90% | 0.04% | 3.99% | 0.06% | 6.91% | -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

汇添富鑫利定开债A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富鑫利定开债C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金由原汇添富鑫利债券型证券投资基金于 2019 年 01 月 16 日转型而来。
2、本基金建仓期为《基金合同》生效之日起 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 | | |
| 何旻 | 本基金的 基金经理 | 2021 年 08 月 17 日 | | 24 | <p>国籍：中国。学历：英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CFA, FRM。</p> <p>从业经历：曾任国泰基金管理有限责任公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理、基金经理，固定收益部负责人；金元比联基金管理有限责任公司基金经理。2011 年 1 月加入汇添富资产管理（香港）有限公司，2012 年 2 月 17 日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2013 年 11 月 22 日至今任汇添富安心中国债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 1 月 21 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>券投资基金的基金经理。2016 年 3 月 11 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2022 年 9 月 2 日任汇添富精选美元债债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月 24 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 6 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 29 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 4 月 15 日至今任汇添富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月 19 日至 2020 年 7 月 8 日任汇添</p> |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月 14 日至今任汇添富中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 8 月 3 日至 2022 年 6 月 9 日任汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2021 年 8 月 17 日至今任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 11 日至今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。2021 年 10 月 15 日至今任汇添富彭博中国政策性银行债券 1-3 年指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 29 日至今任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 6 月 9 日至今任汇添富中短债债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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合规守信情况说明

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 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。

4.3.2 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 年第三季度，国内经济呈现弱复苏的格局。消费品价格指数同比涨幅平稳，核心 CPI 指数稳中回落。工业品价格指数 PPI 呈现下降趋势。中国制造业采购经理指数 PMI 逐月回升，包括生产和新订单分项指数逐步转好。投资方面，总体的固定资产投资累计同比增速略有回落，回落主要来自房地产开发投资累计同比增速和民间固定资产投资累计同比增速两个分项的回落，而基础设施建设的固定资产投资完成额累计同比增速上升。从房地产的细项数据上看，70 个大中城市商品房价格指数当月同比回落幅度逐月扩大，房屋新开工面积、商品房销售面积、房地产开发投资完成额同比下降幅度都在扩大。数据显示房地产行业依然处于整体收缩的状态。货币政策方面，2022 年第三季度央行仍然偏松，银行间市场资金面宽裕。在 8 月份，央行调降了银行间公开市场操作 7 天逆回购利率和 MLF 利率，以及 1 年期和 5 年期 LPR 的利率。货币供应量方面，M1 和 M2 月度增速较上季度略有上升。美元兑人民币汇率在第三季度呈现较快升值。

本报告期内，债券市场基本在流动性宽松的环境中运行，7 月和 8 月中债综合指数上行较快，9 月份受资金面和经济数据转好的影响开始震荡。

本基金在报告期内，坚持以配置高等级信用债和利率债为主，择机进行波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富鑫利定开债 A 类份额净值增长率为 1.16%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。本报告期汇添富鑫利定开债 C 类份额净值增长率为 1.06%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

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

本基金已连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满二百人，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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 | 1,066,372,206.12 | 99.20 |
| | 其中：债券 | 1,066,372,206.12 | 99.20 |
| | 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 | 7,767,004.81 | 0.72 |
| | 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 | 868,810.94 | 0.08 |
| 8 | 其他资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,075,008,021.87 | 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 | 49,980,846.15 | 4.65 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,248,465.75 | 2.82 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,248,465.75 | 2.82 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|-------|
| 4 | 企业债券 | 20,295,490.41 | 1.89 |
| 5 | 企业短期融资券 | 162,005,243.29 | 15.08 |
| 6 | 中期票据 | 654,626,906.32 | 60.93 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 149,215,254.20 | 13.89 |
| 9 | 地方政府债 | - | - |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 1,066,372,206.12 | 99.25 |

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 | 112210051 | 22 兴业银行 CD051 | 1,000,000 | 99,319,668.49 | 9.24 |
| 2 | 102002066 | 20 汇金 MTN010A | 500,000 | 52,323,424.66 | 4.87 |
| 3 | 042100473 | 21 国新控股 CP001 | 500,000 | 51,287,928.77 | 4.77 |
| 4 | 102280756 | 22 国电 MTN001 | 500,000 | 51,185,317.81 | 4.76 |
| 5 | 102280780 | 22 东航股 MTN001 | 500,000 | 50,884,000.00 | 4.74 |

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：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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，兴业银行股份有限公司、广发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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | - |

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 | 汇添富鑫利定开债 A | 汇添富鑫利定开债 C |
|---------------|------------------|------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,016,802,396.35 | 31,869.36 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 9.67 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,016,802,386.68 | 31,869.36 |

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

单位：份

| | 汇添富鑫利定开债 A | 汇添富鑫利定开债 C |
|---------------------------|--------------|------------|
| 报告期初持有的基金份额 | 9,259,259.26 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 9,259,259.26 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.91 | - |

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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末运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|--------------|------------------|--------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 9,259,259.26 | 0.91 | 9,259,259.26 | 0.91 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 99.94 | 0.00 | - | - | |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | |
| 其他 | 30,501.45 | 0.00 | - | - | |
| 合计 | 9,289,860.65 | 0.91 | 9,259,259.26 | 0.91 | |

§ 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

| 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 | 2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 | 1,007,514,774.56 | - | - | 1,007,514,774.56 | 99.08 |

| | | | | | | |
|--|--|-----------|--|--|--|--|
| | | 月 30 日 | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | |
| <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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，很可能出现开放期最后一日基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元的情形，按照法律法规与《基金合同》的约定，本基金将面临提前终止基金合同的风险。若未触发前述提前终止情形，持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，本基金有可能在运作过程中资产规模长期低于 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。</p> | | | | | | |

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鑫利债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富鑫利定期开放债券型发起式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、报告期内汇添富鑫利定期开放债券型发起式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。

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 10 月 26 日