# 汇添富利率债债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024年03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:中国工商银行股份有限公司

送出日期: 2024年04月22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 2024 年 4 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 03 月 31 日止。

# §2基金产品概况

# 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富利率债		
基金主代码	472007		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020年10月30日		
报告期末基金份额总额(份)	4, 873, 305, 018. 53		
   投资目标	在科学严格管理风险的前提下,本基金力争		
12页日170	创造超越业绩比较基准的较高收益。		
	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		
投资策略	及组合久期。本基金采取的投资策略主要包		
	括久期策略、骑乘策略、期限结构配置策		
	略、息差策略等。在谨慎投资的基础上,力		
	争实现组合的稳健增值。		
   业绩比较基准	中债-总全价(总值)指数收益率×90%+银		
业坝比权委任	行活期存款利率(税后)×10%		
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	中国工商银行股份有限公司

# §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(2024年01月01日 - 2024年03月31日)
1. 本期已实现收益	54, 104, 430. 49
2. 本期利润	61, 084, 236. 24
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0117
4. 期末基金资产净值	4, 998, 693, 041. 28
5. 期末基金份额净值	1. 0257

- 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	1. 20%	0.05%	1.13%	0.09%	0. 07%	-0.04%
过去六 个月	2. 31%	0.05%	1.89%	0.07%	0. 42%	-0.02%
过去一年	4. 24%	0.04%	2. 82%	0.07%	1.42%	-0.03%
过去三	11. 49%	0.05%	5. 24%	0. 07%	6. 25%	-0. 02%
自基金	13. 12%	0.05%	5. 90%	0.07%	7. 22%	-0.02%

合同生			
效日起			
至今			

# 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



汇添富利率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(2020年10月30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。

本基金由原汇添富理财7天债券型证券投资基金于2020年10月30日转型而来。

# § 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	2H nH
上 姓名	职务	任职日期	离任日期	(年)	说明
何旻	本基金的	2022年04		26	国籍:中国。学
門文	基金经理	月 29 日	_	20	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。
		从业经历: 曾任
		国泰基金管理有
		限公司行业研究
		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
		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 经理。2017 年7 月24 日至 2019 年8 月28 日任 汇冷型证金经经 理。2017 年9 月6 日至 2019 年8 月6 日至 2019 年8 月28 日至 2017 至 9月29 日至 2019 年8 月月8 日月28 日任允型证券 券投资基金的基金全理。2017 年9 月29 日 月28 日任允型证券金经理。2018 年3 日至 2021 年3 日 3 日 任正添审战 联合金配进金金经理。2018 年3 年 月3 日 任正添审战 略优特型证券投资基金经理。2019 年4 月15 日至 2023 年3 年 日 任正添审战 唯一债券 指数证券投资基金的基金经月19 日至 2023 年3 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3 年		7		
经理。2017年7 月24日至2019年8月28日在 汇添高福古祥 混合到基金经理。2017年9月 6日至2019年8 月28日任汇添 富盈洞混金的基金经理。2017年 9月29日至 2019年8月28日任汇查企业 混金处理。2017年 9月29日至 2019年8月28日任汇汇添定 混合型的基金会理。2018年7月 5日至2021年8 月3日村河后配置 混合型证券投资基金(经理、2019年4月15日至 2023年3月2日 任汇添富中债1-3年数据金约理。 2019年6月19 日至2020年7月8日任2汇添高中债1-3年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21添高中债1-3年次分价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年国工产分任				元债债券型证券
经理。2017年7 月24日至2019年8月28日在 汇添高福古祥 混合到基金经理。2017年9月 6日至2019年8 月28日任汇添 富盈洞混金的基金经理。2017年 9月29日至 2019年8月28日任汇查企业 混金处理。2017年 9月29日至 2019年8月28日任汇汇添定 混合型的基金会理。2018年7月 5日至2021年8 月3日村河后配置 混合型证券投资基金(经理、2019年4月15日至 2023年3月2日 任汇添富中债1-3年数据金约理。 2019年6月19 日至2020年7月8日任2汇添高中债1-3年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21添高中债1-3年次分价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年国工产分任				投资基金的基金
月24日至2019年8月28日任 汇添富福吉祥 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日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2018年8月28日任汇汇证金约资基金的基金经理。2018年7月8日至2021年8月3日任汇汇据遗嘱。3年时得过活配投资基金(LOF)的基金经理。2019年4月15日至2023年3月2日日汇汇海市债券指数证券金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇率公约年6月19日至2020年7月8日任工资亩中债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1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。				经理。2017年7
年8月28日在 汇添富添福古祥 混合型的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金。2017年9月6日至2019年8月28日任心添富盈投资基金的型。2017年9月29日至2019年8月29日至2019年8月29日至2019年8月2018年7月5日至2021年8月3日至2021年8月3日至2021年8月3日至2021年8月3日至2021年8月3日至2023年3月2日任汇添加于3年增于3年增于3年增于3年增于3年增于3年增于3年增于3年增于3年增于3年增				
汇添富經書符 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 富盈润基金的基 金经理。2017年9月月29日至 2019年8月28日任汇添密之 混合型基金经 理。2018年7月5日至2021年8 月3日日汇添增。 3年封闭灵元配置 混合型基金经理。2018年7月5日至2021年8 月3日时产品置 混合型。2019年4月15日至 2023年3月2日在汇添配。 2019年4月15日至 2023年3月2日在汇添在发行债券指数证基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇本农发行债券基金的基金经理。2020年1月14日至2020年1月14日至2020年1月14日至2020年1月14日至今任				
混合型证券投资基金经理。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给理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇率证券投资基金给理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇率高3年时闭运活配价。				
基金的基金经理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添富盈润混全型证券投资基金的基金全产型。2017年9月729日至2019年8月28日任汇添富品收资基金的基金经理。2019年8月28日任汇添富当及资基金全产的。19年1日时间,19日至2018年7月5日至2018年7月6日至2023年3月2日任汇添品。19日年4月15日至2023年3月2日任汇汇券投资基金的基金的基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债债券指数基金的基金经理。2020年1月14日至今任汇添富于行债券指数证券投资基金的基金经理。				
理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添富盈润混金的基金经型。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添富品资混金的基金经理。2017年9月29日至2019年8月3日任汇添增基金经理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇添作的制度。1019年1月1日至2021年8月3日日在汇添用的基金经理。2019年4月15日至2023年高月1日在13年国产价债券指数证券经理。2019年6月19日至2020年7月8日至2020年7月8日至2020年1月14日至今代债券指数证券经理。2019年6月19日至2020年1月14日至今代债券指数证券经理。2020年1月14日至今代汇添富于行债券指数证券经理。				
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 日任汇添富公资基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富公务理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添估置混合型证券投资基金经理。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 3 月 2 日任汇添富中债,为 4 国 17 日至 2023 年 6 月 19 日至 2020 年 7 月 8 日任汇海合业。2019 年 6 月 19 日至 2020 年 7 月 8 日任汇本公众行债券指数证券公经理。2020 年 1 月 14 日至今任汇添富中债,1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年				
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28 日至2019 年8月28日任汇添富者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年封闭运配置混合型证券住的基金经理。2019年4月15日至2023年3月16年1日至2023年3月16年1日至2023年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年股份基金约理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添农分行债券指数基金约基金经理。2020年1月14日至今任汇添属于行债券指数证券投资基金的基金经理。2020年1月14日至今任汇添属于行债券指数证券投资基金的基金经理。				
富盈洞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3公安混合型证券金经理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇添富3年时闭运作战暨配户灵活配投资基金经证。2019年4月15日至2023年3月2日任汇国开行债券基金的基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年收货理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债5十级班基金经理。2020年1月14日至今任汇添需,2019年6月14日至今任汇添需,2020年1月14日至今任汇添需,2020年1月14日至今任汇添据开行债券指数证券投资基金的基金经理。				
券投资基金的基金经理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添富出投资基金的基金经混合型证券全经混合型证券全经理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇添富3年封闭运作战略配配要证券投资基金。(LOF)的为基金经理。2019年4月15日至2023年3月2日任汇添加基金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添金。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年收货资基金的基金经理。2020年1月14日至今任汇添富中债7-10年期开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年期开行债券指数证券投资基金的基金经理。				
金经理。2017年 9月29日至 2019年8月28 日任汇添富公安 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 2023年3月使1-3年或一份债券 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日任汇添富中债1-3年农安 行债券指数基金经理。 2019年6月19日至 2020年7月8日任汇添富中债1-3年农安 行债券指数基金经理。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。				富盈润混合型证
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 2023年3月2日任汇添富产债债 1-3年国开行债 5-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日任汇添富中债1-3年次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。				券投资基金的基
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无投资 基金经理。2019年4月15日至 2023年3月2日 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日任汇添富中债1-3年取货行债券指数基金的基金经理。 2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年取货行债券指数基金经理。				金经理。2017年
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和置混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2019年4月15日至2023年3月2日任汇添富中债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日任汇添富中债1-3年农发行债券基金的基金经理。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。2020年1月14日至今任汇添富申债7-10年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。				9月29日至
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2023年3月2日任汇添富中债1-3年国开行债券指数证券金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年大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。				2019年8月28
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2023年3月2日任汇添富中债1-3年国开行债券指数证券金经理。2019年6月19日至2020年7月8日任汇添富中债1-3年大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。				日任汇添富弘安
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2023年3月2日任汇添富中债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日任汇添富中债1-3年国在汇添富中债1-3年国在汇添富中债1-3年国在汇添富中债1-3年度1-3年度1-3年度1-3年度1-3年度1-3年度1-3年度1-3年度				
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2023年3月2日任汇添富中债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。				
5 目至 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 2023年 3 月 2 日任汇添富中债 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。				
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2023年3月2日任汇添富中债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。				
3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金金理。2019年4月15日至2023年3月2日任汇添富中债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。				
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 2023 年 3 月 2 日 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。				
混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2019年4月15日至2023年3月2日任汇添富申债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日至今任汇添富申债7-10年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。				
基金经理。2019年4月15日至2023年3月2日任汇添富中债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。				
基金经理。2019 年4月15日至 2023年3月2日 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。				
年4月15日至2023年3月2日任汇添富中债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。				
2023年3月2日 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。				
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。				
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。				2023年3月2日
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。				任汇添富中债 1-
金的基金经理。 2019年6月19 日至2020年7 月8日任汇添富中债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。				3年国开行债券
2019年6月19 日至2020年7 月8日任汇添富 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。				指数证券投资基
日至 2020 年 7 月 8 日任汇添富中债 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。				金的基金经理。
日至 2020 年 7 月 8 日任汇添富中债 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。				2019年6月19
月8日任汇添富中债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。				, , ,
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。				•
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。				
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。				
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。				
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。				
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。				•
年国开行债券指 数证券投资基金 的基金经理。				
数证券投资基金的基金经理。				
的基金经理。				
2021年8月3日				
				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
		2022年11月4
		日任汇添富鑫利
		定期开放债券型
		发起式证券投资
		基金的基金经
		理。2021年10
		月 11 日至 2022
		年11月4日任
		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。2022年
		6月9日至今任
		汇添富中短债债
		表型证券投资基
		金的基金经理。
		2022年11月9
		日至今任汇添富
		中债 1-5 年政策
		性金融债指数证
		券投资基金的基
		金经理。2022年
		11月30日至今
		任汇添富鑫润纯
		债债券型证券投
		资基金的基金经
		理。2022年12
		月7日至今任汇

				添富鑫悦纯债债 券型证券投资基 金的基金经理。 2023年1月17 日至今任汇添富 丰和纯债债券型 证券投资基金的 基金经理。2023 年8月30日至 今任汇添富稳裕 30天滚动持有债 券型证券投资基
李伟	本基金的基金经理	2023年02月20日	10	金国历学学硕格金货格从年年金固交益究基司20汇2日利券金2汇开式的2018基:上院士:从投,业78管定易研员金基至富年今债资理0富债券金年海高用从券资分A,历至任有益、部曾理经8基2任债基。日鑫券投经2任存益、部曾理经8基2任债基。日鑫券投经2任存益、部曾理经8基2任债基。日鑫券投经2任存益、部营理经8基20至盛型资理月汇理。通金济资资,资格成产限部固债任有理月金月汇券金023今定发基。2个大融学基期。3018基司券收研发公入0富证基年任期起金0富

		鑫悦纯债债券型
		证券投资基金的
		基金经理。2023
		年3月2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。
		2023年6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。2023年
		6月20日至今任
		汇添富鑫荣纯债
		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,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%的情况有 1 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。

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

一季度,债市整体表现为上涨行情,收益率呈现下行趋势,信用利差持续压缩,收益率 曲线平坦化。货币政策维持偏宽松的格局,资金面全季平稳充裕。经济延续回升向好的态势, 但也呈现出结构性分化特点。制造业持续向好,出口数据超预期,但建筑业表现相对欠佳, 地产投资与销售仍表现不振。后续需要关注特别国债的发行进程及经济基本面回升的韧性。 报告期内,组合紧密跟踪市场动向,灵活调节杠杆、久期水平,同时注意控制回撤风险。

#### 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1.20%。同期业绩比较基准收益率为1.13%。

# 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	4, 869, 488, 162. 65	97. 32
	其中:债券	4, 869, 488, 162. 65	97. 32
	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	2, 234, 014. 81	0.04
8	其他资产	131, 820, 766. 57	2. 63
9	合计	5, 003, 542, 944. 03	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	436, 053, 836. 41	8.72
2	央行票据	_	-
3	金融债券	4, 433, 434, 326.	88. 69
S		24	88. 09
	其中:政策性金融债	4, 433, 434, 326.	88. 69
	共宁: 以東江並熙恢	24	00.09
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	_	-
10	其他	_	-
11	合计	4, 869, 488, 162.	97. 42
		65	91.42

# 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	092318002	23 农 发清发 02	6, 300, 000	634, 495, 783. 56	12. 69
2	230020	23 附 息国债 20	3, 000, 000	304, 939, 180. 33	6. 10

3	150218	15 国	2 000 000	202 076 211 40	6.06
		开 18	2, 900, 000	302, 976, 311. 48	
4	190204	19 国	2 600 000	000 000 070 00	F 20
		开 04	2, 600, 000	268, 688, 972. 68	5. 38
5	190406	19 农	0 100 000	000 000 100 00	4 60
		发 06	2, 100, 000	229, 903, 180. 33	4.60

# 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、中国进出口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	-

2	应收证券清算款	31, 026, 337. 26
3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	100, 794, 429. 31
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	131, 820, 766. 57

## 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	6, 538, 655, 373. 36
本报告期基金总申购份额	726, 321, 714. 48
减: 本报告期基金总赎回份额	2, 391, 672, 069. 31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4, 873, 305, 018. 53

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

	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况		
投资者类别	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	2024年1 月 25日 至 2024年1月 29日,2024年1月 31日至 2024年2月1日,2024年2月1日至2024年3月31日	1, 002, 781, 941. 80	_	_	1, 002, 781, 941. 80	20. 58	

#### 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理财7天债券型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富利率债债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富利率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、报告期内汇添富利率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 2024年04月22日