

# 汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资 基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

|               |                                                                                                                                                          |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称          | 汇添富稳健添益一年持有混合                                                                                                                                            |
| 基金主代码         | 010219                                                                                                                                                   |
| 基金运作方式        | 契约型开放式                                                                                                                                                   |
| 基金合同生效日       | 2021 年 01 月 20 日                                                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额(份) | 2,125,076,397.09                                                                                                                                         |
| 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          | 本基金将在有效控制风险的前提下，采用科学的资产配置策略和“自下而上”的精选个券策略，定量与定性分析相结合，力争实现基金资产的长期稳定增值。<br>本基金的投资策略主要包括：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、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略和融资投资策略。 |

|        |                                                                                                                            |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（经汇率调整）×7%+中债综合指数收益率×85%                                                                            |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。<br>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 基金管理人  | 汇添富基金管理股份有限公司                                                                                                              |
| 基金托管人  | 中国农业银行股份有限公司                                                                                                               |

§ 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 07 月 01 日 - 2023 年 09 月 30 日) |
|-----------------|------------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 8,464,588.77                             |
| 2. 本期利润         | -19,943,927.55                           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0091                                  |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,006,500,815.24                         |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9442                                   |

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

| 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 | -1.01%   | 0.31%       | -0.71%     | 0.15%         | -0.30% | 0.16% |

|             |        |       |        |       |        |       |
|-------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月       | -1.74% | 0.30% | -0.47% | 0.14% | -1.27% | 0.16% |
| 过去一年        | -0.79% | 0.28% | 0.91%  | 0.17% | -1.70% | 0.11% |
| 自基金合同生效日起至今 | -5.58% | 0.27% | -2.10% | 0.18% | -3.48% | 0.09% |

### 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

汇添富稳健添益一年持有混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



注：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2021 年 01 月 20 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<br>(年) | 说明 |
|----|----|-------------|------|---------------|----|
|    |    | 任职日期        | 离任日期 |               |    |

|    |              |                     |   |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|----|--------------|---------------------|---|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 李超 | 本基金的<br>基金经理 | 2022 年 03 月<br>07 日 | - | 11 | <p>国籍：中国。学历：清华大学工学学士，斯坦福大学管理系以及材料系双硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2013 年至 2019 年历任创金合信基金研究员，安邦资产管理有限责任公司研究员、投资经理助理、投资经理，国金基金管理有限公司基金经理（拟任）等，2019 年 7 月至 2021 年 7 月任大家资产管理有限责任公司高级投资经理。2021 年 7 月至 2022 年 3 月任汇添富基金管理有限公司专户投资经理。2022 年 3 月 7 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年</p> |
|----|--------------|---------------------|---|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |          |                  |   |   |                                                                                                                                                                                                                       |
|-----|----------|------------------|---|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |                  |   |   | <p>3 月 7 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 25 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。2022 年 10 月 21 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。2022 年 12 月 12 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 29 日至今任汇添富双颐债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 甘信宇 | 本基金的基金经理 | 2022 年 11 月 25 日 | - | 7 | <p>国籍：中国。学历：南京大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格，法律职业资格。从业经历：2015 年 7 月至 2022 年 2 月任汇</p>                                                                                                                                        |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>添富基金管理股份有限公司固定收益助理分析师、固定收益分析师、固定收益高级分析师，2022 年 3 月至今任汇添富基金管理股份有限公司基金经理助理。2022 年 3 月 1 日至 2022 年 9 月 15 日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 3 月 1 日至 2022 年 9 月 15 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助理。2022 年 3 月 1 日至 2023 年 8 月 9 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助理。2022 年 3 月 15 日至今任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金</p> |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>经理助理。<br/>2022 年 4 月 8 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富盛和 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2022 年 8 月 8 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助理。2022 年 4 月 8 日至 2023 年 8 月 9 日任汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 5 月 5 日至今任汇添富短债债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 6 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>富鑫裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>2022 年 8 月 9 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富鑫汇债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 10 月 17 日至今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。2022 年 10 月 17 日至今任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 4 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。</p> <p>2022 年 11 月 4 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。2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健添益一</p> |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 14 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 8 月 23 日至今任汇添富鑫裕一年定期开放债券型发起式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合规守信情况说明

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 14 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

股票部分：

报告期内，市场总体震荡下行，主要由于国内经济恢复不及预期等因素影响，同时也受到美联储加息节奏与持续性等影响。具体板块表现上看，前期涨幅较大的 TMT 板块，由于市场过去对人工智能技术进步速度的预期过高，导致板块估值过高而出现较大幅度下跌，同时机构历史上持仓较多的电新、军工等成长股板块也有较大回撤。

总体操作看，本基金维持了相对较高的仓位运作。我们对市场后期的判断仍然较为积极。企业与居民负债表的修复需要时间但终将到来，中国经济的潜力也有望得到进一步释放，同

时全球加息周期也进入后半程，风险资产的压力也将逐渐缓解。虽然市场由于短期经济的压力在定价上显得过度悲观，但一系列龙头公司整体处于很低的估值区间。具体操作看，基于看好部分具有较坚实的底部价值的公司，例如消费、煤炭等板块，在市场恐慌期间进行了较为坚定的买入；同时基于对估值合理、长期有竞争力的优质公司的中长期认可，本基金仍然逢低逐渐加大了对成长能力较强的优质公司的仓位暴露，因为我们坚信，长期看，筛选出好企业，以合理的估值买入或持有，并赚取公司成长带来的回报，才能创造长期可持续的收益率。

#### 债券部分：

2023 年三季度，国内经济延续逐月恢复态势，社融和信贷数据改善，房地产政策有所放松，季末制造业 PMI 重回扩张区间，同时仍旧面临着需求偏弱、内生动能不足的问题，物价指数同比增速偏低。三季度货币政策维持宽松，央行调降政策利率，DR007 季度均值较上季度略微下行。债券收益率呈 V 形走势，7 月-8 月上旬，增量政策预期与偏弱基本面的现实相互交织，债市窄幅震荡；8 月中旬，在金融数据走弱、政策利率调降、LPR 非对称调降等多重利好影响下，收益率快速下行；8 月下旬-9 月，随着房地产相关政策出现重大调整，经济扩张预期进一步加强，叠加银行间资金面阶段性偏紧，收益率趋势性上行。

报告期内，本基金债券资产以配置高等级信用债为主，并对信用类资产进行结构方面的优化。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-1.01%。同期业绩比较基准收益率为-0.71%。

#### 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   | 560,337,063.47   | 22.93        |
|    | 其中：股票  | 560,337,063.47   | 22.93        |
| 2  | 基金投资   | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资 | 1,795,737,878.10 | 73.50        |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 1,795,737,878.10 | 73.50  |
|   | 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      | 85,260,796.65    | 3.49   |
| 8 | 其他资产              | 1,850,449.50     | 0.08   |
| 9 | 合计                | 2,443,186,187.72 | 100.00 |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 99,940,207.39 元，占期末净值比例为 4.98%。

## 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         | 16,209,680.35  | 0.81         |
| B  | 采矿业              | 27,071,112.00  | 1.35         |
| C  | 制造业              | 303,003,610.55 | 15.10        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 53,354.01      | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 41,214.46      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 218,912.00     | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 19,167,649.47  | 0.96         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 5,396,850.00   | 0.27         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 47,494,380.65  | 2.37         |
| J  | 金融业              | 11,396,332.09  | 0.57         |
| K  | 房地产业             | 1,906,912.00   | 0.10         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 14,228,350.09  | 0.71         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 426,328.70     | 0.02         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 178,821.50     | 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       | 3,234,119.46   | 0.16  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 10,369,228.75  | 0.52  |
| S | 综合            | —              | —     |
|   | 合计            | 460,396,856.08 | 22.95 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例<br>（%） |
|---------|---------------|------------------|
| 10 能源   | —             | —                |
| 15 原材料  | —             | —                |
| 20 工业   | 8,486,106.43  | 0.42             |
| 25 可选消费 | 34,679,094.07 | 1.73             |
| 30 日常消费 | 4,042,160.15  | 0.20             |
| 35 医疗保健 | 2,895,599.82  | 0.14             |
| 40 金融   | 5,732,498.84  | 0.29             |
| 45 信息技术 | 20,138,785.14 | 1.00             |
| 50 电信服务 | 23,013,114.30 | 1.15             |
| 55 公用事业 | 428,900.26    | 0.02             |
| 60 房地产  | 523,948.38    | 0.03             |
| 合计      | 99,940,207.39 | 4.98             |

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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  | 601865 | 福莱特   | 394,100   | 11,160,912.00 | 0.56         |
| 1  | 06865  | 福莱特玻璃 | 688,000   | 11,111,398.14 | 0.55         |
| 2  | 02331  | 李宁    | 610,500   | 18,459,022.14 | 0.92         |
| 3  | 002541 | 鸿路钢构  | 631,675   | 17,895,352.75 | 0.89         |
| 4  | 603806 | 福斯特   | 540,124   | 15,425,941.44 | 0.77         |
| 5  | 00700  | 腾讯控股  | 52,400    | 14,723,263.23 | 0.73         |
| 6  | 600256 | 广汇能源  | 1,814,800 | 13,865,072.00 | 0.69         |
| 7  | 002352 | 顺丰控股  | 330,900   | 13,500,720.00 | 0.67         |
| 8  | 601636 | 旗滨集团  | 1,566,562 | 12,845,808.40 | 0.64         |
| 9  | 600188 | 兖矿能源  | 615,500   | 12,463,875.00 | 0.62         |
| 10 | 300750 | 宁德时代  | 58,308    | 11,838,273.24 | 0.59         |

#### 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      | 740,735,257.09   | 36.92 |
|    | 其中：政策性金融债 | 112,191,438.35   | 5.59  |
| 4  | 企业债券      | 633,518,619.37   | 31.57 |
| 5  | 企业短期融资券   | —                | —     |
| 6  | 中期票据      | 399,375,414.10   | 19.90 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 22,108,587.54    | 1.10  |
| 8  | 同业存单      | —                | —     |
| 9  | 地方政府债     | —                | —     |
| 10 | 其他        | —                | —     |
| 11 | 合计        | 1,795,737,878.10 | 89.50 |

#### 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  | 2120107   | 21 浙商银行永续债    | 1,500,000 | 156,071,178.08 | 7.78         |
| 2  | 092280105 | 22 南京银行永续债 01 | 1,000,000 | 102,108,635.62 | 5.09         |
| 3  | 102380694 | 23 首旅 MTN003  | 700,000   | 72,166,465.57  | 3.60         |
| 4  | 220308    | 22 进出 08      | 600,000   | 60,990,575.34  | 3.04         |
| 5  | 185711    | 22 国君 G3      | 600,000   | 60,888,601.64  | 3.03         |

## 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：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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，浙商银行股份有限公司、中国进出口银行、国泰君安证券股份有限公司、北京银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、成都农村商业银行股份有限公司、国家开发银行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   | 125,105.48   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,623,402.14 |
| 3  | 应收股利    | 99,068.44    |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 2,873.44     |
| 6  | 其他应收款   | —            |

|   |      |              |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | -            |
| 8 | 其他   | -            |
| 9 | 合计   | 1,850,449.50 |

#### 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  | 113059 | 福莱转债 | 6,472,876.35 | 0.32         |
| 2  | 127045 | 牧原转债 | 6,254,449.39 | 0.31         |
| 3  | 123107 | 温氏转债 | 5,739,491.96 | 0.29         |
| 4  | 113648 | 巨星转债 | 822,488.76   | 0.04         |
| 5  | 127073 | 天赐转债 | 618,361.67   | 0.03         |
| 6  | 113052 | 兴业转债 | 617,098.48   | 0.03         |
| 7  | 113055 | 成银转债 | 427,466.71   | 0.02         |
| 8  | 118025 | 奕瑞转债 | 56,529.56    | 0.00         |

#### 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

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 2,263,417,852.66 |
| 本报告期基金总申购份额   | 323,918.92       |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 138,665,374.49   |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 2,125,076,397.09 |

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

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稳健添益一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳健添益一年持有期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、报告期内汇添富稳健添益一年持有期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 10 月 25 日