汇添富短债债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 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：2021 年 07 月 21 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 2021 年 7 月 19 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 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	添富短债债券
基金主代码	006646
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 13 日
报告期末基金份额总额(份)	10,140,207,981.98
投资目标	本基金在严格管理风险的前提下，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	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	添富短债债券 A	添富短债债券 C	添富短债债券 E
下属分级基金的交易代码	006646	006647	011622
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	9,168,038,789.73	925,823,171.00	46,346,021.25

注：本基金于 2021 年 02 月 26 日新增 E 类份额。

§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 04 月 01 日 - 2021 年 06 月 30 日)		
	添富短债债券 A	添富短债债券 C	添富短债债券 E
1.本期已实现收益	71,129,711.28	6,722,303.65	693,341.67
2.本期利润	72,136,806.86	6,894,729.11	635,320.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0083	0.0072	0.0070
4.期末基金资产净值	9,892,729,299.97	989,276,957.49	49,972,702.74
5.期末基金份额净值	1.0790	1.0685	1.0783

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

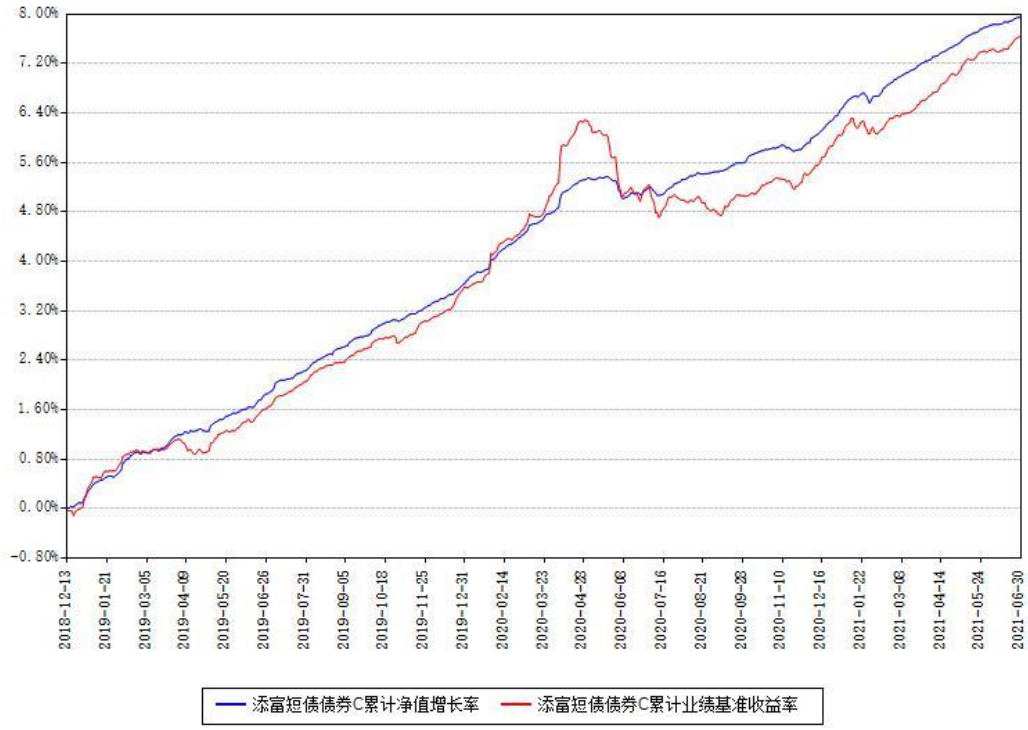
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

添富短债债券 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	0.76%	0.01%	0.94%	0.02%	-0.18%	-0.01%
过去六个月	1.67%	0.02%	1.52%	0.03%	0.15%	-0.01%
过去一年	3.09%	0.02%	2.36%	0.03%	0.73%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	9.01%	0.02%	7.66%	0.04%	1.35%	-0.02%
添富短债债券 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	0.67%	0.01%	0.94%	0.02%	-0.27%	-0.01%
过去六个月	1.47%	0.02%	1.52%	0.03%	-0.05%	-0.01%
过去一年	2.68%	0.02%	2.36%	0.03%	0.32%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	7.96%	0.02%	7.66%	0.04%	0.30%	-0.02%
添富短债债券 E						
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	0.71%	0.01%	0.94%	0.02%	-0.23%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	1.02%	0.01%	1.24%	0.02%	-0.22%	-0.01%

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

添富短债债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富短债债券E累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018 年 12 月 13 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。

2、本基金于 2021 年 02 月 26 日新增 E 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		
蒋文玲	本基金的基金经理	2018 年 12 月 13 日		15	国籍:中国。学历:上海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:曾任汇添富基金管理股份有限公司债券交易员、债券风控研究员，浦银安盛基金管理公司基金经理。2014 年 1 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014 年 4 月 8 日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理助理。2015 年 3 月 10 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 10 日至今任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理。2015 年 3 月 10 日至 2019 年 8 月 28 日任

					汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富货币市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富添富通货币市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 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。2017 年 5 月 15 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28

					日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 8 月 2 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 8 月 2 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 13 日至今任汇添富短债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 24 日至今任汇添富丰润中短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 18 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。2019 年 6 月 12 日至今任汇添富 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 10 日至今任汇添富汇鑫浮动净值型货币市场

					基金的基金经理。2020 年 10 月 30 日至今任汇添富利率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嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司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、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统中的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

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，本公司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 5 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，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

二季度经济表现出“类滞胀”特征，一方面经济增长动能环比有所减弱，体现在出口和固定资产投资增速开始下滑，非制造业边际改善不显著，另一方面通胀压力不减，PPI 同比继续创新高，上游涨价动力仍然较强，对中下游生产企业利润形成较大冲击。政策方面延续固本培元思路，货币政策强调不急转弯，深化利率市场化改革以降低银行资金成本和实际贷款利率，同时央行表达了对外部风险的关注，主要是考虑到下半年美联储 Taper 造成的金融市场风险和资本外流压力，以及输入性通货膨胀问题。在资金面平稳宽松的背景下，二季度债券市场表现出窄幅波动、整体收益率缓慢下行的特征，至本季度末，1 年期和 10 年期国开债收益率分别为 2.5%和 3.49%，分别较上季末下行 25BP 和 8BP。

本组合在二季度规模较为平稳，操作上较为积极，注重票息的确定性收益以及息差贡献，组合杠杆维持在 120-130%的中高水平，在评级分布上，进一步增加 AAA 高评级的持仓比例，尽量规避资质较差的民企和城投，降低组合的风险敞口，并做到精选个券，分散投资。

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 0.76%;C 类基金份额净值增长率为 0.67%;E 类基金份额净值增长率为 0.71%。同期业绩比较基准收益率为 0.94%。

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	13,789,363,200.00	98.63
	其中：债券	13,697,390,500.00	97.97
	资产支持证券	91,972,700.00	0.66
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	7,030,272.22	0.05
8	其他资产	185,094,570.96	1.32
9	合计	13,981,488,043.18	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	9,952,000.00	0.09

2	央行票据	-	-
3	金融债券	631,430,400.00	5.78
	其中：政策性金融债	631,430,400.00	5.78
4	企业债券	592,917,700.00	5.42
5	企业短期融资券	6,561,230,500.00	60.02
6	中期票据	4,054,479,900.00	37.09
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,847,380,000.00	16.90
9	其他	-	-
10	合计	13,697,390,500.00	125.30

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	012101698	21 中广核 SCP002	2,700,000	269,946,000.00	2.47
2	200309	20 进出 09	2,210,000	221,088,400.00	2.02
3	101761005	17 首钢 MTN001	2,000,000	203,260,000.00	1.86
4	180212	18 国开 12	2,000,000	200,660,000.00	1.84
5	112183394	21 徽商银行 CD088	2,000,000	195,620,000.00	1.79

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	179102	至臻 08A1	600,000	60,006,000.00	0.55
2	165897	联融 01 优	170,000	16,959,200.00	0.16
3	179103	至臻 08A2	150,000	15,007,500.00	0.14

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，中国进出口银行、国家开发银行、华夏银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、江苏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	25,131.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	169,187,337.31
5	应收申购款	15,882,102.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	185,094,570.96

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	添富短债债券 A	添富短债债券 C	添富短债债券 E
本报告期期初基金份额总额	7,827,812,117.61	1,028,155,347.16	10,070,011.01
本报告期基金总申购份额	3,815,821,045.48	174,989,709.19	153,445,474.91
减：本报告期基金总赎回份额	2,475,594,373.36	277,321,885.35	117,169,464.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金	9,168,038,789.73	925,823,171.00	46,346,021.25

份额总额			

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

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短债债券型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富短债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富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、报告期内汇添富短债债券型证券投资基金在指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

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼　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

2021 年 07 月 21 日