汇添富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资 基金 2021 年第 4 季度报告

2021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: 兴业银行股份有限公司

送出日期: 2022年01月24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 2022 年 1 月 20 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 2021年10月01日起至2021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	添富中债 1-3 年国开债
基金主代 码	007097
基金运作 方式	契约型开放式
基金合同 生效日	2019年04月15日
报告期末	
基金份额	8, 487, 227, 460. 65
总额(份)	
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪 误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金,采用优化抽样复制法。通过对标的指数中各成份债券的历史数据和流动性分析,选取流动性较好的债券构建组合,对标的指数的久期等指标进行跟踪,达到复制标的指数、降低交易成本的目的。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措

	施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一起替代性策略。当由于市场流动性不足或是数成份债券和备选成份债券无法满足投资券和备选成份债券外寻找其他债券构建替代组合的构建将以债券流动性为约束条何用评级相似、到期收益率及剩余期限基本被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最少	因法规规定等其他原因,导致标的指 资需求时,基金管理人可以在成份债 替代组合,对指数进行跟踪复制。替 牛,按照与被替代债券久期相近、信 本匹配为主要原则,控制替代组合与		
业绩比较 基准	中债 1-3 年国开行债券指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%			
风险收益 特征	本基金属于债券型基金,其预期收益及原金,高于货币市场基金。本基金属于中价券基金中投资风险较低的品种。本基金系1-3年国开行债券指数,其风险收益特征险收益特征相似。	责-1-3 年国开行债券指数基金,是债 采用优化抽样复制策略,跟踪中债-		
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			
下属分级 基金的基金简称	添富中债 1-3 年国开债 A	添富中债 1-3 年国开债 C		
下属分级 基金的交 易代码	007097	007098		
报告期末 下属分级 基金的份 额总额 (份)	8, 468, 144, 541. 84	19, 082, 918. 81		

§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(2021年10月01日	- 2021年12月31日)
	添富中债 1-3 年国开债 A	添富中债 1-3 年国开债 C
1. 本期已实现收益	28, 703, 715. 76	35, 147. 70
2. 本期利润	50, 570, 798. 03	61, 900. 76
3. 加权平均基金份	0.0100	0.0193
额本期利润	0. 0109	0. 0123
4. 期末基金资产净	0 501 402 072 60	10 214 240 25
值	8, 581, 423, 873. 69	19, 314, 349. 25
5. 期末基金份额净	1.0134	1.0121

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

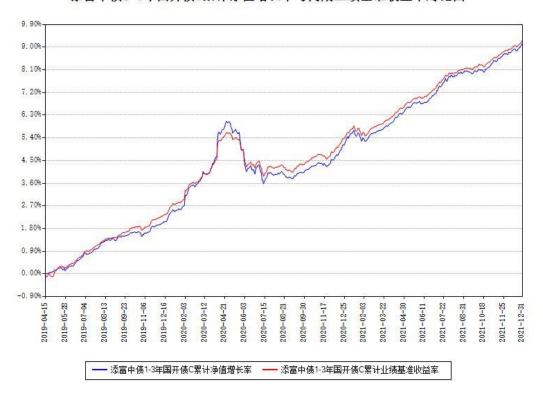
	添富中债 1-3 年国开债 A					
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	1-3	2-4
过去三 个月	1.00%	0.03%	0.93%	0.02%	0.07%	0.01%
过去六 个月	2.00%	0.03%	1.86%	0.02%	0.14%	0.01%
过去一年	3. 64%	0.04%	3.47%	0.03%	0.17%	0.01%
自基金 合同生 效日起 至今	9. 44%	0.06%	9. 28%	0.04%	0.16%	0. 02%
		添富	7中债 1-3 年国	引开债 C		
阶段	份额净值 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	1-3	2-4
过去三 个月	0.96%	0.03%	0.93%	0. 02%	0.03%	0.01%
过去六 个月	1.94%	0.03%	1.86%	0.02%	0.08%	0.01%
过去一	3. 51%	0.04%	3. 47%	0. 03%	0.04%	0.01%
自基金 合同生 效日起 至今	9. 15%	0.06%	9. 28%	0. 04%	-0.13%	0. 02%

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

添富中债1-3年国开债A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富中债1-3年国开债C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04月15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

	/-	任本基金的基	金经理期限	证券从业年限	
姓名	职务	任职日期	离任日期	(年)	说明
何 旻	本基金的基金经理	2019年04月15日		23	国历治经业资格从国限员组经经部比限理月产有年今币金年富有年今中投经月年汇利籍:经济资基,业泰公、负理理负联公。加管限2任债经8基限11任国资理21月富期中国学硕:从A,历金行合人理固人金基11汇(司1添基。加管司月添券金01月富期国伦院士证业F:管业研、、定;管金年添香,日富金20入理。22富型的4至8月放高敦金。券资RM曾理研究基基收金理经1富港20至民基 添份3至心券金19年30年30年30日,19年

型证券投资基金的基金经到 11 日至 2019 年 8 月 28 日任汇深置富盈聚之经理。2017 年 8 月 28 日在汇深置混合全的基本全经理。2017 年 9 日子 6 元 1 元 1 元 1 元 1 元 1 元 1 元 1 元 1 元 1 元		•	
2016年3月11 日至2019年8 月28日任汇添 富盛鑫灵活社资 基金的基金经 理。2017年4 月20日至今任 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34日至2019年8月28日任 汇添富高利提合型证券投资 基金的基金经理。2017年9月6日至2019年8月28日任 汇添富高利提金 型证券投资基金的基金经理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添富高以安混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月28日至2017年3月3日任汇添常高以安混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月3日至2021年8月3日任汇添估战階混合型证券投资基金(LDF)的基金经理。2019年4月15日至今任 月15日至今任			型证券投资基金
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 年 5 元 位债券型证券投资 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 汇添富添投资 基金的基金经 理。2017 年 9 月 6 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富弘安混基金的基金经理。2017 年 9 月 5 日至 2019 年 8 月 29 日至 2019 年 8 月 20 日任汇添富弘安混基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添战略国 每 2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 日 3 日任汇添战略国 每 2019 年 8 月 3 日任汇添战略国 4 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日			的基金经理。
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 日至今任 汇添富精型证券投资 英金的基金经 理 2017 年 7 月 24 日至 2019 年 8 月 28 日任 汇添富添福吉港。 2018 年 8 月 28 日任 汇添客添福吉港。 2017 年 9 月 6 日至 2019 年 8 月 28 日任 汇添 2017 年 9 月 6 日至 2019 年 8 月 28 日任 汇添 2017 年 9 月 6 日至 2019 年 8 月 29 日至 2019 年 8 月 3 日任汇添 富弘安混合 如基金经理。 2017 年 8 月 3 日任汇添 战略重 参投资理。 2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任 五年 1月 3 日任 五年 1月 3 日任 五年 1月 3 日任 五年 1月 3 日日 1日			2016年3月11
富盈季过济投资基金的基金经理。2017年4月20日至今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日任汇添金型基金经理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添证券投资基金的基金经理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添证券投资理。2017年9月6日至2011年8周报基金的基金经理。2017年9月29日至2011年8周3日任汇全2011年8周3日任汇金时期运费投资基金(LOF)的基金经理。2019年4月15日平债1号。2019年4月15日平债1号。2019年4月15日平债1号。2019年4月15日平债1号。2019年4月15日平债1号。2019年4月15日平债1号。2019年4月15日平债1号。2019年6月19			日至 2019 年 8
混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月20日至今任汇添货型证券投资基金的基金经理。2017年7月24日至2019年8月28日任汇添加基金经理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添高券投资理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添高多数经理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添高业业资数基金的基金经理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添高业资投资基金的基金经理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇资价资基金(LDF)的基金经理。2019年4月15日至今任汇添高中债券基金经理。2019年4月15日至今日汇添购工券投资基金的基金经理。2019年4月15日至今任汇添购工券投资基金的基金经理。2019年4月15日至今日汇添购工券投资基金的基金经理。2019年6月19			月 28 日任汇添
混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月20日至今任汇添货型证券投资基金的基金经理。2017年7月24日至2019年8月28日任汇添加基金经理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添高券投资理。2017年9月6日至2019年8月28日任汇添高多数经理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添高业业资数基金的基金经理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添高业资投资基金的基金经理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇资价资基金(LDF)的基金经理。2019年4月15日至今任汇添高中债券基金经理。2019年4月15日至今日汇添购工券投资基金的基金经理。2019年4月15日至今任汇添购工券投资基金的基金经理。2019年4月15日至今日汇添购工券投资基金的基金经理。2019年6月19			富盈鑫灵活配置
基金的基金经理。2017年4月20日至今往汇添等类型或差别。2017年7月24日至2019年8月28日在汇添合业基金经理。2017年9月26日至2019年8月28日在汇添合数据金经理。2017年9月6日至2019年8月28日在汇添资投资理。2017年9月6日至2019年8月28日在汇添高或投资理。2017年9月29日至2019年8月28日任汇添高以资基金的基金经理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇添高以营税资基金(LOF)的第一级产品的基金(LOF)的基金经理。2019年4月15日至今任汇添高中债券指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2019年4月15日至今任汇添高中债券指数证券投资基金			
理。2017年4 月20日至今任 汇添高精选美元 债债参和证券投资基金的基金经理。2017年7 月24日至2019年8月28日在 汇添富证券投资基金的14年9 月6日至2019年8月28日任 汇添富投资理。2017年9 月6日至2019年8月28日任 汇添富投资理。2017年8月28日任 汇添富以资基金的基金经理。2017年8月3日任汇添富以资基金的基金的基金的基金的基金的基金经理。2018年7月5日至2021年8月3日任汇添作战图混基。			
月 20 日至今任 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 汇添富之时在 9 月 6 日至 2019 年 8 月 28 日任 汇添富盈預资基金 的基金经理。2017 年 9 月 29 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添 富以安基金的基 金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添作战略配 每 2021年 8 月 3 日本资格数量金经理。2019年 4 月 15 日至今任 汇添加于行债券指 数 2021年 8 月 3 日本资格数量金经理。2019年 4 月 15 日至今任 汇添加于行债券指 数 2021年 8 月 3 日本资格数量金经理。2019年 4 月 15 日至今日 17 日本资格数量金 经理。2019年 4 月 16 日至 9 日 2021年 8 月 3 日本资格数量金 经理。2019年 4 月 16 日子 9 日 2021年 8 月 3 日本资格数量金 经理。2019年 4 月 16 日子 9 日 2021年 8 月 9 日 2021年 8 月 9 日 2021年 8 月 9 日 2021年 8 日			
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 汇添富海港港。 是金的基金经 理。2017年9 月6日至2019年8月28日任 汇添富强润混合 型证券投资理。 2017年9月29日至2019年8 月28日任汇率 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 日报运作战置混合。 型证券投资基金 (LOF)的基金 经理。2019年4 月15日至今任 汇添富于债资基金 经理。2019年4 月15日至今任			
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日任汇添富福计数资基金的基金经理。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资基金(几0F)的基金经理。2019年4月15日至今任汇添富了2019年4月15日至今任汇添属于债债券指数证券投资基金的基金经理。2019年4月15日至今任汇添属于债债券指数证券投资基金的基金经理。2019年6月19			
 夢基金的基金经理。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 3 公 2 1 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2			
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会的基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富 3 年 封闭运作战配 电灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 6 月 15 日至今 4 月 15 日至今 4 月 15 日至今 4 月 15 日至 (大) 有 5 中 债 大) 有 6 月 19			
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 派家富盈润混合 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 富弘安混合创基 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 传灵活配置混合 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			
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全理。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年封闭运作战配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1下高中债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			•
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全理。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资基金 (LOF)的基金 经理。2018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			
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日任汇添临副署记令型证券投资基金((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			
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日任汇添富了3年封闭运活配为投资基金(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			
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			
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			
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1一3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2019年6月19			
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1一3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2019年6月19			
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			
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			
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 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			
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			
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			
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			
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			
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			
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			
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			
信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			
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			–
(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			
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			
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			
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			•
年国开行债券指 数证券投资基金 的基金经理。 2019 年 6 月 19			
数证券投资基金 的基金经理。 2019 年 6 月 19			
的基金经理。 2019 年 6 月 19			
2019年6月19			
日至 2020 年 7			
			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。2021年8 月3日至今任汇 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。 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。

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內遵守《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11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

2021 年第四季度,国内宏观经济平稳发展。消费品价格指数同比涨幅有所上升,核心 CPI 指数依然保持稳定,没有通胀迹象。工业品价格指数 PPI 回落。中国制造业采购经理指

数 PMI 逐月回升,其中生产和新订单分项指数皆有转暖迹象。投资方面,由于同比基数的原因,总体的固定资产投资累计同比增速继续逐月回落。从房地产的细项数据上看, 70 个大中城市商品房价格指数显示房价有所回落,房屋新开工面积、房地产开发投资完成额、商品房销售面积和销售额同比增速都有不同幅度的下降,显示政府对房地产行业的调控依然收紧。货币政策方面,第四季度,央行维持公开市场操作利率不变,调降一年期 LPR 利率,通过公开市场操作向市场净投放 1900 亿元货币。货币供应量同比增速稳定,M1 同比增速在 11 月份回落至 3.0%,M2 同比增速回落至 8.5%。美元对人民币汇率在第四季度贬值 1.39%。

第四季度,债券市场基本在流动性宽松的环境中运行,中债综合指数震荡上行。市场收益率总体趋势向下,中间略有小幅波动。中债新综合财富指数在第四季度上涨 1.22%。

本基金第四季度在基金合同允许范围内,基本保持与指数相同的久期,并且完成与对应指数的跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 1.00%; C 类基金份额净值增长率为 0.96%。 同期业绩比较基准收益率为 0.93%。

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	8, 271, 368, 000. 00	96. 14
	其中:债券	8, 271, 368, 000. 00	96. 14
	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	163, 382, 128. 05	1.90
8	其他资产	168, 847, 023. 62	1.96
9	合计	8, 603, 597, 151. 67	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	8, 271, 368, 000.	96. 17
3	並賦収分	00	90.17
	其中:政策性金融债	8, 271, 368, 000.	96. 17
	共宁: 以東任並熈贝	00	90. 17
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	其他		

10 合计 90	10	合计	8, 271, 368, 000. 00	96. 17
----------	----	----	-------------------------	--------

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

		佳 坐力			占基金资产
序号	债券代码	债券名 称	数量(张)	公允价值 (元)	净值比例
		121			(%)
1	210202	21 国	15, 200, 000	1, 533, 680, 000. 00	17. 83
1	210202	开 02	13, 200, 000	1, 333, 080, 000. 00	17.05
2	190203	19 国	11, 900, 000	1, 208, 445, 000. 00	14. 05
2	190203	开 03	11, 900, 000	1, 200, 443, 000.00	14, 05
3	190208	19 国	9, 600, 000	979, 392, 000. 00	11. 39
3	190208	开 08	9, 000, 000	919, 392, 000. 00	11. 59
4	200202	20 国	8, 400, 000	834, 540, 000. 00	9. 70
4	200202	开 02	8, 400, 000	634, 540, 000. 00	9.70
5	210207	21 国	6, 500, 000	656, 825, 000. 00	7. 64
J	210201	开 07	0, 500, 000	000, 820, 000. 00	7.04

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,国家开发银行出现在报告编制目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	345. 89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	_
4	应收利息	165, 665, 739. 73
5	应收申购款	3, 180, 938. 00
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	_
9	合计	168, 847, 023. 62

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	添富中债 1-3 年国开债 A	添富中债 1-3 年国开债 C
本报告期期初基金	4, 026, 518, 095. 03	547, 998. 62

份额总额			
本报告期基金总申	4,676,197,199.90	31, 270, 259. 43	
购份额	1,010,131,133.30	01, 210, 200. 10	
减:本报告期基金	234, 570, 753. 09	12, 735, 339. 24	
总赎回份额	234, 370, 733. 09	12, 735, 339. 24	
本报告期基金拆分			
变动份额	_	_	
本报告期期末基金	0 460 144 541 04	10 000 010 01	
份额总额	8, 468, 144, 541. 84	19, 082, 918. 81	

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

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	持分份 战 超 超 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	2021年 10月1 日至 2021年 12月14 日,2021年 12月29 2021年 12月29 日	999, 999, 000. 00	494, 167, 819. 73	_	1, 494, 166, 819. 73	17.60
	2	2021年 10月11 日至 2021年 11月3	791, 216, 496. 88	_	-	791, 216, 496. 88	9. 32

日日

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中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富中债 1-3 年国开行债券指数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、报告期内汇添富中债 1-3 年国开行债券指数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01月24日