汇添富盛安 39 个月定期开放债券型证券投资 基金 2025 年第 3 季度报告

2025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: 兴业银行股份有限公司

送出日期: 2025年10月28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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 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 2025 年 07 月 01 日起至 2025 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 | 汇添富盛安 39 个月定开债 | | | | |
|---------------|----------------------|--|--|--|--|
| 基金主代码 | 007948 | | | | |
| 基金运作方式 | | | | | |
| 基金合同生效日 | 2019年09月24日 | | | | |
| 报告期末基金份额总额(份) | 7, 971, 731, 269. 48 | | | | |
| 投资目标 | 在严格管理风险的基础上,力求实现资产的 | | | | |
| 投页日 你 | 长期稳健增值。 | | | | |
| | 封闭期内采用买入并持有到期投资策略,所 | | | | |
| | 投资金融资产以收取合同现金流量为目的, | | | | |
| | 并持有到期,所投资资产不晚于封闭期的到 | | | | |
| | 期日。本基金封闭期内的投资策略主要包 | | | | |
| 投资策略 | 括: 类属资产配置策略、普通债券投资策 | | | | |
| 1) 以贝尔昭 | 略、回购融资策略、再投资策略。开放期 | | | | |
| | 内,为满足投资者申赎需求,本基金将保持 | | | | |
| | 较高的组合流动性,在遵守本基金有关投资 | | | | |
| | 限制与投资比例的前提下,通过合理配置以 | | | | |
| | 积极防范流动性风险,做好流动性管理。 | | | | |

| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的银行三年期定期存款利率(税后)+1% |
|--------|---|
| 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 | 兴业银行股份有限公司 |

§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(2025年07月01日 - 2025年09月30日) |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 60, 151, 377. 14 |
| 2. 本期利润 | 60, 151, 377. 14 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0075 |
| 4. 期末基金资产净值 | 8, 120, 313, 789. 77 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0186 |

- 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

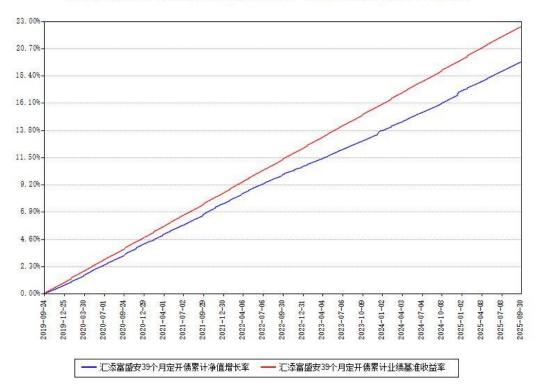
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.74% | 0.01% | 0.95% | 0.01% | -0. 21% | 0.00% |
| 过去六 个月 | 1.46% | 0.01% | 1.88% | 0.01% | -0. 42% | 0.00% |
| 过去一 年 | 3.03% | 0. 01% | 3.75% | 0.01% | -0. 72% | 0.00% |

| 过去三 | 8. 67% | 0. 01% | 11. 25% | 0. 01% | -2. 58% | 0.00% |
|------------------------|---------|--------|---------|--------|---------|-------|
| 过去五 年 | 15. 76% | 0.01% | 18.75% | 0.01% | -2.99% | 0.00% |
| 自基金 合同生 效起至 今 | 19. 59% | 0. 01% | 22. 57% | 0.01% | -2. 98% | 0.00% |

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

汇添富盛安39个月定开债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(2019年09月24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。

§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 | 说明 |
|----|----|-------------|--------|----|
|----|----|-------------|--------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | (年) | |
|----|------------|-------------|------|-----|---|
| 刘宁 | 本基金债 地理的 理 | 2025年08月11日 | | 21 | 国学学硕格基格历月月基公券资投金年添股司部理月汇个券基理年至鑫型金理月汇券基理月汇个券基理籍历士士:金。:至就金司交经资经6富份,总。16富持证的理月任纯券基20日富证的20日富持证的20日富,20日富,20日富,20日富,20日富,20日富,20日富,20日富, |

| | | | | | 月11日至今任 汇添富鑫远债 券型证券投资 基金的基金经 理。2025年8 月11日至今任 汇添富盛安39 个月定期开放 债券型证券投 资基金的基金 经理。 |
|----|----------|-------------|-------------|----|--|
| 胡娜 | 本基金的基金经理 | 2019年09月24日 | 2025年08月11日 | 16 | 国学经硕格基格历 20职证部交 20 入理曾员助理年添股任 20 日月富开券基理月年汇籍历大士:金。:12 于券,易12 银有担、理职 11 富份基17 至 2 年放投金。25 月富中西经从券业业99 期泰定任职 11 基公研金基。加管公理月年混资经 20 日月富国南济业投资经年间联收自务 11 金司究经金 20 入管公理月年汇定型金助年 20 日 2 鑫明学资资。至任合益营;月管,理经6 汇理司。25 7 添期证的 4 77 6 成,财学资资。至任合益营;加 |

| | | |
|--|--|--------------|
| | | 券型证券投资 |
| | | 基金的基金经 |
| | | 理助理。2017 |
| | | 年7月3日至 |
| | | 2019年9月17 |
| | | 日任汇添富年 |
| | | 年泰定期开放 |
| | | 混合型证券投 |
| | | 资基金的基金 |
| | | 经理。2017 年 |
| | | 7月3日至 |
| | | 2020年3月23 |
| | | |
| | | 日任汇添富鑫 |
| | | 瑞债券型证券 |
| | | 投资基金的基 |
| | | 金经理。2018 |
| | | 年2月13日至 |
| | | 2019年9月17 |
| | | 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。2018 |
| | | 年 4 月 16 日至 |
| | | 2023年3月2 |
| | | 日任汇添富鑫 |
| | | 盛定期开放债 |
| | | 券型发起式证 |
| | | 券投资基金的 |
| | | 基金经理。 |
| | | 2018年7月6 |
| | | 日至 2024 年 11 |
| | | 月 19 日任汇添 |
| | | 富纯债债券型 |
| | | 证券投资基金 |
| | | (LOF) 的基金 |
| | | 经理。2019年 |
| | | 8月29日至 |
| | | 2025年8月11 |
| | | 日任汇添富鑫 |
| | | 永定期开放债 |
| | | 券型发起式证 |
| | | 券投资基金的 |
| | | 基金经理。 |
| | | 2019年9月24 |
| | | 日至 2025 年 8 |
| | | 日土 2020 牛 0 |

| 月11 日任汇添 富盛安 39 个月 定期 | | | |
|---|--|--|--------------|
| 定期开放债券型证券投资基金的基金企业。2021年9月2日至2022年10月19日任汇解液放债券型发验基金。2021年9月2日日在汇期无式证的基金经理。2021年9月2日日月19日任汇券型金的基金全理。2021年9月2日日前,当日债券基金的基金全组。2021年12月24日至2023年3月15日代汇添富产品的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添加货基金经过。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添加货基金经过。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添加货基金经过。2022年1月21日至2023年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月7日至2025年3 | | | 月 11 日任汇添 |
| 型证券投资基金的基金经理。2021年9月2日至2022年10月19日任汇添益益定期开放证券基益定期开放证券基金经理。2021年9月2日至2022年10月19日任汇添款证券投资基金的基金金经理。2021年12月24日至2023年12月24日至2023年12月24日至2023年13月15日任汇添含了信用债 (1-3年) 指数发起金的基金金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添购含了资格。 发起或证券投资基金金经理。2022年1月月21日至2023年3月2日任汇添购债券投资基金。2022年1月月2日至2023年3月4日至2025年3月4 | | | 富盛安 39 个月 |
| 金的基金经 理。2021年9 月2日至2022年10月19日 任汇添富鑫 定期无证券 投资基金的基金经理。2021年9月2日至2022年10月 19日任汇添富 鑫远债券盈逾 基金的基金金的基金金的基金金的基金金的基金金的基金金的基金金的基金金的基金。 2021年12月24日至2023年1月24日至2023年3月1日任市场。 10日本 10日本 10日本 10日本 10日本 10日本 10日本 10日本 | | | 定期开放债券 |
| 理。2021年9 月2日至2022年10月19日 任汇添富益 定期开成债券 型发起或。数据。2021年9月2日至 2022年10月 19日任汇添富 鑫远债券基金的 基金经理。2021年12月 24日至2023年 3月15日任汇 添富中债。14日 (1-3本证券投 资基理。2021年1月21日至 2023年3月2日任汇 添高等研 发起或。2022年1月21日至 2023年3月2日任汇 为股型发起金 经理。2022年1月21日任 2023年3月2日任汇 券投资型。2022年1月21日任 第 发型发起金的 基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任征债债 券型证券投金经理。2023年3月7日至2023年3月7日至2023年3月7日至2025 | | | 型证券投资基 |
| 月2日至2022年10月19日任汇添富鑫蒙债债券型投表式。的基金经理。2021年9月2日至2022年10月19日任汇添富鑫或债券型发表或的基金经理。2022年10月19日任汇添高鑫远货基金的基金经理。2021年12月24日至2023年3月15日任市场隐含评价,指数发起式的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添富鑫处定理。2022年1月21日至2023年3月2日日汇流高鑫处定期提起。由于1月2日至2025年3月4日任汇债债券型证券投资基金的基金经理。2025年3月4日任废债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至2025年3月4日至6债债券型证券金经理。2023年3月7日至2023年3月7日至2025年3月7日至2025 | | | 金的基金经 |
| 年10月19日 任江添富益 定期开放 企数型。2021 年9月2日至 2022年10月 19日任汇海高 鑫近债券基金的 基金经理。 2021年12月 24日至 2023年 3月15日任汇 添高评级用债 (1-3年)指数 发起式证券基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2日任汇期开放或 券型资基金。 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2日任汇海高丰利短债 券型改基金。 月1日至至2025年3月4日任汇添高丰利短债 券型证券基金经理。 2022年5月24日至2025年3月4日任汇添高丰利短债债 券型证券基金经理。 | | | 理。2021年9 |
| 任汇添富鑫益 定期开放记式的基金交理。2021 年9月2日至 2022年10月 19日任汇》型。 2021年12月 24日至 2023年 3月15日任市市人 隐含存理。 2021年12月 24日至 2023年 3月15日代汇 添高中债 (1-3年) 持数 发起或的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任期用改债 券型资基金 处理。2022年 1月2日日至 2023年3月2日任工厂 参校理。2022年 1月2日日至 2022年3月4日任厂债债资基金的基金 经理。2022年3月4日任短债债资基金的基金 经理。2022年3月4日任短债债资基金的基金经理。2023年3月7日至 2025 | | | 月 2 日至 2022 |
| 任汇添富鑫益 定期开放记式的基金交理。2021 年9月2日至 2022年10月 19日任汇》型。 2021年12月 24日至 2023年 3月15日任市市人 隐含存理。 2021年12月 24日至 2023年 3月15日代汇 添高中债 (1-3年) 持数 发起或的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任期用改债 券型资基金 处理。2022年 1月2日日至 2023年3月2日任工厂 参校理。2022年 1月2日日至 2022年3月4日任厂债债资基金的基金 经理。2022年3月4日任短债债资基金的基金 经理。2022年3月4日任短债债资基金的基金经理。2023年3月7日至 2025 | | | 年 10 月 19 日 |
| 定期开放债券型发起式的基金经理。2021年9月2日至2022年10月19日任汇深富鑫远债券投资基金的基金经理。2021年12月24日至2023年3月15日代市场隐含评级 AA+及以上信用债一市场隐含评级 AA+及以上信用债价。19年数发发基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添查基、2022年1月21日至2023年3月2日任汇添赛投资基金。2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债券型证券基金经理。2022年3月7日至2025年3月7日至2025年3月7日至2025 | | | |
| 投资基金的基金经理。2021年9月2日至2022年10月19日任汇添富鑫远债券基金的基金经理。2021年12月24日至2023年3月15日任汇添富中债一市场隐含评级A的基金的基金的基金的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添添放货券型发起金的基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任汇债券投资基金的基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任汇债债券型证券金经理。2023年3月7日至2025年3月7日至2025 | | | 定期开放债券 |
| 投资基金的基金经理。2021年9月2日至2022年10月19日任汇添富鑫远债券基金的基金经理。2021年12月24日至2023年3月15日任汇添富中债一市场隐含评级A的基金的基金的基金的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添添放货券型发起金的基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任汇债券投资基金的基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任汇债债券型证券金经理。2023年3月7日至2025年3月7日至2025 | | | 型发起式证券 |
| 金经理。2021年9月2日至2022年10月19日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2021年12月24日至2023年3月15日任汇添富中债-市场隐含评级 AA+及以上信用债(1-3年)指数发起式证券投资基金的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添富。高丰利应债债债债券型证券投资基金的基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任汇债债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025 | | | 投资基金的基 |
| 2022 年 10 月 19 日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。 2021 年 12 月 24 日至 2023 年 3 月 15 日任汇添富申课级 AA+及以上信用债 (1-3 年)指数 | | | |
| 2022 年 10 月 19 日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。 2021 年 12 月 24 日至 2023 年 3 月 15 日任汇添富申课级 AA+及以上信用债 (1-3 年)指数 | | | 年9月2日至 |
| 19 日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。 2021 年 12 月 24 日至 2023 年 3 月 15 日任汇添富中债—市场隐含评级 A债 (1-3 年)指数发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 21 日至 2023 年 3 月 2 日任汇添加金债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2022 年 5 月 24 日至 2025 年 3 月 4 日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | |
| 鑫远债券型证券投资基金的基金经理。 2021年12月 24日至2023年3月15日任汇添富中债一市场隐含评级 AA+及以上信用债(1-3年)指数发起式证券投资基金的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添富企业,2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025年3月7日至2025年3月7日至2025年3月7日至2025年3月7日至2025年3月7日至2025 | | | |
| 券投资基金的基金经理。 2021年12月 24日至2023年3月15日任汇 添富中债-市场隐含评级 AA+及以上信用债 (1-3年)指数 发起式证券投资基金的基金 经理。2022年1月21日至 2023年3月2日任汇添富。 弘定期开放证证券投资基金的基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025 | | | |
| 2021年12月 24日至2023年3月15日任汇添富中债-市场隐含评级 AA+及以上信用债(1-3年)指数发起式证券投资基金的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添富。3月2日任汇添加量。2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025 | | | |
| 2021年12月 24日至2023年3月15日任汇添富中债-市场隐含评级 AA+及以上信用债(1-3年)指数发起式证券投资基金的基金经理。2022年1月21日至2023年3月2日任汇添富。3月2日任汇添加量。2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025 | | | 基金经理。 |
| 3月15日任汇添富中债-市场 隐含评级 AA+及 以上信用债 (1-3年)指数 发起式证券投资基金的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至 2025年3 月4日任汇添富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经理。2023年3 月7日至 2025 | | | 2021年12月 |
| 3月15日任汇添富中债-市场 隐含评级 AA+及 以上信用债 (1-3年)指数 发起式证券投资基金的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至 2025年3 月4日任汇添富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经理。2023年3 月7日至 2025 | | | 24 日至 2023 年 |
| 隐含评级 AA+及以上信用债 (1-3年)指数 发起式证券投 资基金的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至 2025年3 月4日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023年3 月7日至 2025 | | | 3月15日任汇 |
| 以上信用债 (1-3年)指数 发起式证券投 资基金的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至2025年3 月4日任汇添富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023年3 月7日至2025 | | | 添富中债-市场 |
| (1-3年)指数 发起式证券投 资基金的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至 2025年3 月4日任汇添富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经理。 2023年3 月7日至 2025 | | | 隐含评级 AA+及 |
| 发起式证券投资基金的基金经理。2022年 1月21日至2023年3月2日任汇添富鑫 弘定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债 券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025年3 | | | 以上信用债 |
| 资基金的基金 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至 2025年3 月4日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经理。 2023年3 月7日至 2025 | | | (1-3年)指数 |
| 经理。2022年 1月21日至 2023年3月2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至2025年3 月4日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023年3 月7日至2025 | | | 发起式证券投 |
| 1月21日至2023年3月2日任汇添富鑫 弘定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025 | | | 资基金的基金 |
| 2023 年 3 月 2 日任汇添富鑫 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022 年 5 月 24 日至 2025 年 3 月 4 日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 经理。2022年 |
| 日任汇添富鑫弘定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022年5月24日至2025年3月4日任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年3月7日至2025 | | | 1月21日至 |
| 弘定期开放债 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022年5月24 日至2025年3 月4日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023年3 月7日至2025 | | | 2023年3月2 |
| 券型发起式证 券投资基金的 基金经理。 2022 年 5 月 24 日至 2025 年 3 月 4 日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 日任汇添富鑫 |
| 券投资基金的基金经理。 2022年5月24 日至2025年3 月4日任汇添富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023年3 月7日至2025 | | | 弘定期开放债 |
| 基金经理。 2022年5月24 日至2025年3 月4日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023年3 月7日至2025 | | | 券型发起式证 |
| 2022 年 5 月 24 日至 2025 年 3 月 4 日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 券投资基金的 |
| 日至 2025 年 3 月 4 日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 基金经理。 |
| 月 4 日任汇添 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 2022年5月24 |
| 富丰利短债债 券型证券投资 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 日至 2025 年 3 |
| 券型证券投资 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 月4日任汇添 |
| 基金的基金经 理。2023 年 3 月 7 日至 2025 | | | 富丰利短债债 |
| 理。2023年3 月7日至2025 | | | 券型证券投资 |
| 月7日至2025 | | | 基金的基金经 |
| | | | 理。2023年3 |
| 年3月4日任 | | | 月7日至2025 |
| | | | 年3月4日任 |
| 汇添富稳丰中 | | | 汇添富稳丰中 |

| | | 短债债券型证 |
|--|--|-------------|
| | | 券投资基金的 |
| | | 基金经理。 |
| | | 2023年4月25 |
| | | 日至 2024 年 5 |
| | | 月9日任汇添 |
| | | 富稳合4个月 |
| | | 持有期债券型 |
| | | 证券投资基金 |
| | | 的基金经理。 |

注: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。

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。

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,力争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%的次数为 0。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

报告期内,外部环境更趋复杂严峻,世界经济增长动能减弱,贸易壁垒增多,主要经济体经济表现有所分化,通胀走势和货币政策调整存在不确定性。我国经济运行稳中有进,社会信心持续提振,高质量发展取得新成效,但仍面临国内需求不足、物价低位运行等困难和挑战,核心 CPI 维持修复,PPI 环比亦有所修复。

报告期内,财政政策积极,超长国债和超长地方政府债发行量较二季度提升,稳投资、促消费等方面持续发力;货币政策方面通过买断式逆回购、MLF、公开市场逆回购等方式持续呵护流动性,并对发行方式进行改革,流动性整体呈现"中性偏松,不满不溢"的态度。

报告期内债市熊态尽显,收益率曲线熊平,10年国债上行超20bp,超长上行超30bp。季初雅鲁藏布江下游水电项目开工,"反内卷交易"主线下权益及商品市场大涨,看股做债逻辑延续,对债市形成持续性压制,即使股市短暂走弱,债券市场也未现明显反弹,同时叠加税收政策调整等因素,国债期货10年、30年主力合约双双跌破年线。9月监管政策变化因素导致债券基金赎回频频发生,带动债市持续调整,债基赎回恐慌不断,长端利率冲击年内高点。随着债市风险不断加剧,市场对国债买卖重启呼声日渐高涨,季末呵护流动性平稳跨季。信用利差仍在低位,中长久期信用债表现更弱,二永品种在季度末的赎回冲击中影响

较大。

报告期内,本基金根据基金特性,维持较高杠杆,并通过均衡银行间和交易所融资结构,控制融资成本。

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 0.74%。同期业绩比较基准收益率为 0.95%。

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 | 12, 647, 803, 274. 85 | 98. 84 |
| | 其中:债券 | 12, 647, 803, 274. 85 | 98. 84 |
| | 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 | 148, 130, 582. 95 | 1.16 |
| 8 | 其他资产 | _ | _ |
| 9 | 合计 | 12, 795, 933, 857. 80 | 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 | _ | - |
| 2 | 人动住光 | 12, 239, 377, 529 | 150.70 |
| 3 | 金融债券 | . 22 | 150. 73 |
| | 甘中 · 改签州入副/生 | 9, 121, 727, 824. | 110 00 |
| | 其中: 政策性金融债 | 41 | 112. 33 |
| 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) | _ | - |
| 8 | 同业存单 | _ | - |
| 9 | 地方政府债 | 408, 425, 745. 63 | 5. 03 |
| 10 | 其他 | _ | - |
| 11 | <u></u> | 12, 647, 803, 274 | 155. 76 |
| 11 | 合计 | . 85 | 133.70 |

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 | 210403 | 21 农发 | 42, 100, 000 | 4, 295, 810, 103. 56 | 52. 90 |

| | | 03 | | | |
|---|---------|-------|---------------|----------------------|--------|
| 0 | 018085 | 农发 | 97 900 000 | 2, 769, 923, 777. 81 | 34. 11 |
| 2 | | 2301 | 27, 200, 000 | | |
| 3 | 010000 | 21 国开 | 开 7, 200, 000 | 735, 811, 695. 22 | 0.00 |
| 3 | 210203 | 03 | | | 9.06 |
| | 2228058 | 22 中国 | 7, 000, 000 | 712, 868, 979. 57 | 8. 78 |
| | | 银行绿 | | | |
| 4 | | 色金融 | | | |
| | | 债 02 | | | |
| 5 | 160303 | 16 进出 | 6, 400, 000 | 654, 523, 619. 14 | 9 06 |
| | | 03 | | | 8.06 |

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,中国农业发展银行、国家开发银行、中国银行股份有限公司、中国进出口银行、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、上海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

注: 本基金本报告期末无其他资产。

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

| 本报告期期初基金份额总额 | 7, 971, 731, 261. 60 |
|---------------|----------------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 7.88 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7, 971, 731, 269. 48 |

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

| 投 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|----|------|---|---|------------|-----|
| 资 | 序 | 持有 | | 申 | 赎 | | 份额占 |
| 者 | / 号 | 基金 | 期初份额 | 购 | 口 | 持有份额 | 比 |
| 类 | 亏 | 份额 | | 份 | 份 | | (%) |

| 别 | | 比例 | | 额 | 额 | | |
|---|---|------|----------------------|---|---|----------------------|--------|
| | | 达到 | | | | | |
| | | 或者 | | | | | |
| | | 超过 | | | | | |
| | | 20%的 | | | | | |
| | | 时间 | | | | | |
| | | 区间 | | | | | |
| | | 2025 | | | | | |
| | | 年7 | | | | | |
| | 1 | 月1 | 2, 999, 999, 000. 00 | - | _ | 2, 999, 999, 000. 00 | 37. 63 |
| 机 | | 日至 | | | | | |
| 构 | | 2025 | | | | | |
| | | 年9 | | | | | |
| | | 月 30 | | | | | |
| | | 日 | | | | | |

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。

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盛安39个月定期开放债券型证券投资基金募集的文件:
- 2、《汇添富盛安 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

- 3、《汇添富盛安39个月定期开放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、报告期内汇添富盛安 39 个月定期开放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 2025年10月28日