汇添富丰利短债债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 01 月 20 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 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 2022 年 10 月 01 日起至 2022 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	汇添富丰利短债
基金主代码	006893
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 01 月 18 日
报告期末基金份额总额(份)	3,403,459,204.36
投资目标	本基金在严格管理风险的前提上，主要投资短期债券，力求超越业绩比较基准的投资回报。
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、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	中债总财富(1-3 年)指数收益率*80%+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	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富丰利短债 A	汇添富丰利短债 C	汇添富丰利短债 D
下属分级基金的交易代码	006893	011057	016427
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	630,350,568.08	2,773,106,802.34	1,833.94

§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 10 月 01 日 - 2022 年 12 月 31 日)		
	汇添富丰利短债 A	汇添富丰利短债 C	汇添富丰利短债 D
1.本期已实现收益	2,844,392.04	12,645,189.86	170.94
2.本期利润	1,201,695.85	2,705,888.89	-349.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0017	0.0008	-0.0068
4.期末基金资产净值	689,563,521.38	3,021,532,944.64	2,022.89
5.期末基金	1.0939	1.0896	1.1030

份额净值			

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

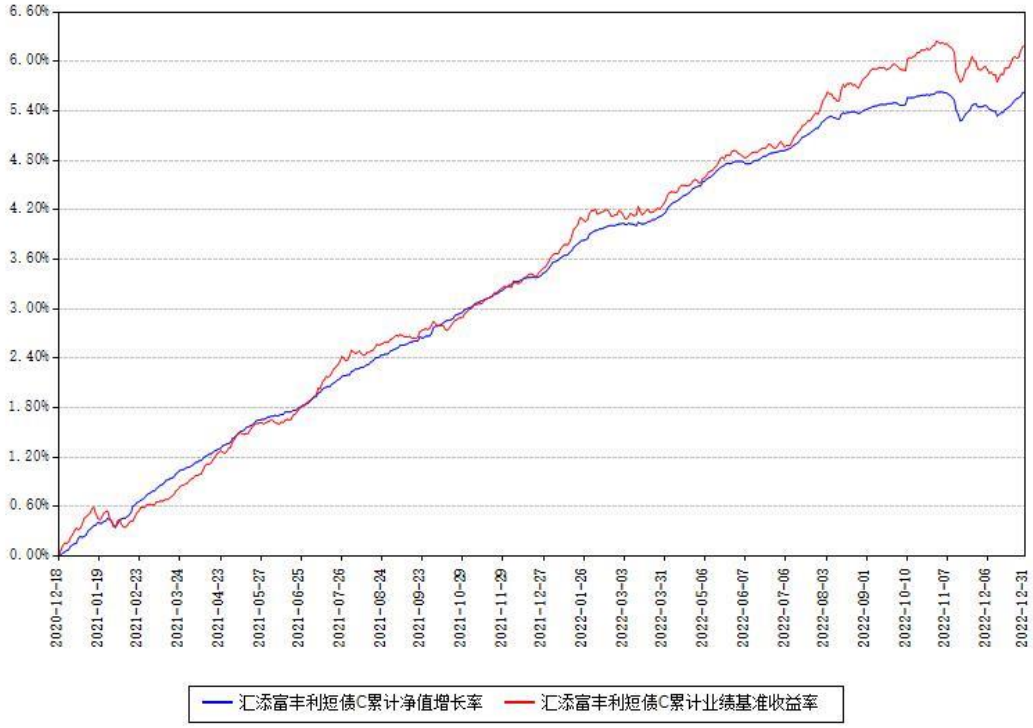
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富丰利短债 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	0.19%	0.03%	0.29%	0.05%	-0.10%	-0.02%
过去六个月	0.78%	0.02%	1.13%	0.04%	-0.35%	-0.02%
过去一年	2.24%	0.02%	2.48%	0.04%	-0.24%	-0.02%
过去三年	6.99%	0.02%	8.34%	0.04%	-1.35%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	9.39%	0.02%	11.57%	0.04%	-2.18%	-0.02%
汇添富丰利短债 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	0.15%	0.03%	0.29%	0.05%	-0.14%	-0.02%
过去六个月	0.69%	0.02%	1.13%	0.04%	-0.44%	-0.02%
过去一年	2.04%	0.02%	2.48%	0.04%	-0.44%	-0.02%
自基金合同生	5.63%	0.02%	6.19%	0.03%	-0.56%	-0.01%

效日起至今						
汇添富丰利短债 D						
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	1.04%	0.12%	0.29%	0.05%	0.75%	0.07%
自基金合同生效日起至今	1.15%	0.10%	0.47%	0.04%	0.68%	0.06%

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

汇添富丰利短债C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富丰利短债D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 01 月 18 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。

本基金于 2020 年 12 月 17 日新增 C 类份额，于 2022 年 8 月 17 日新增 D 类份额，新增份额

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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
胡娜	本基金的基金经理	2022 年 05 月 24 日		13	国籍：中国。学历：西南财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009 年至 2012 年期间任职于华泰联合证券固定收益部，担任自营交易员职务；2012 年 11 月加入银华基金管理有限公司，曾担任研究员、基金经理助理和基金经理职务。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理。2017 年 4 月 25 日至 2017 年 7 月 2 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助理。2017 年 4 月 25 日至 2017 年 7 月 2 日任汇添富鑫瑞债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 日至今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 日至今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 日至今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。2021 年 9 月 2 日至 2022 年 10 月 19 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式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

					汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 24 日至今任汇添富中债-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 日至今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 日至今任汇添富丰利短债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《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 8 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

本报告期内，中国经济仍面临着一定的下行压力。国内方面，中采制造业 PMI 跌至荣枯线以下，受疫情散点状爆发影响，消费持续低迷，地产销售、投资均维持下行格局，出口开始呈现走弱迹象。11 月，金融十六条出台叠加预期发生变化，市场风险偏好有所抬升，12 月中央经济工作会议强调扩大内需，稳增长重要性有所抬升。整体看，本报告期内，经济基本面维持弱势震荡。

政策方面，本报告期内，稳增长政策不断加码，对改善经济预期起到了积极作用。货币政策精准有力，流动性合理充裕。

本报告期内，债券收益率先下后上。10 月在弱势基本面环境下，收益率小幅震荡下行，11 月稳增长政策频繁出台，经济增长预期修正，叠加资金利率波动，各期限品种利率均出现大幅上行，信用利差明显走扩。具体看，10 年国债上行 8bp，10 年国开上行 6bp，3 年 AAA

中票上行 50bp，5 年 AAA 中票上行 52bp，3 年 AA+中票上行 74bp，5 年 AA+中票上行 68bp。

本报告期内，本基金根据基金特性和流动性预判，维持了适度杠杆，并通过精选个券，优化了组合结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富丰利短债 A 类份额净值增长率为 0.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。本报告期汇添富丰利短债 C 类份额净值增长率为 0.15%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。本报告期汇添富丰利短债 D 类份额净值增长率为 1.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

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	3,952,224,403.18	98.69
	其中：债券	3,952,224,403.18	98.69
	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	13,800,000.00	0.34
	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	15,497,924.40	0.39
8	其他资产	23,156,233.19	0.58
9	合计	4,004,678,560.77	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	1,304,572,995.07	35.15
	其中：政策性金融债	252,086,820.27	6.79
4	企业债券	79,270,769.20	2.14
5	企业短期融资券	1,263,535,928.77	34.05
6	中期票据	1,204,933,998.36	32.47
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	99,910,711.78	2.69
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	3,952,224,403.18	106.50

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	102001062	20 汇金 MTN007A	1,200,000	121,559,263.56	3.28
2	042280299	22 电网 CP008	1,200,000	120,947,671.23	3.26
3	2128012	21 浦发银行 01	1,000,000	103,720,926.03	2.79
4	2028007	20 中信银行小微债 01	1,000,000	102,271,917.81	2.76
5	2020025	20 徽商银行小微债 01	1,000,000	101,535,232.88	2.74

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，上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、杭州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	2,540.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,153,692.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,156,233.19

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	汇添富丰利短债 A	汇添富丰利短债 C	汇添富丰利短债 D
本报告期期初基金份额总额	760,496,606.58	4,124,645,731.96	1,833.94
本报告期基	109,741,365.21	1,466,561,054.08	137,249.52

金总申购份额			
减：本报告期基金总赎回份额	239,887,403.71	2,818,099,983.70	137,249.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	630,350,568.08	2,773,106,802.34	1,833.94

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

	汇添富丰利短债 A	汇添富丰利短债 C	汇添富丰利短债 D
报告期初持有的基金份额	38,981,580.74	-	-
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	38,981,580.74	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	6.18	-	-

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丰利短债债券型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富丰利短债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富丰利短债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、报告期内汇添富丰利短债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

2023 年 01 月 20 日