

# 汇添富盈润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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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          | 添富盈润混合                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金主代码         | 004946                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金运作方式        | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金合同生效日       | 2017 年 09 月 06 日                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额(份) | 115,511,576.02                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资目标          | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。                                                                                                                                                                                    |
| 投资策略          | 本基金在保证资产配置符合基金合同规定的前提下，采用 CPPI（Constant Proportion Portfolio Insurance）恒定比例组合保险策略来实现本金保值和增值的目标。CPPI 策略主要根据市场的波动来调整、修正风险类资产的风险乘数，以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，从而达到投资组合保值增值的目的。投资过程中，基金管理人将在风险类资产投资风险加大和收益增强这两者之间寻找适当的平衡点，即确定适 |

|                    |                                                                                                            |               |
|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
|                    | 当的风险乘数，力求既能够保证投资组合风险可控，又能够尽量地为投资者创造更多收益。<br>本基金的投资策略主要包含资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资投资策略。 |               |
| 业绩比较基准             | 中债综合指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%                                                                             |               |
| 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              | 中国建设银行股份有限公司                                                                                               |               |
| 下属分级基金的基金简称        | 添富盈润混合 A                                                                                                   | 添富盈润混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码        | 004946                                                                                                     | 004947        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 100,103,294.16                                                                                             | 15,408,281.86 |

§ 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) |               |
|-----------------|------------------------------------------|---------------|
|                 | 添富盈润混合 A                                 | 添富盈润混合 C      |
| 1. 本期已实现收益      | -557,816.20                              | -105,328.90   |
| 2. 本期利润         | 1,925,949.15                             | 97,243.69     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0161                                   | 0.0061        |
| 4. 期末基金资产净值     | 138,208,140.27                           | 20,699,681.76 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3807                                   | 1.3434        |

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

| 添富盈润混合 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       | 0.55%    | 0.23%       | 1.17%      | 0.17%         | -0.62% | 0.06%  |
| 过去六个月       | -1.05%   | 0.20%       | 1.12%      | 0.21%         | -2.17% | -0.01% |
| 过去一年        | 0.54%    | 0.21%       | -0.01%     | 0.22%         | 0.55%  | -0.01% |
| 过去三年        | 16.27%   | 0.35%       | 3.59%      | 0.24%         | 12.68% | 0.11%  |
| 过去五年        | 35.19%   | 0.37%       | 8.93%      | 0.25%         | 26.26% | 0.12%  |
| 自基金合同生效日起至今 | 42.39%   | 0.40%       | 9.44%      | 0.25%         | 32.95% | 0.15%  |
| 添富盈润混合 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       | 0.44%    | 0.23%       | 1.17%      | 0.17%         | -0.73% | 0.06%  |
| 过去六个月       | -1.25%   | 0.20%       | 1.12%      | 0.21%         | -2.37% | -0.01% |
| 过去一年        | 0.14%    | 0.21%       | -0.01%     | 0.22%         | 0.15%  | -0.01% |
| 过去三年        | 14.88%   | 0.35%       | 3.59%      | 0.24%         | 11.29% | 0.11%  |
| 过去五年        | 32.54%   | 0.37%       | 8.93%      | 0.25%         | 23.61% | 0.12%  |
| 自基金         | 38.65%   | 0.40%       | 9.44%      | 0.25%         | 29.21% | 0.15%  |

|          |  |  |  |  |  |  |
|----------|--|--|--|--|--|--|
| 合同生效日起至今 |  |  |  |  |  |  |
|----------|--|--|--|--|--|--|

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

添富盈润混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富盈润混合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 06 日）起 6 个月，建仓期结束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<br>(年) | 说明                                                                                                                                                               |
|----|--------------|---------------------|------|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |              | 任职日期                | 离任日期 |               |                                                                                                                                                                  |
| 胡奕 | 本基金的<br>基金经理 | 2020 年 07<br>月 01 日 |      | 9             | 国籍：中国。学<br>历：上海交通大<br>学金融硕士。从<br>业资格：证券投资<br>基金从业资格。从业经历：<br>2014 年 7 月至<br>2016 年 6 月任<br>汇添富基金管理<br>股份有限公司固<br>定收益助理研究<br>员；2016 年 7<br>月至 2018 年 6<br>月任汇添富基金 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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 2021 年 1 月 29 日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 2021 年 1 月 29 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助理。2019 年 9 月 1 日至 2021 年 1 月 29 日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 2022 年 9 月 5 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助理。2019 年 9 月 1 日至 2021 年 1 月 29 日任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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。2019 年 10 月 8 日至 2021 年 2 月 3 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基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2021 年 2 月 3 日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 2021 年 1 月 29 日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</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>金的基金经理助理。2019 年 10 月 8 日至 2021 年 1 月 29 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 2021 年 1 月 29 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 2022 年 10 月 10 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。2020 年 7 月 1 日至 2022 年 10 月 21 日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 2022 年 3 月 7 日任汇添富睿丰混合型证券投资</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 基金（LOF）的基金经理。2020 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 3 日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 2021 年 9 月 3 日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 2022 年 3 月 7 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。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。2021 年 2 月 3 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。2021 年 2 月 3 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。2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健欣享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 and 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内的公平交易模块，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

报告期内，国内宏观经济处于疫后复苏的初期，复苏方向逐步确认，复苏的力度和结构有所曲折。具体表现为，去年底到今年初较快的复苏预期在一季度中后段逐渐放缓，基建和制造业投资仍是拉动经济回升的主力，消费修复不全面，地产趋稳偏弱，出口有所走弱。政策方面，财政政策继续加力提效，财政支出与政府债务融资显示出较明显的前置特征。货币政策维持对稳经济的呵护力度，并适时实施降准稳定金融体系流动性。海外方面，年初加息政策放缓的预期升温，随后被海外经济和通胀韧性强于预期所打破，又在欧美银行危机的扰动下，资产预期反复摇摆，各类资产大幅震荡。

债券市场以春节为界整体收益率水平先上后下，春节前市场主线围绕疫后复苏的强预期持续上行，节后在复苏动能不足且对货币政策进一步宽松有所期待的推动下，收益率高位下行。同时，市场显现出较为明显的分层现象，利率债由于资金价格收敛呈现熊平行行情，信用债受益于利差收窄及供需格局改善而表现强劲，尤其是具备较强票息优势的中低评级品种和中长久期品种，在机构配置热情下持续下行。

股票市场节奏风格多变。春节前受益于疫后复苏的强预期，上证指数快速上涨 5.68%，和宏观经济复苏相关性大的板块领涨。春节后随着复苏节奏放缓，指数震荡走平，但行业层面分化较大。ChatGPT 引领的人工智能浪潮在算力和应用等方向打开产业链的未来空间，使得 TMT 板块大幅上涨；中特估值、一带一路、基建发力带动建筑、石油等央企提升估值。一季度涨幅靠前的板块是计算机 36.8%，传媒 34.2%，通信 29.5%，电子 15.5%，建筑 11.2%；领跌的板块是地产-6.1%，商贸零售-5.1%，银行-2.7%。

转债市场在春节前跟随股票市场快速上涨，中证转债上涨 4.45%。节后至 2 月底，权益市场走平，转债的平价也维持震荡，但因为部分绝对收益型资金获利了结，溢价率有所压缩，带动中证转债下行 1.28%。3 月份，股票市场小幅下跌，转债小幅上涨 0.41%，转债强于股票，一方面是由于转债近期供给不多，但需求稳健，另一方面是因为转债在二月已经提前压过一轮估值。报告期内中证转债指数上涨 3.53%，涨幅靠前的主要是人工智能、信创相关的 TMT 标的，和一带一路相关的建筑标的。

报告期内，组合遵循低波动绝对收益风格的操作思路。债券部分合理运用杠杆，根据市场波动适度调节久期，重点配置高等级信用债以获取票息收益。经济复苏背景下，股票仓位略高于中枢，组合坚持自下而上精选优质个股，行业和风格相对均衡，核心仓位是和宏观经济复苏相关的优质稳定成长型个股，以及一些安全边际较高、壁垒深厚的价值股，并适当配置产业趋势巨变带来高景气度的高速成长股，但谨慎规避估值透支的标的，以避免较大回撤。

转债仓位中性，基于绝对收益目标，主要配置一些安全边际较高、又具有一定弹性的转债。随着转债市场深度加大、个券分化凸显，波动中提供了一些自下而上配置优质转债的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期添富盈润混合 A 类份额净值增长率为 0.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.17%。  
本报告期添富盈润混合 C 类份额净值增长率为 0.44%，同期业绩比较基准收益率为 1.17%。

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              | 30,759,764.69  | 18.17        |
|    | 其中：股票             | 30,759,764.69  | 18.17        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 136,774,904.32 | 80.80        |
|    | 其中：债券             | 136,774,904.32 | 80.80        |
|    | 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      | 1,295,919.27   | 0.77         |
| 8  | 其他资产              | 438,222.42     | 0.26         |
| 9  | 合计                | 169,268,810.70 | 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              | 652,941.00    | 0.41  |
| C | 制造业              | 21,475,195.84 | 13.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 884,000.00    | 0.56  |
| E | 建筑业              | -             | -     |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,413,349.00  | 1.52  |
| H | 住宿和餐饮业           | 676,860.00    | 0.43  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,238,276.25  | 1.41  |
| J | 金融业              | -             | -     |
| 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       | 914,589.00    | 0.58  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 451,257.60    | 0.28  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 546,832.00    | 0.34  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 506,464.00    | 0.32  |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 30,759,764.69 | 19.36 |

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 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产 |
|----|------|-----|-------|---------|-------|
|----|------|-----|-------|---------|-------|

|    |        | 称    |        |              | 净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|-------------|
| 1  | 000568 | 泸州老窖 | 11,500 | 2,930,085.00 | 1.84        |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 6,000  | 2,436,300.00 | 1.53        |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 11,200 | 2,206,400.00 | 1.39        |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 800    | 1,456,000.00 | 0.92        |
| 5  | 600426 | 华鲁恒升 | 26,800 | 944,700.00   | 0.59        |
| 6  | 600309 | 万华化学 | 9,600  | 920,448.00   | 0.58        |
| 7  | 002028 | 思源电气 | 19,500 | 891,540.00   | 0.56        |
| 8  | 600900 | 长江电力 | 41,600 | 884,000.00   | 0.56        |
| 9  | 600026 | 中远海能 | 57,000 | 771,780.00   | 0.49        |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 26,100 | 760,032.00   | 0.48        |

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      | 9,922,419.45 | 6.24         |
| 2  | 央行票据      | —            | —            |
| 3  | 金融债券      | —            | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —            | —            |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 4  | 企业债券      | 103,629,473.86 | 65.21 |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -     |
| 6  | 中期票据      | 10,222,792.33  | 6.43  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 13,000,218.68  | 8.18  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 地方政府债     | -              | -     |
| 10 | 其他        | -              | -     |
| 11 | 合计        | 136,774,904.32 | 86.07 |

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  | 102101749 | 21 沪世博 MTN001 | 100,000 | 10,222,792.33 | 6.43         |
| 2  | 188924    | 21 南网 04      | 100,000 | 10,165,803.29 | 6.40         |
| 3  | 155098    | 19 国管 01      | 100,000 | 10,148,975.34 | 6.39         |
| 4  | 188755    | 21 临债 03      | 100,000 | 10,140,693.15 | 6.38         |
| 5  | 152544    | 20 沪地 01      | 100,000 | 10,134,396.16 | 6.38         |

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人民银行及其派出机构、中国银保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、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   | 54,952.82  |
| 2  | 应收证券清算款 | 375,428.05 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 7,841.55   |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |
| 9  | 合计      | 438,222.42 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 113013 | 国君转债 | 1,002,862.03 | 0.63         |
| 2  | 110067 | 华安转债 | 973,908.16   | 0.61         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 3  | 113052 | 兴业转债    | 920,287.85 | 0.58 |
| 4  | 127047 | 帝欧转债    | 906,024.89 | 0.57 |
| 5  | 110072 | 广汇转债    | 894,246.62 | 0.56 |
| 6  | 127032 | 苏行转债    | 864,422.03 | 0.54 |
| 7  | 113044 | 大秦转债    | 854,779.51 | 0.54 |
| 8  | 110079 | 杭银转债    | 848,966.69 | 0.53 |
| 9  | 113641 | 华友转债    | 802,796.15 | 0.51 |
| 10 | 127045 | 牧原转债    | 551,173.52 | 0.35 |
| 11 | 127056 | 中特转债    | 547,915.04 | 0.34 |
| 12 | 127053 | 豪美转债    | 533,172.44 | 0.34 |
| 13 | 123158 | 宙邦转债    | 368,417.87 | 0.23 |
| 14 | 111004 | 明新转债    | 337,271.06 | 0.21 |
| 15 | 118013 | 道通转债    | 241,671.57 | 0.15 |
| 16 | 113653 | 永 22 转债 | 238,207.77 | 0.15 |

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                | 添富盈润混合 A       | 添富盈润混合 C      |
|-------------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份<br>额总额  | 187,838,432.81 | 16,033,353.05 |
| 本报告期基金总申购<br>份额   | 180,253.83     | 530,740.95    |
| 减：本报告期基金总<br>赎回份额 | 87,915,392.48  | 1,155,812.14  |
| 本报告期基金拆分变<br>动份额  | -              | -             |
| 本报告期期末基金份<br>额总额  | 100,103,294.16 | 15,408,281.86 |

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末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              | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日 | 55,381,793.01 | -    | -             | 55,381,793.01 | 47.94    |
|                                                                                       | 2              | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 11 日 | 71,239,379.41 | -    | 71,239,379.41 | -             | -        |
| 产品特有风险                                                                                |                |                                 |               |      |               |               |          |
| 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。 |                |                                 |               |      |               |               |          |

**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。

**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盈润混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富盈润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、报告期内汇添富盈润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](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

2023 年 04 月 21 日