

汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 年 06 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2024 年 07 月 19 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富保鑫灵活配置混合
基金主代码	003189
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 15 日
报告期末基金份额总额(份)	39,117,286.70
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过积极主动的资产配置，充分挖掘各大类资产投资机会，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、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、融资投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+中债综合全价指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富保鑫灵活配置混合 A	汇添富保鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	003189	012607
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	38,561,745.21	555,541.49

§ 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(2024年04月01日 - 2024年06月30日)	
	汇添富保鑫灵活配置混合 A	汇添富保鑫灵活配置混合 C
1. 本期已实现收益	513,598.73	6,966.88
2. 本期利润	985,875.11	13,981.09
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0264	0.0251
4. 期末基金资产净值	54,667,003.96	779,330.00
5. 期末基金份额净值	1.4176	1.4028

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

汇添富保鑫灵活配置混合 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	1.90%	0.11%	0.70%	0.07%	1.20%	0.04%
过去六个月	4.64%	0.14%	2.20%	0.09%	2.44%	0.05%
过去一年	4.85%	0.12%	1.81%	0.09%	3.04%	0.03%
过去三年	4.70%	0.15%	-5.80%	0.27%	10.50%	-0.12%
自基金合同生效日起至今	19.63%	0.18%	9.95%	0.45%	9.68%	-0.27%
汇添富保鑫灵活配置混合 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	1.82%	0.11%	0.70%	0.07%	1.12%	0.04%
过去六个月	4.46%	0.14%	2.20%	0.09%	2.26%	0.05%
过去一年	4.45%	0.12%	1.81%	0.09%	2.64%	0.03%
自基金合同生效日起至今	3.38%	0.15%	-5.21%	0.26%	8.59%	-0.11%

3.2.2 自基金转型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

汇添富保鑫灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富保鑫灵活配置混合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（2019年10月15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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金由原汇添富保鑫保本混合型证券投资基金于 2019 年 10 月 15 日转型而来。

本基金于 2021 年 6 月 30 日新增 C 类份额。

§ 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		
吴江宏	本基金的基金经理, 稳健收益部总经理	2016 年 09 月 29 日	-	13	<p>国籍：中国。</p> <p>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，现任稳健收益部总经理。</p> <p>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 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵</p>

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	---

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					<p>月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日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 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月 25 日至今任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月 21 日至今任汇添富鑫享</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 10 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 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>
胡奕	本基金的基金经理	2021 年 02 月 03 日	-	10	<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</p>

				<p>研究员。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--	--	--

					<p>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。</p> <p>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。</p> <p>2019 年 9 月 1 日至 2024 年 6 月 13 日任汇添富 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 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。</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>配置混合型证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2020 年 7 月 1 日至 2024 年 1 月 22 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>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基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2020 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 3 日</p>
--	--	--	--	--	---

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					基金的基金经理。2024 年 3 月 22 日至今任汇添富添乐双鑫债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 28 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注: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。

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。

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,保障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,公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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 5 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。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，中国经济经历了由复苏向稳态的转变，整体增速呈现边际放缓的趋势。政策方面，各项经济政策部署加快落地，特别是在房地产领域，政策调整从单一的供给端转向了供需两端的协同发力。财政政策方面，超长期特别国债启动发行，积极推进“两重”项目的投资建设，国债和专项债发行速度也有所加快；货币政策方面，央行继续通过公开市场操作，维持合理充裕的市场流动性，并通过一系列措施，包括下调首付比例、取消房贷利率下限、降低公积金贷款利率以及推出保障性住房再贷款方式等支持稳地产政策环境。

报告期内，债券市场整体呈现出以安全资产荒为主导的震荡下行趋势。4 月上中旬，延续 3 月以来的低位震荡行情，至新低后债券市场出现一定回调，尤其是长端利率品种出

现较大幅度上行，市场波动率有所放大。进入 4 月底，市场开始展现出结构性机会，信用品种因其配置价值而率先下行，随着非银资金的充裕和对安全资产的追求，由短端带动长端，债券收益率水平全面下行，至 6 月末达到了新的低点。从曲线结构上看，由于资金分层现象的消失，中短端债券的下行更为显著，曲线呈现出陡峭化的趋势；同时机构投资者的配置情绪高涨，信用利差被压缩至较为极致的水平。

报告期内，股票市场先涨后跌，波动较大。4 月上中旬以震荡为主；4 月下旬至 5 月中旬，在持续政策落地刺激下，市场阶段性反弹；5 月下旬开始上证指数持续下跌 6.43%。二季度上证指数下跌 2.42%，创业板指下跌 7.41%。市场风险偏好下行，更偏好红利类资产，规避小微市值股票，银行、公用事业、电子涨幅靠前，综合、传媒、商贸零售跌幅最大。

报告期内，转债市场大体跟随股票波动，但由于转债中银行比例较高，因此指数表现优于股票，中证转债上涨 0.75%。6 月以来，市场担忧个别转债的退市、信用风险，集中抛售略有瑕疵的转债，带动低价转债大幅调整，二季度万得可转债低价指数下跌 0.09%，弱于中证转债指数。

报告期内，组合遵循低波动绝对收益风格的操作思路。债券仓位，组合合理运用杠杆，根据市场波动积极调整久期，并重点配置了高等级信用债券，同时适度参与利率债券的交易。股票仓位在中枢附近波动，组合坚持自下而上精选优质个股，行业和风格相对均衡，核心仓位一是经营壁垒高、长期稳健的高股息价值股，二是估值合理或低估的优质稳健成长型个股，谨慎规避估值透支的标的，以避免较大回撤。转债精选价格已经接近债底、信用风险较低、且有上涨可能的标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富保鑫灵活配置混合 A 类份额净值增长率为 1.90%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%。本报告期汇添富保鑫灵活配置混合 C 类份额净值增长率为 1.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

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	3,837,214.00	5.18
	其中：股票	3,837,214.00	5.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,432,911.11	87.06
	其中：债券	64,432,911.11	87.06
	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	1,527,682.80	2.06
8	其他资产	4,210,597.71	5.69
9	合计	74,008,405.62	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	604,689.00	1.09
C	制造业	986,108.00	1.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	765,544.00	1.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	404,990.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,500.00	0.19
J	金融业	660,589.00	1.19

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	173,922.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	77,480.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	56,392.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	3,837,214.00	6.92

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	600938	中国海油	11,200	369,600.00	0.67
2	000333	美的集团	3,500	225,750.00	0.41
3	605368	蓝天燃气	13,600	185,504.00	0.33
4	600900	长江电力	6,100	176,412.00	0.32
5	002027	分众传媒	28,700	173,922.00	0.31
6	600674	川投能源	8,900	166,875.00	0.30
7	002270	华明装备	7,400	164,576.00	0.30
8	601899	紫金矿业	8,100	142,317.00	0.26
9	600461	洪城环境	11,900	137,802.00	0.25
10	603871	嘉友国际	6,600	116,754.00	0.21

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	929,710.74	1.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,251,502.25	63.58
	其中：政策性金融债	3,054,039.45	5.51
4	企业债券	22,810,616.88	41.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,441,081.24	9.81
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	64,432,911.11	116.21

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	242380017	23 农行永续债 01	40,000	4,260,041.97	7.68
2	2128025	21 建设银行二级 01	40,000	4,235,534.43	7.64
3	115830	23 信投 G2	40,000	4,202,160.44	7.58
4	188609	21 中证 13	40,000	4,194,960.44	7.57
5	188128	21 国君 G4	40,000	4,128,791.8	7.45

				9	
--	--	--	--	---	--

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,中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、江苏银行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	5,717.58
2	应收证券清算款	4,196,283.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	8,596.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,210,597.71

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	127045	牧原转债	312,442.26	0.56
2	113059	福莱转债	243,531.48	0.44
3	110081	闻泰转债	233,881.30	0.42
4	111010	立昂转债	212,488.24	0.38
5	113052	兴业转债	211,024.46	0.38
6	118022	锂科转债	183,535.21	0.33
7	113636	甬金转债	166,295.00	0.30
8	113652	伟 22 转债	141,389.49	0.26
9	123113	仙乐转债	139,700.00	0.25
10	113661	福 22 转债	128,689.93	0.23
11	111004	明新转债	128,579.24	0.23
12	127018	本钢转债	114,534.36	0.21
13	123179	立高转债	113,443.89	0.20
14	113050	南银转债	111,616.75	0.20
15	113049	长汽转债	108,452.62	0.20
16	128124	科华转债	107,919.88	0.19
17	118035	国力转债	106,889.13	0.19
18	123183	海顺转债	106,857.58	0.19
19	118033	华特转债	106,183.19	0.19
20	128131	崇达转 2	105,285.12	0.19

21	113640	苏利转债	104,396.06	0.19
22	127016	鲁泰转债	103,064.28	0.19
23	113056	重银转债	101,951.63	0.18
24	110085	通 22 转债	100,478.66	0.18
25	123193	海能转债	94,919.92	0.17
26	110087	天业转债	94,097.88	0.17
27	128074	游族转债	85,091.62	0.15
28	127044	蒙娜转债	80,449.53	0.15
29	128134	鸿路转债	78,176.60	0.14
30	113065	齐鲁转债	76,378.40	0.14
31	113650	博 22 转债	73,023.50	0.13
32	118005	天奈转债	72,919.50	0.13
33	118014	高测转债	70,192.57	0.13
34	118032	建龙转债	58,944.56	0.11
35	123115	捷捷转债	56,475.16	0.10
36	118011	银微转债	56,371.15	0.10
37	113053	隆 22 转债	55,962.70	0.10
38	113643	风语转债	55,772.49	0.10
39	123233	凯盛转债	55,280.84	0.10
40	128097	奥佳转债	55,279.69	0.10
41	118000	嘉元转债	54,039.08	0.10
42	118042	奥维转债	53,908.26	0.10
43	127026	超声转债	53,670.71	0.10
44	110089	兴发转债	52,818.15	0.10
45	118038	金宏转债	52,418.86	0.09
46	113606	荣泰转债	52,368.43	0.09
47	113677	华懋转债	51,936.33	0.09
48	110062	烽火转债	51,701.07	0.09
49	123182	广联转债	50,047.99	0.09

50	113042	上银转债	50,016.34	0.09
51	127042	嘉美转债	48,582.68	0.09
52	118024	冠宇转债	42,765.05	0.08
53	113656	嘉诚转债	40,174.43	0.07
54	123154	火星转债	37,174.08	0.07
55	123124	晶瑞转 2	31,728.40	0.06
56	123202	祥源转债	27,962.77	0.05
57	118006	阿拉转债	26,189.77	0.05
58	128125	华阳转债	26,117.92	0.05
59	113654	永 02 转债	25,495.05	0.05

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	汇添富保鑫灵活配置混合 A	汇添富保鑫灵活配置混合 C
本报告期初基金份额总额	36,583,062.75	540,878.56
本报告期基金总申购份额	3,847,620.09	48,582.85
减：本报告期基金总赎回份额	1,868,937.63	33,919.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,561,745.21	555,541.49

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保鑫保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富保鑫灵活配置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、报告期内汇添富保鑫灵活配置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

2024 年 07 月 19 日