

# 汇添富弘安混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 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：2021 年 01 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2020 年 10 月 01 日起至 2020 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          | 汇添富弘安混合                                                                                                          |           |
| 基金主代码         | 501041                                                                                                           |           |
| 基金运作方式        | 契约型开放式                                                                                                           |           |
| 基金合同生效日       | 2017 年 09 月 29 日                                                                                                 |           |
| 报告期末基金份额总额(份) | 359,630,648.37                                                                                                   |           |
| 投资目标          | 在有效控制风险的基础上，本基金充分挖掘市场潜在的投资机会，通过积极合理的资产配置，追求基金资产的长期稳健增值。                                                          |           |
| 投资策略          | 本基金将密切关注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，判断不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，以动态调整大类资产配置比例。在此基础上，灵活运用债券投资策略、股票精选策略等投资策略。 |           |
| 业绩比较基准        | 沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×70%                                                                                   |           |
| 风险收益特征        | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金，属于中等收益风险特征的基金。                                                         |           |
| 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   | 汇添富弘安混合 A                                                                                                        | 汇添富弘安混合 C |
| 下属分级基金场内简称    | 添富弘安                                                                                                             | 添富弘 C     |

|                    |                |              |
|--------------------|----------------|--------------|
| 下属分级基金的交易代码        | 501041         | 501042       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 353,666,087.47 | 5,964,560.90 |

### § 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(2020 年 10 月 01 日 - 2020 年 12 月 31 日) |              |
|-----------------|------------------------------------------|--------------|
|                 | 汇添富弘安混合 A                                | 汇添富弘安混合 C    |
| 1. 本期已实现收益      | -4,308,058.59                            | -91,035.89   |
| 2. 本期利润         | 16,558,729.05                            | 350,424.30   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0470                                   | 0.0461       |
| 4. 期末基金资产净值     | 435,638,816.82                           | 7,157,074.76 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2318                                   | 1.1999       |

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

| 汇添富弘安混合 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       | 3.98%    | 0.44%       | 4.43%      | 0.30%         | -0.45% | 0.14%  |
| 过去六个月       | 8.10%    | 0.59%       | 6.59%      | 0.39%         | 1.51%  | 0.20%  |
| 过去一年        | 12.22%   | 0.49%       | 8.04%      | 0.41%         | 4.18%  | 0.08%  |
| 过去三年        | 21.09%   | 0.37%       | 14.22%     | 0.39%         | 6.87%  | -0.02% |
| 自基金合同生效日起至今 | 23.18%   | 0.38%       | 15.18%     | 0.38%         | 8.00%  | 0.00%  |
| 汇添富弘安混合 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       | 3.77%    | 0.44%       | 4.43%      | 0.30%         | -0.66% | 0.14%  |
| 过去六个月       | 7.66%    | 0.59%       | 6.59%      | 0.39%         | 1.07%  | 0.20%  |
| 过去一年        | 11.31%   | 0.49%       | 8.04%      | 0.41%         | 3.27%  | 0.08%  |

|             |        |       |        |       |       |        |
|-------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三年        | 18.18% | 0.37% | 14.22% | 0.39% | 3.96% | -0.02% |
| 自基金合同生效日起至今 | 19.99% | 0.38% | 15.18% | 0.38% | 4.81% | 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

汇添富弘安混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富弘安混合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（2017 年 09 月 29 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

| 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 |           |                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 赵鹏程 | 本基金的基金经理 | 2020 年 06 月 10 日 |      | 9         | 国籍:中国。学历:浙江大学高分子化学与物理硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任天相投资股份有限公司研究员、信诚基金管理有限公司研究员。2011 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司, 历任高级行业分析师。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月 13 日至今任汇添富行业整合主题混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 18 日至 2020 年 5 月 20 日任汇添富环保行业股票型证券投资基 |

|    |          |                  |  |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|----|----------|------------------|--|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |          |                  |  |   | 金的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 胡奕 | 本基金的基金经理 | 2020 年 07 月 01 日 |  | 6 | <p>国籍:中国。学历:上海交通大学金融硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2014 年 7 月至 2016 年 6 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益助理研究员; 2016 年 7 月至 2018 年 6 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益研究员; 2018 年 7 月至 2019 年 8 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益高级研究员。2019 年 9 月 1 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 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。2019 年 9 月 1 日至今任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至今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。2019 年 9 月 1 日至今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助理。2019 年 9 月 1 日至今任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 9 月 1 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>2019 年 10 月 8 日至 2019 年 10 月 8 日任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的</p> |

|     |                  |                  |                  |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-----|------------------|------------------|------------------|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                  |                  |                  |   | <p>基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至今任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至今任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至今任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2019 年 11 月 19 日至今任汇添富稳健增长混合型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 1 日至今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。2020 年 7 月 1 日至今任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 吴江宏 | 本基金的基金经理，股债混合部主管 | 2019 年 08 月 28 日 | 2020 年 10 月 30 日 | 9 | <p>国籍:中国。学历:厦门大学经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益分析师。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 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。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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 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。2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 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。2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 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 9 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司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 4 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

四季度以来，国内经济延续向好态势，且复苏节奏有所加快。随着疫情好转，出口、制

制造业投资与可选消费等顺周期需求上升，基建与地产投资等逆周期调节边际放缓，伴随经济改善，货币政策向常态化回归。

10 月以来资金面整体呈现偏紧态势，但预期社融拐点出现，债券收益率震荡略有上行。11 月信用事件冲击使得债券收益率快速上行，且信用利差大幅拉大。信用事件后金稳会立即召开，并提到保持流动性合理充裕，避免发生系统性风险。随后公开市场操作、货币政策执行报告等都反映出货币政策态度发生了较为明显的软化，从收紧转向稳健偏宽松，带动债券收益率快速下行，不过低等级债券由于信用风险担忧，下行不明显。总体来看，四季度 10 年国债先上后下持平在 3.14%，10 年国开下行 11bp 至 3.53%，3 年 AAA 企业债下行 24bp 至 3.48%，3 年 AA 企业债上行 21bp 至 4.26%。

权益市场方面 A 股市场整体震荡上行，同时结构分化。从指数看，四季度上证指数涨 7.92%，深证成指涨 12.11%，沪深 300 涨 13.6%，中小板指涨 10.07%，创业板指涨 15.21%。四季度市场行业结构和风格分化明显，与宏观经济复苏相关度较高的行业整体表现较好，同时各行业均呈现大市值公司表现优于中小市值公司的特征。具体行业表现方面，有色金属、电气设备、食品饮料、家电、汽车等行业涨幅均在 20%以上；休闲服务、军工、化工、采掘、钢铁、银行、机械等行业指数涨幅在 10-20%之间；而商贸、传媒、通信、计算机、建筑、房地产等行业指数跌幅超 5%。

四季度，本产品债券仓位基本稳定，保持中性久期，持仓以高等级信用债为主；权益部分主要投资金融、可选消费和科技创新类相关个股。

#### 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 3.98%；C 类基金份额净值增长率为 3.77%。同期业绩比较基准收益率为 4.43%。

#### 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  | 161,875,677.90 | 33.57        |
|    | 其中：股票 | 161,875,677.90 | 33.57        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 312,127,440.16 | 64.73  |
|   | 其中：债券             | 312,127,440.16 | 64.73  |
|   | 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      | 3,729,246.06   | 0.77   |
| 8 | 其他资产              | 4,453,339.92   | 0.92   |
| 9 | 合计                | 482,185,704.04 | 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

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 101,872,283.96 | 23.01        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,832,000.00   | 0.87         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 13,741,533.94  | 3.10         |
| J  | 金融业              | 18,972,600.00  | 4.28         |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 17,542,500.00  | 3.96         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 5,914,760.00   | 1.34  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 161,875,677.90 | 36.56 |

### 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 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 10,000  | 19,980,000.00 | 4.51         |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 210,000 | 18,265,800.00 | 4.13         |
| 3  | 601888 | 中国中免 | 50,000  | 14,122,500.00 | 3.19         |
| 4  | 300014 | 亿纬锂能 | 170,000 | 13,855,000.00 | 3.13         |
| 5  | 600570 | 恒生电子 | 100,010 | 10,491,049.00 | 2.37         |
| 6  | 603345 | 安井食品 | 50,000  | 9,643,500.00  | 2.18         |
| 7  | 002049 | 紫光国微 | 70,000  | 9,366,700.00  | 2.12         |
| 8  | 600309 | 万华化学 | 100,000 | 9,104,000.00  | 2.06         |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 30,000  | 8,755,500.00  | 1.98         |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 69,930  | 6,883,909.20  | 1.55         |

### 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      | 23,379,114.90  | 5.28         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,046,000.00  | 2.27         |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,046,000.00  | 2.27         |
| 4  | 企业债券      | 228,549,563.00 | 51.62        |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券   | 20,062,000.00  | 4.53  |
| 6  | 中期票据      | 30,039,000.00  | 6.78  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 51,762.26      | 0.01  |
| 8  | 同业存单      | —              | —     |
| 9  | 其他        | —              | —     |
| 10 | 合计        | 312,127,440.16 | 70.49 |

#### 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<br>(张) | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比<br>例(%) |
|----|--------|----------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 019627 | 20 国债 01 | 220,940   | 22,091,790.60 | 4.99             |
| 2  | 122402 | 15 城建 01 | 200,000   | 20,238,000.00 | 4.57             |
| 3  | 175521 | 20 国君 G9 | 200,000   | 20,176,000.00 | 4.56             |
| 4  | 155402 | 19 齐鲁 01 | 200,000   | 20,150,000.00 | 4.55             |
| 5  | 155358 | 19 华泰 G3 | 200,000   | 20,148,000.00 | 4.55             |

#### 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：本基金本报告期末投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立

案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

### 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   | 84,756.07    |
| 2  | 应收证券清算款 | 582,340.01   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 3,772,231.04 |
| 5  | 应收申购款   | 14,012.80    |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 4,453,339.92 |

### 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目            | 汇添富弘安混合 A      | 汇添富弘安混合 C     |
|---------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 339,931,422.13 | 15,819,796.21 |
| 本报告期基金总申购份额   | 15,297,044.60  | 1,629,152.99  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,562,379.26   | 11,484,388.30 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | —              | —             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 353,666,087.47 | 5,964,560.90  |

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末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

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                   |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |          |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------|----------------|------|------|----------------|----------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 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              | 2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 168,094,637.75 | —    | —    | 168,094,637.75 | 46.74    |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                |                                   |                |      |      |                |          |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险<br/>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。</p> <p>2、巨额赎回的风险<br/>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。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险<br/>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。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险<br/>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。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险<br/>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连续 60 个工作日低于 5000 万元。根据法律法规与《基金合同》的约定，本基金将面临提前终止基金合同的风险。</p> |                |                                   |                |      |      |                |          |

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：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弘安混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富弘安混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《汇添富弘安混合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、报告期内汇添富弘安混合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](http://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 01 月 22 日