

汇添富稳健收益混合型证券投资基金 2021 年 第 4 季度报告

2021 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 01 月 24 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2021 年 10 月 01 日起至 2021 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 | 汇添富稳健收益混合 |
| 基金主代码 | 009736 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 07 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 2,872,761,034.67 |
| 投资目标 | 本基金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、融资投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中债综合指数收益率×80% |

| | | |
|--------------------|--|------------------|
| 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。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 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富稳健收益混合 A | 汇添富稳健收益混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009736 | 009737 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 1,654,073,133.47 | 1,218,687,901.20 |

§ 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 10 月 01 日 - 2021 年 12 月 31 日) | |
|-----------------|--|------------------|
| | 汇添富稳健收益混合 A | 汇添富稳健收益混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 11,092,283.91 | 6,770,716.28 |
| 2. 本期利润 | 50,795,804.70 | 35,901,542.98 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0269 | 0.0258 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,661,855,620.45 | 1,217,346,523.01 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0047 | 0.9989 |

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

| 汇添富稳健收益混合 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 | 2.28% | 0.47% | 0.41% | 0.15% | 1.87% | 0.32% |
| 过去六个月 | -1.78% | 0.45% | -0.70% | 0.20% | -1.08% | 0.25% |
| 过去一年 | -2.06% | 0.48% | 0.24% | 0.22% | -2.30% | 0.26% |
| 自基金合同生效日起至今 | 0.47% | 0.41% | 1.70% | 0.21% | -1.23% | 0.20% |
| 汇添富稳健收益混合 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 | 2.18% | 0.48% | 0.41% | 0.15% | 1.77% | 0.33% |
| 过去六个月 | -1.97% | 0.45% | -0.70% | 0.20% | -1.27% | 0.25% |
| 过去一年 | -2.45% | 0.48% | 0.24% | 0.22% | -2.69% | 0.26% |
| 自基金合同生效日起至今 | -0.11% | 0.42% | 1.70% | 0.21% | -1.81% | 0.21% |

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

汇添富稳健收益混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富稳健收益混合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（2020年07月23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 | | |
| 徐一恒 | 本基金的 基金经理 | 2020 年 08 月 05 日 | | 11 | 国籍：中国。学历：武汉大学金融工程学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 9 月至 2014 年 12 月任汇添富基金管理股份有限公司债券分析师，2014 年 12 月至 2019 年 8 月任汇添富基金管理股份有限公司专户投资经理。2019 年 9 月 4 日至 2021 年 9 月 2 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。2019 年 12 月 4 日至 2021 年 9 月 2 日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 4 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。2020 年 6 月 4 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。2020 年 6 |

| | | | | | |
|-----|----------|------------------|--|----|---|
| | | | | | <p>月 4 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。2020 年 6 月 4 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 8 月 5 日至今任汇添富稳健收益混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月 10 日至今任汇添富稳健添盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 9 日至今任汇添富稳进双盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 刘伟林 | 本基金的基金经理 | 2021 年 08 月 03 日 | | 13 | <p>国籍：中国。学历：北京大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历：2008 年 7 月加入汇添富基金任行业分析师；2010 年 5 月至 2011 年 3 月在国家发展和改革委员会工作。2011 年 3 月至 2015 年 12 月在汇添富基金管理股份有限公</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>司担任高级策略分析师。2015 年 12 月 2 日至今任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 8 月 19 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。2019 年 9 月 17 日至今任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 7 月 27 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。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富稳健收益混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 17 日至今任汇添富均衡配置个股精选六个月持有期混合型证券投资</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--------------|
| | | | | | 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 11 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

四季度市场结构性行情比较突出，风格上中小盘资产表现更好。从行业涨幅看，表现好的行业包括传媒、军工、通信、轻工、电子、农业、汽车等，涨幅均超过 10%（申万一级行业）。表现较差的行业包括采掘、钢铁等强周期板块。

四季度的这种市场特征与三个原因相关。第一个对宏观经济的担心导致相关资产持续承压。四季度宏观经济下滑的压力进一步加大，包括房地产产业、消费等需求表现非常疲弱。尤其四季度疫情出现反复，线下消费相关行业进一步低迷。因此，与宏观经济高度相关的资产不断承压。第二个市场对经济政策进一步放松的预期增强。包括房地产的政策更加积极和友好，货币政策宽松的预期进一步增强，这种环境下，房地产产业链估值逐步修复，同时对流动性敏感的成长类资产、中小盘资产表现活跃。第三，新的一些细分产业机会出现。包括在新能源汽车销量出现爆发性增长后，后端的汽车零部件、智能驾驶等行业带来驱动力；包括光伏风能等大发展后，对储能等行业的拉动；元宇宙作为一种新的技术观、新的传媒形式，带动产业链中电子等硬件的需求、内容等传媒的需求。

对于我们的投资策略来说，我们保持一个相对稳定的仓位，积极寻找结构性机会。第一，坚守真正有价值的资产。比如在免税、高端白酒、家电龙头、半导体、新能源汽车等行业里，我们看到这些行业在宏观经济有压力时，仍然表现出非常强的韧性，其龙头企业的经营也一切正常，这些优质资产未来几年的增长还是相对确定，市场先生的狂躁只是影响这些资产的波动并不会影响他们的价值，因此我们选择坚守。尤其在出现非理性下跌时，进一步加大配置。我们在港股市场，看到互联网龙头受多种因素影响，出现了非理性的大幅下跌，适当加大了部分逆向投资；第二，积极寻找结构性机会。包括在新能源汽车细分的子行业、新一代传媒等细分行业里，寻找具备高成长的机会。

对于债券资产而言，四季度经济体系持续处于宽货币、紧信用的状态，债券资产处于相对占优的宏观环境当中。

我们通过对货币信用创造过程的拆解，形成对周期定位的判断。从相对较低的银行间融

资回购利率和季节调整后的融资利率波动率、银行间市场融资便利度等指标来看，流动性维持合理充裕，货币环境宽松。影响信用创造的几条关键产业链四季度处于弱势，信用环境整体偏紧。传统货币信用传导，以围绕城镇化的地产、基建、汽车等产业链条的信用派生实现，从宽货币起步，在地产与基建投资的拉动下最终带动全社会信用修复。2021 年下半年，个别民营地产企业出现流动性风险，高周转高杠杆的行业商业模式遇阻，货币环境仍然宽松，地产却难再成为信用创造的主要力量。地方政府隐性债务控制持续全年，卖地收入下降也对地方政府基建投资形成掣肘，基建产业链寻求进入更为良性和更具备可持续性的循环。

展望未来一段时间，货币环境延续温和，信用创造将从底部回暖，信用脉冲有望回升，但本轮信用回升的整体力度与幅度均弱于过往历史可比阶段。我们从经济基本面与政策前瞻指引的二维分析框架出发，“稳字当头、稳中求进，逆周期与跨周期并行”的央行货币政策表态，已经明确未来一段时间合理充裕的货币市场环境方向。从银行体系信用创造的动能来看，银行家问卷调查与票据利率波动均显示信贷审批力度或有大幅提升，历史来看，这对社会信用的派生具有良好的指示性。从信用创造的产业链角度，地产企业拿地的收益水平有所回升，行业正在向正常状态回归，地产链条对信用创造的拖累将有望修复。在经济建设为中心的方向指引下，积极的财政将更加有为，2021 年专项债发行资金到位将带动 2022 年基建投资发力提前。但我们需要认识到，在“房住不炒”的前提下，房地产行业难以回到过去几年的高增速区间，基建投资的回升也将持续受到隐性债务压降的约束，因此本轮信用扩张的力度将显著弱于历史过往。

我们考虑一项资产的投资，基于对其“胜率-赔率”的判断。对于债券这类有票息且净价波动率较低的资产而言，机会成本较高的特征，决定了胜率判断是债券投资的核心，赔率判断作为辅助性的手段，一定程度承担了风险控制的功能。货币信用周期定位属于债券资产胜率判断的方法体系，收益率的绝对水平、收益率曲线结构与相对资产估值等则形成债券资产赔率判断的重要内容。目前阶段，债券资产的胜率仍处于较高水平，但赔率整体大幅下降。

从更长的时间维度来思考，可以观察到，跨周期的货币政策框架正与更加可持续的财政体系相互作用，货币周期与信用周期的波动幅度因此呈现出逐年下降趋势；从经济结构观察的角度，消费与制造业企业的经济总量占比上升，高质量经济增长体现出对债务依赖型经济增长的逐步替代，平滑了债务周期的波动。周期波动的下降对应着债券收益波动率的下行，未来随着地产投资在经济总量贡献中的逐步退出，债券资产收益率低波动的特征可能成为常态。

报告期内，3 个月 Shibor 利率在 2.42%到 2.50%的区间窄幅波动，10 年期国债利率最高

从 3.07%下行至 2.77%，3 年期 AAA 级信用债利率由 3.33%最低下行至 2.95%，3 年期 AA 级信用债利率从 4.12%最低下行至 3.70%。

本基金债券部分定位于提供组合稳健的底仓收益并通过适度暴露久期风险，与权益资产形成股债对冲，提升组合整体的夏普比率。组合债券资产以“信用+”的绝对收益投资策略，在报告期维持中性的组合久期，精选高资质信用债，以高等级信用债的持有票息收益为底层收益来源，以利率债与信用债市场的结构性机会作为收益增厚。

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 2.28%;C 类基金份额净值增长率为 2.18%。同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

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 | 1,071,067,503.66 | 31.97 |
| | 其中：股票 | 1,071,067,503.66 | 31.97 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,217,092,600.00 | 66.18 |
| | 其中：债券 | 2,217,092,600.00 | 66.18 |
| | 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 | 33,201,904.36 | 0.99 |
| 8 | 其他资产 | 28,792,349.77 | 0.86 |
| 9 | 合计 | 3,350,154,357.79 | 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 333,621,761.77 元,占期末净值比例为 11.59%。

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 | 69,039.95 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 10,463.66 | 0.00 |
| C | 制造业 | 445,474,723.56 | 15.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 79,088.44 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 147,011.68 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 789,287.36 | 0.03 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 129,251.70 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | 48,812.16 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 165,004,189.59 | 5.73 |
| J | 金融业 | 15,269,989.06 | 0.53 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 30,232,437.07 | 1.05 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 29,958,571.58 | 1.04 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 529,840.61 | 0.02 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 16,279.37 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 49,686,756.10 | 1.73 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 737,445,741.89 | 25.61 |

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 （%） |
|---------|----------------|------------------|
| 10 能源 | - | - |
| 15 原材料 | - | - |
| 20 工业 | - | - |
| 25 可选消费 | 97,795,106.42 | 3.40 |
| 30 日常消费 | 49,561,890.00 | 1.72 |
| 35 医疗保健 | - | - |
| 40 金融 | - | - |
| 45 信息技术 | 28,392,190.18 | 0.99 |
| 50 电信服务 | 157,872,575.17 | 5.48 |
| 55 公用事业 | - | - |
| 60 房地产 | - | - |
| 合计 | 333,621,761.77 | 11.59 |

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 | 002624 | 完美世界 | 5,826,881 | 118,343,953.11 | 4.11 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 280,500 | 104,761,050.24 | 3.64 |
| 3 | 03690 | 美团- | 459,400 | 84,661,466.18 | 2.94 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| | | W | | | |
| 4 | 603799 | 华友钴业 | 735,200 | 81,099,912.00 | 2.82 |
| 5 | 002011 | 盾安环境 | 4,908,000 | 67,239,600.00 | 2.34 |
| 6 | 002371 | 北方华创 | 168,100 | 58,334,062.00 | 2.03 |
| 7 | 01024 | 快手-W | 901,600 | 53,111,524.93 | 1.84 |
| 8 | 06969 | 思摩尔国际 | 1,525,000 | 49,561,890.00 | 1.72 |
| 9 | 002568 | 百润股份 | 701,900 | 41,994,677.00 | 1.46 |
| 10 | 300413 | 芒果超媒 | 586,800 | 33,576,696.00 | 1.17 |

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 | 200,060,000.00 | 6.95 |
| | 其中：政策性金融债 | 200,060,000.00 | 6.95 |
| 4 | 企业债券 | 1,947,200,600.00 | 67.63 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 69,832,000.00 | 2.43 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------------|-------|
| 10 | 合计 | 2,217,092,600.00 | 77.00 |
|----|----|------------------|-------|

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 | 163903 | 20 海通 08 | 2,000,000 | 202,480,000.00 | 7.03 |
| 2 | 163763 | 20 信投 G5 | 2,000,000 | 202,260,000.00 | 7.02 |
| 3 | 210304 | 21 进出 04 | 2,000,000 | 200,060,000.00 | 6.95 |
| 4 | 149278 | 20 湘路 08 | 1,500,000 | 152,130,000.00 | 5.28 |
| 5 | 175062 | 20 光证 G5 | 1,000,000 | 101,450,000.00 | 3.52 |

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,海通证券股份有限公司、中国进出口银行、腾讯控股有限公司、美团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 | 1,598,124.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,951,827.49 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 24,210,563.03 |
| 5 | 应收申购款 | 31,834.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 28,792,349.77 |

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 | 汇添富稳健收益混合 A | 汇添富稳健收益混合 C |
|---------|------------------|------------------|
| 本报告期初基金 | 2,065,355,319.77 | 1,533,620,939.06 |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 份额总额 | | |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,514,729.06 | 4,870,089.41 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 413,796,915.36 | 319,803,127.27 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 1,654,073,133.47 | 1,218,687,901.20 |

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稳健收益混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳健收益混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳健收益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收益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

2022 年 01 月 24 日