汇添富美丽30混合型证券投资基金2023年第1季度报告

2023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：2023年04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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	汇添富美丽 30 混合
基金主代码	000173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 06 月 25 日
报告期末基金份额总额(份)	493,708,749.75
投资目标	本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘拥有优秀管理层、盈利能力高于行业平均水平、增长可持续且估值水平相

	对合理的优质上市公司，辅以严格的风险管理，以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%		
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/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	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富美丽 30 混合 A	汇添富美丽 30 混合 C	汇添富美丽 30 混合 D
下属分级基金的交易代码	000173	015179	015180
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	493,602,637.18	16,531.19	89,581.38

§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(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 03 月 31 日)		
	汇添富美丽 30 混合 A	汇添富美丽 30 混合 C	汇添富美丽 30 混合 D
1.本期已实现收益	-2,286,910.18	-831.68	-828.84
2.本期利润	116,700,995.43	6,032.48	25,943.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.2358	0.2647	0.2603
4.期末基金资产净值	1,513,170,757.81	50,540.97	273,539.63

5.期末基金份额净值	3.066	3.057	3.054

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

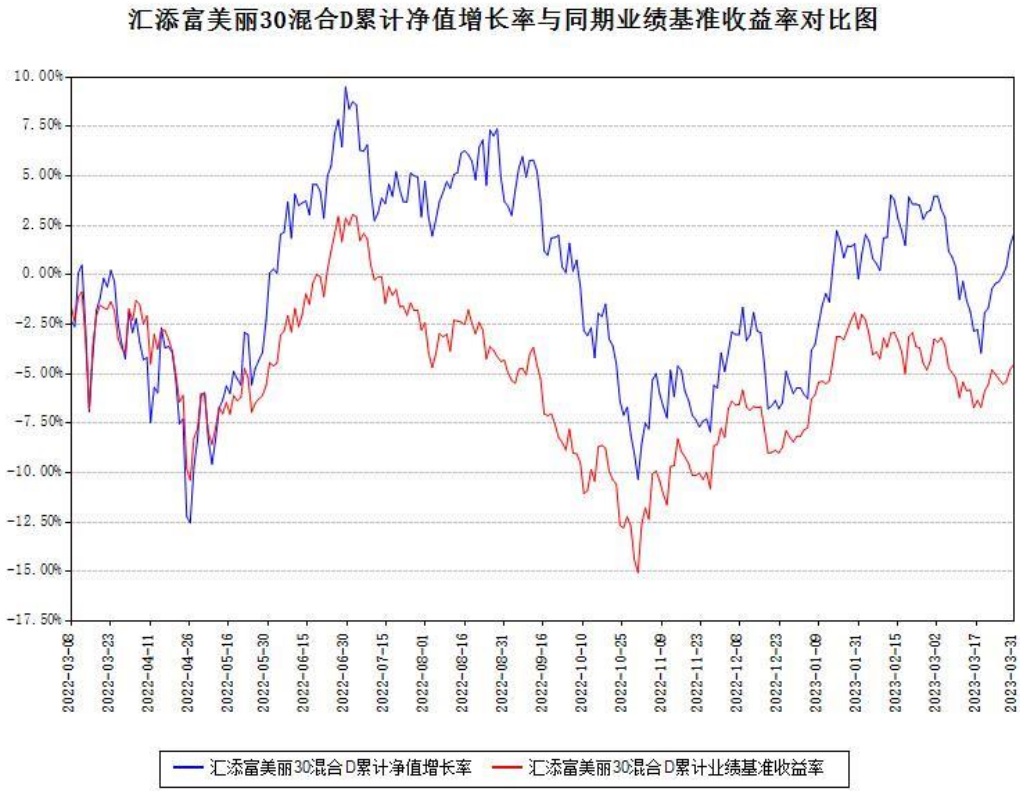
汇添富美丽 30 混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.34%	0.99%	3.93%	0.68%	4.41%	0.31%
过去六个月	2.82%	1.11%	5.44%	0.87%	-2.62%	0.24%
过去一年	5.47%	1.26%	-2.31%	0.91%	7.78%	0.35%
过去三年	40.45%	1.49%	10.97%	0.96%	29.48%	0.53%
过去五年	32.80%	1.48%	10.02%	1.03%	22.78%	0.45%
自基金合同生效日起至今	242.62%	1.71%	86.88%	1.13%	155.74%	0.58%
汇添富美丽 30 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	8.14%	0.99%	3.93%	0.68%	4.21%	0.31%
过去六个月	2.58%	1.12%	5.44%	0.87%	-2.86%	0.25%
过去一	5.20%	1.26%	-2.31%	0.91%	7.51%	0.35%

年						
自基金合同生效日起至今	2.14%	1.33%	-4.54%	0.98%	6.68%	0.35%
汇添富美丽 30 混合 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	8.22%	0.99%	3.93%	0.68%	4.29%	0.31%
过去六个月	2.62%	1.11%	5.44%	0.87%	-2.82%	0.24%
过去一年	5.09%	1.26%	-2.31%	0.91%	7.40%	0.35%
自基金合同生效日起至今	2.04%	1.33%	-4.54%	0.98%	6.58%	0.35%

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

汇添富美丽30混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

汇添富美丽30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（2013 年 06 月 25 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 2022 年 03 月 07 日新增 C、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		
王栩	本基金的基金经理,总经理助理，权益投资总监	2013 年 06 月 25 日		21	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公

					司研究员。2004 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任总经理助理、权益投资总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月 21 日至 2013 年 5 月 10 日任汇添富医药保健混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 7 月 10 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月 25 日至今任汇添富美丽 30 混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 18 日至 2022 年 11 月 4 日任汇添富外延增长主题股票型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月

					8日至今任汇添富大盘核心资产增长混合型证券投资基金的基金经理。2021年9月7日至今任汇添富精选核心优势一年持有期混合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，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13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

一季度 A 股市场延续了去年四季度以来的上涨趋势，沪深 300 指数上涨 4.63%，中证500 指数上涨 8.11%，创业板指数上涨 2.25%。市场的上涨得益于内外部环境的改善。海外方面，美联储如预期放缓了加息的速度，今年以来连续两次加息幅度都为25个基点。尽管通胀仍处于较高水平，但由于硅谷银行和瑞士信贷银行事件，美、欧央行未来可能需要提高对通胀的容忍度以保障金融体系的稳定。市场预期美联储将很可能在 5 月份的议息会议上最后一次加息25基点，这轮激进的紧缩周期也将迎来拐点。全球风险资产价格在加息放缓和经济衰退的双重预期下表现不一，美、欧股市和黄金价格相对更受益于加息放缓的预期而表现良好，尤其是纳斯达克指数一季度上涨了 16.77%，原油、工业金属等大宗商品的价格则由于对经济衰退的担忧而相对低迷。国内的情况也有类似之处。尽管政府通过加大信贷供给等政策措施刺激经济，但房地产销售和出口仍面临比较大的压力，一季度国内经济复苏的力度并不强。在宽货币和弱复苏的背景下，少数有亮点的板块和行业特别容易受到投资者的追捧。例如科技行业，在政府加快数字中国建设的政策规划和人工智能飞速发展的双重刺激下成为一季度市场最重要的投资主题。另外，在国企改革和监管层探索建立具有中国特色的估值体系的刺激下，部分低估值行业也有比较好的表现。分行业来看，一季度计算机、传媒、通信这三个行业均上涨30%左右，表现最为出色；其他如电子、建筑装饰、石油石化、机械

设备等行业表现也相对较好；而房地产、商贸零售、银行、美容护理、综合、电力设备等行业表现较差，逆势下跌。

本基金在一季度根据产业和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。期末股票资产比例维持在 90%以上的较高水平。行业配置方面，主要增持了计算机、医药生物等行业，主要减持了军工、煤炭、电力设备等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富美丽 30 混合 A 类份额净值增长率为 8.34%，同期业绩比较基准收益率为 3.93%。本报告期汇添富美丽 30 混合 C 类份额净值增长率为 8.14%，同期业绩比较基准收益率为 3.93%。本报告期汇添富美丽 30 混合 D 类份额净值增长率为 8.22%，同期业绩比较基准收益率为 3.93%。

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	1,421,660,421.00	93.68
	其中：股票	1,421,660,421.00	93.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	94,253,106.82	6.21
8	其他资产	1,720,552.57	0.11

9	合计	1,517,634,080.39	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	156,122,521.50	10.32
C	制造业	952,831,980.47	62.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	361,603.20	0.02
E	建筑业	77,329.12	0.01
F	批发和零售业	15,778,870.12	1.04
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	200,242,321.65	13.23
J	金融业	22,170,000.00	1.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	46,444,496.77	3.07
N	水利、环境和公共设施管理业	162,432.19	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,013,762.73	1.32
R	文化、体育和娱乐业	7,455,103.25	0.49
S	综合	-	-
	合计	1,421,660,421.00	93.93

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

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	000568	泸州老窖	515,800	131,420,682.00	8.68
2	600702	舍得酒业	556,000	109,532,000.00	7.24
3	600188	兖矿能源	2,300,000	81,811,000.00	5.41
4	600256	广汇能源	8,033,678	74,311,521.50	4.91
5	688111	金山办公	150,000	70,950,000.00	4.69
6	603198	迎驾贡酒	1,060,000	70,606,600.00	4.67
7	688363	华熙生物	450,000	51,030,000.00	3.37
8	000651	格力电器	1,260,000	46,305,000.00	3.06
9	605089	味知香	600,000	44,970,000.00	2.97
10	000063	中兴通讯	1,300,000	42,328,000.00	2.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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,兖矿能源集团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	288,408.41
2	应收证券清算款	953,931.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	478,212.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,720,552.57

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	汇添富美丽 30 混合 A	汇添富美丽 30 混合 C	汇添富美丽 30 混合 D
本报告期期初基金份额总额	495,201,559.32	8,789.72	109,769.81
本报告期基金总申购份额	15,494,830.00	85,888.20	1,011.32
减：本报告期基金总赎回份额	17,093,752.14	78,146.73	21,199.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	493,602,637.18	16,531.19	89,581.38

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

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美丽30股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富美丽30混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富美丽30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、报告期内汇添富美丽30混合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04月21日