汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资 基金 2022 年第 4 季度报告

2022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:中国工商银行股份有限公司

送出日期: 2023年01月20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 1 月 18 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 2022年10月01日起至2022年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1基金基本情况

基	
金	(本) 本区 夕田 西
简	添富成长多因子股票
称	
基	
金	
主	001050
代	
码	
基	
金	
运	契约型开放式
作	大 约至月
方	
式	
基	
金	2015年02月16日
合	2013 中 02 万 10 日
同	

生	
工 效	
日日	
报	
告 告	
期	
末	
基	
金金	
份	464, 353, 830. 59
额	
总总	
额	
(份)	
(04)	
投	
资	本基金通过多因子量化模型方法,精选股票进行投资,在严格控制风险的前提下,
目	力争获取超越比较基准的投资回报。
标	
投资策略	本基金主要投资于成长型行业的股票,采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。在本基金的投资过程中,将控制股票投资组合与业绩比较基准指数的结构性偏离,以期在长期实现持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。本基金在股票投资过程中将坚持量化模型驱动的投资决策流程,强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险,力争基金资产长期稳定增值。本基金的投资策略主要包括:行业配置策略、多因子量化选股策略、资产配置策略、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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基 金 托	中国工商银行股份有限公司

to to		7
管		
人		
下		
属		
分		
级		
基		
金,,	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C
的		
基		
金		
简		
称		
下		
属		
分		
级		
基。	001050	01.0054
金	001050	016854
的		
交		
易小		
代		
码		
报		
告		
期		
末		
下屋		
属公		
分级		
级	464 900 76E 69	62 064 06
基金	464, 290, 765. 63	63, 064. 96
金的		
份		
额		
一一一		
额		
(份)		

注: 本基金于 2022 年 10 月 12 日新增 C 类份额。

§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(2022年10月01日-2022年12月31日)					
	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C			
1. 本期已实现收益	-23, 846, 198. 89	-693. 61			
2. 本期利润	24, 351, 431. 63	-1, 757. 11			
3. 加权平均基金份额本期利	0.0509	-0.0710			
润					
4. 期末基金资产净值	793, 381, 837. 00	107, 645. 52			
5. 期末基金份额净值	1.709	1. 707			

- 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

	添富成长多因子股票 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	1)-3	2-4			
过去三个 月	3. 14%	0.96%	2. 40%	0. 92%	0.74%	0. 04%			
过去六个 月	-7. 72%	1.01%	-8.18%	0.99%	0.46%	0. 02%			
过去一年	-13.90%	1.25%	-18. 28%	1.24%	4. 38%	0.01%			
过去三年	41.94%	1.25%	10.93%	1.21%	31.01%	0.04%			
过去五年	50.84%	1. 28%	-4.36%	1. 27%	55. 20%	0.01%			
自基金合 同生效日 起至今	70.90%	1.61%	4. 32%	1.50%	66. 58%	0.11%			
添富成长多因子股票 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			

自基金合						
同生效日	1.55%	0.93%	0.56%	0.89%	0.99%	0.04%
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

添富成长多因子股票A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





添富成长多因子股票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(2015年02月16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 10 月 12 日新增 C 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

#4 灯	1117 夕	任本基金的基	基金经理期限	证券从业年	2삼 미
姓名	职务	任职日期	离任日期	限(年)	说明
吴振翔	本基金的基 金经理,指数 与量化投资 部副总监	2015年02 月16日		16	国学科学士格资资经长理金究第二: 技理从证金。 : 基格历盛有融员中中术学业券从从曾金公程上、中国大博资投业业任管司研投

		摩根基金管
		理有限公司
		产品开发高
		级经理。
		2008年3月
		加入汇添富
		基金管理股
		份有限公司,
		历任产品开
		发高级经理、
		数量投资高
		级分析师、
		基金经理助
		理,现任指
		数与量化投
		资部副总监。
		2010年2月
		6 日至今任
		汇添富上证
		综合指数证
		券投资基金
		的基金经理。
		2011年9月
		16 日至 2013
		年11月7日
		任深证 300
		交易型开放
		式指数证券
		投资基金的
		基金经理。
		2011年9月
		28 日至 2013
		年11月7日
		任汇添富深
		证 300 交易
		型开放式指
		数证券投资
		基金联接基
		金的基金经
		理。2013年
		8月23日至
		2015年11
		月2日任中
		证金融地产
		交易型开放
		式指数证券

		投资基金的
		基金经理。
		2013年8月
		23 日至 2015
		年11月2日
		任中证能源
		交易型开放
		式指数证券
		投资基金的
		基金经理。
		2013年8月
		23 日至 2015
		年11月2日
		任中证医药
		卫生交易型
		开放式指数
		证券投资基
		金的基金经
		理。2013年
		8月23日至
		2015年11
		月2日任中
		证主要消费
		交易型开放
		式指数证券
		投资基金的
		基金经理。
		2013年11
		月6日至今
		任汇添富沪
		深 300 安中
		动态策略指
		数型证券投
		资基金的基
		金经理。
		2015年2月
		16 日至今任
		汇添富成长
		多因子量化
		策略股票型
		证券投资基
		金的基金经
		理。2015年
		3月24日至
		2022年6月
		13 日任汇添
		10 日 1111111111111111111111111111111111

富中证 表 型		 	
开放投资基金的基金。的基金经验全的基金。的基金经验经验。 的基金经验经验,2016年1月21日至高中证精准级型类数 资基金。(LOF)的基金。(LOF)的基金。(LOF)的基金。第二十二十分,			富中证主要
证券投基金的基金年3月21日 日本 2016 日本 7月 日本 2016 日本 7月 日本 2016 日本 7月 日本 2016 年 12 月 22 日本 2017 年 2017 年 8月 10日 日本 2017 年 8月 10日 日本 2017 年 8月 10日 10日 2018 年 3月 23日 4日 4日 23日 4日 23			消费交易型
金联接基金的基金经理。2016年1月21日至今证清准医疗型发起式正常中证精准医疗型发起式基金(LOF)的基金经理。2016年7月28日至今相上企交精资基约。2016年12月28日至高中地还互搬指资基约。00基年12月22日百富中地正互题发资资业。2016年12月22日百富中地正互题发资资业。2017年8月10日至高数型发发资讯。参投资证金(LOF)。2017年8月10日至高数证金,发现基本会(LOF)的基金经理。2018年3月23日高常沙型、发现基本的基本经验。2018年3月23日高常沙型、企会经理。2018年3月23日高常沙型、企会经理。2018年3月23日高常沙型、企会经理。2018年3月23日高常沙型、企会经理。2018年3月23日高常沙型、企会经理。2018年4月21版,2018年4月			开放式指数
的基金经里。2016年1月21日至今中证 1月21日至今中证 1月21日至今中证 1月21日至今中证 1月28日至外数			证券投资基
2016年1月 21日至今任 汇添富疗理 精推医疗型发 起式证券投 资基金 (LOF)的基 金经理。 2016年7月 28日至今相 中证上局型开 放式指数基金 的基金经理。 2016年12月22日富中 证五联则指数 型发起式基金 (LOF)超上式基数 型发投资基的 全经理。 2017年8月 10日至中 汇添霜数 证券投资基)的基 金经理。 2017年8月 10日至中 汇添霜数型发起式基金 (LOF)。基金 企经理。 2018年3月 23日至 2018年3月 23日至 23日年第月 23日至今 任汇添富数理。 2018年3月 23日至今 任汇添富数型运费。			金联接基金
21 日至今任 汇添富的证 整型类 起式证金 (LOF) 基 金经理。 2016 年 7 月 28 日至今日 中证易型数证金 约基金的的基金理, 2016 年 12 月 22 日宫网相式基理, 2016 年 12 月 22 日宫网相式或基单 投资基础。 2017 年 8 月 10 日至中 证五数证类 投资上、基金的 100产到型 发起式基。 (LOF) 指数证金 (LOF) 指数证金 (LOF) 基基。金经理。 2018 年 3 月 23 日至富沙 数量、2018 年 3 月 23 日至宫沙 数增 强数或型证金的基础。			的基金经理。
汇添富中证 精准数型发 透基金 (LOP)的基 金经理。 2016年7月 28日至今届 中证上房型开放式投资基金的基金经理。 2016年12 月22日至今 任汇证联网查 型发投资基金 (LOP)的基 金经理。 2017年8月 10日至今任 汇添销数证 发起式证金 转投资基金 (LOP)的基 金经理。 2017年8月 10日至今任 汇添销数证数 发起式证券 投资基金 (LOP)的基 金经理。 2018年3月 23日至产 23日至产 30名数增 强型数增			2016年1月
精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LLOF)的基金经回。 2016年7月28日至今任中证上每四租企交易型数正分数型证券投资基金的基础经理。 2016年12月22日至日至中证上重要中证了主题相数型发起资本。 (LOF)的基金经理。 2017年8月10日至今中证了经过,100年的基金公理。 2017年8月10日至今证500指数证券投资基金((LOF)的基金经理。 2018年3月23日至产产资本。 2018年3月23日至产产资本。 2018年3月23日至产产资本。 2018年3月23日至产产资本。			21 日至今任
题指数型发 起式证券投 资基金 (LOF)的基 金经理。 2016年7月 28日至今任 中证上海国 企交易型开 放式指数证 券投资基金理。 2016年12 月22日富网医 好工题照指证 券投资基金 (LOF) 通过式证券 投资基金 (LOF) 的起式证券 投资基金 (LOF) 的基 金经理。 2017年8月 10日至百中型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018年3月 23日至今汗 300指数增 强型证券投资基金的基			汇添富中证
起式证券投资基金 (LOF)的基金经理。 2016年7月 28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2016年12月22日至全人任汇互高中证互影题指数型发发起式基金(LOF)的基金经理。 2017年8月10日至今任汇添富中证500指数证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添富者数增强型证券投资基金的基			精准医疗主
资基金 (LOF)的基金经理。 2016年7月 28日至今居中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2016年12月22日至今任汇添网医疗主题制指数型发起或式证券投资基金 (LOF)的基金经理。 2017年8月10日至中证互联制为证证券投资基金 (LOF)的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添富产资。 300指数增强型证券投资基金的基			题指数型发
(LOF) 的基金经理。 2016年7月 28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2016年12月22日富中证互案则指数型发送或证券投资基。 (LOF)的基金经理。 2017年8月 10日至今任汇添离中证500指数型发起式证券投资基金((LOF)的基金经理。 2017年8月 20日至今任汇添高沪深300指数增强型证券投资基金的基			起式证券投
金经理。 2016年7月 28日至今任 中证上海国 金交易型开 放式指数基金 约基金经理。 2016年12 月22日至今 任汇系联网居 疗主题型式证 券投资基金 (LOF)的基 金经理。 2017年8月 10日至今任 汇添富中证 500指数型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型运统转			资基金
2016年7月 28日至今任 中证上海国 企交易型开 放式指数基金 的基金经理。 2016年12 月22日富中 证互联题指式证 素投资基金 (LOF)的基金经验。 (LOF)的基金经理。 2017年8月 10日至今任 汇添路型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添高沪深 300指数增 强型、300指数增 强型、300指数增 强型、300指数增			(LOF)的基
28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2016年12月22日百富中证互联题指数型发发资基金(LOF)的基金经基金(LOF)的基金经理。 2017年8月10日至今任汇添新数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添为的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添购基金经过。			金经理。
中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添清中证500指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年3月23日至今任汇添高沪深300指数增强型证券投资基金的基			2016年7月
企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富者数型发起式基金(LOF)的基金经理。2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			28 日至今任
放式指数证券投资基金的基金经理。 2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式类投资基金(LOF)的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			中证上海国
券投资基金的基金经理。 2016年12 月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			企交易型开
的基金经理。 2016年12 月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			放式指数证
2016年12 月22日至今 任汇添富中 证互联网医 疗主题指数 型发起式证 券投资基金 (LOF)的基 金经理。 2017年8月 10日至今任 汇添富中证 500指数型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投资基金的基			券投资基金
月 22 日至今 任汇添富中 证互联网医 疗主题指数 型发起式证 券投资基金 (LOF)的基 金经理。 2017 年 8 月 10 日至今任 汇添富中证 500 指数型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018 年 3 月 23 日至今任 汇添富沪深 300 指数增 强型证券投资基金的基			的基金经理。
任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			2016年12
证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			月 22 日至今
疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			任汇添富中
型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2017年8月 10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。 2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基			证互联网医
券投资基金 (LOF)的基金经理。 2017年8月 10日至今任 汇添富中证 500指数型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投 资基金的基			疗主题指数
(LOF) 的基金经理。 2017年8月 10日至今任 汇添富中证 500指数型 发起式证券 投资基金 (LOF) 的基金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投 资基金的基			型发起式证
金经理。 2017 年 8 月 10 日至今任 汇添富中证 500 指数型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018 年 3 月 23 日至今任 汇添富沪深 300 指数增 强型证券投 资基金的基			券投资基金
2017 年 8 月 10 日至今任 汇添富中证 500 指数型 发起式证券 投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018 年 3 月 23 日至今任 汇添富沪深 300 指数增 强型证券投 资基金的基			(LOF) 的基
10 日至今任 汇添富中证 500 指数型 发起式证券 投资基金 (LOF) 的基 金经理。 2018 年 3 月 23 日至今任 汇添富沪深 300 指数增 强型证券投 资基金的基			金经理。
汇添富中证 500 指数型 发起式证券 投资基金 (LOF) 的基 金经理。 2018 年 3 月 23 日至今任 汇添富沪深 300 指数增 强型证券投 资基金的基			2017年8月
500 指数型 发起式证券 投资基金 (LOF) 的基 金经理。 2018 年 3 月 23 日至今任 汇添富沪深 300 指数增 强型证券投 资基金的基			10 日至今任
发起式证券 投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投 资基金的基			汇添富中证
投资基金 (LOF)的基 金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投 资基金的基			500 指数型
(LOF)的基 金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投 资基金的基			发起式证券
金经理。 2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投 资基金的基			投资基金
2018年3月 23日至今任 汇添富沪深 300指数增 强型证券投 资基金的基			(LOF) 的基
23 日至今任 汇添富沪深 300 指数增 强型证券投 资基金的基			金经理。
に添富沪深300 指数増強型证券投资基金的基			2018年3月
300 指数增 强型证券投 资基金的基			23 日至今任
强型证券投 资基金的基			汇添富沪深
资基金的基			300 指数增
			强型证券投
金经理。			资基金的基
			金经理。

		2019年7月
		26 日至 2022
		年6月13日
		任中证长三
		角一体化发
		展主题交易
		型开放式指
		数证券投资
		基金的基金
		经理。2019
		年9月24日
		至 2022 年 6
		月 13 日任中
		证长三角一
		体化发展主
		题交易型开
		放式指数证
		券投资基金
		联接基金的
		基金经理。
		2019年11
		月6日至
		2022年6月
		13 日任汇添
		富中证国企
		一带一路交
		易型开放式
		指数证券投
		资基金的基
		金经理。
		2020年3月
		5 日至 2022
		年6月13日
		任汇添富中
		证国企一带
		一路交易型
		开放式指数
		证券投资基
		金联接基金
		的基金经理。
		2021年10
		月 29 日至今
		任汇添富
		MSCI 中国
		A50 互联互
		通交易型开

				ナケートキャネト・エ
				放式指数证
				券投资基金
				的基金经理。
				2022年1月
				11 日至今任
				汇添富 MSCI
				中国 A50 互
				联互通交易
				型开放式指
				数证券投资
				基金联接基
				金的基金经
				理。2022年
				1月27日至
				今任汇添富
				中证智能汽
				车主题交易
				型开放式指
				数证券投资
				基金的基金
				经理。2022
				年4月28日
				至今任汇添
				富中证沪港
				深张江自主
				创新 50 交易
				型开放式指
				数证券投资
				基金的基金
				经理。
				<u>年</u> 国籍:中国。
				四相: 下回。 学历: 上海
				子끼: 上海 财经大学经
				济学硕士。
				从业资格:
				证券投资基
	 	0015 57 11		金从业资格。
许一尊	本基金的基	2015年11	12	从业经历:
	金经理	月 24 日		2010年7月
				加入汇添富
				基金管理股
				份有限公司,
				现任指数与
				量化投资部
				基金经理。
				2015年11

		月 24 日至今
		任汇添富成
		长多因子量
		化策略股票
		型证券投资
		基金的基金
		全型的全型 经理。2018
		年 3 月 23 日
		至今任汇添
		富沪深 300
		指数增强型
		证券投资基
		金的基金经
		理。2021年
		12月2日至
		今任汇添富
		中证芯片产
		业指数增强
		型发起式证
		券投资基金
		分以页 至 亚 的基金经理。
		2022年3月
		8 日至今任
		に
		细分化工产
		业主题指数
		业土 型 指 致 增强型 发起
		式证券投资
		基金的基金
		全宝的全宝 经理。
		红理。

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遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期內遵守《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 8 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

回顾 2022 年四季度,10 月份,外需转弱、出口数据下滑、人民币汇率承压,市场风险偏好降低,权益资产整体下跌;之后,继地产信贷政策转暖后,地产债权与股权融资相继转暖,地产相关风险得到缓解,地产竣工端受到投资者关注;与此同时,防疫二十条与

新十条相继落地,防疫政策优化,出行链与场景消费热度攀升,投资者预期大幅好转,11 月、12月权益市场震荡上涨。

四季度,国内经济仍面临"需求收缩、供给冲击、预期转弱"的三重压力,结构上,消费和地产投资仍是国内经济的主要拖累项,但随着防疫政策的优化和一系列稳增长措施的出台,市场风险偏好有所修复,消费复苏与地产困境反转成为投资者关注重点。流动性角度,国内货币政策整体趋于宽松,但海外紧缩态势延续,美债冲高,外资整体流出。估值角度,10 月末 A 股估值分位点、股权风险溢价、破净率等指标再次进入历史底部区域,当前估值有所修复,但权益资产的估值性价比仍处于历史较高水平。

四季度风格和行业波动较大。10月,二十大强调统筹安全与发展,战略安全受市场关注,信创、国防军工等行业主题涨幅明显,小盘成长风格有相对收益;11月,随着地产链的预期修复,金融地产以及地产竣工端相关行业整体上涨,价值风格整体表现较好;12月,疫后复苏的预期带动大消费板块整体上涨,大盘风格整体表现出色。量化选股因子方面,四季度市场波动较大,投资者信心修复,更关注未来而非当下的基本面,受这些因素的影响,短期交易类因子,低估值、低波动、低流动性等逆向类因子,行业动量因子,机构共识类因子表现较好;与此同时,基本面类因子整体表现不佳。

报告期内,本基金遵循量化基金投资原则,相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置,本季度相对业绩比较基准有一定超额收益,未来将继续保持对量化选股模型的迭代更新,同时提高对市场风格变化的应对能力,提升超额收益的稳定性。本产品对标的中证 500 指数是 A 股市场的代表性宽基指数,具有鲜明的中盘平衡风格,当前估值仍处于较低水平。展望未来,长期看"市值下沉"的趋势仍可能持续,量化模型仍有可能在中小盘风格的基础上获得相对稳健的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期添富成长多因子股票 A 类份额净值增长率为 3.14%,同期业绩比较基准收益率为 2.40%。本报告期新增添富成长多因子股票 C 类份额,自实际有资产之日起至报告期末基金份额净值增长率为 1.55%。同期业绩比较基准收益率为 0.56%。

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	746, 426, 139. 64	93. 39
	其中: 股票	746, 426, 139. 64	93. 39
2	基金投资	_	-
3	固定收益投资	1, 020, 209. 59	0. 13
	其中:债券	1, 020, 209. 59	0. 13
	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	49, 056, 739. 32	6. 14
8	其他资产	2, 777, 283. 18	0. 35
9	合计	799, 280, 371. 73	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	11, 832, 953. 24	1. 49
В	采矿业	21, 727, 171. 96	2. 74
С	制造业	450, 415, 372. 61	56. 76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20, 297, 040. 63	2. 56
Е	建筑业	5, 698, 978. 00	0.72
F	批发和零售业	47, 639, 392. 72	6. 00
G	交通运输、仓储和邮政业	38, 027, 709. 80	4. 79
Н	住宿和餐饮业	_	_

I	信息传输、软件和信息技术服务业	29, 148, 288. 36	3. 67
J	金融业	75, 908, 596. 01	9. 57
K	房地产业	7, 093, 803. 20	0.89
L	租赁和商务服务业	7, 039, 996. 00	0.89
M	科学研究和技术服务业	9, 505, 014. 71	1. 20
N	水利、环境和公共设施管理业	2, 375, 021. 70	0.30
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	2, 350, 808. 00	0.30
Q	卫生和社会工作	149, 676. 20	0.02
R	文化、体育和娱乐业	16, 109, 676. 50	2. 03
S	综合	1, 106, 640. 00	0. 14
	合计	746, 426, 139. 64	94. 07

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	603939	益丰药房	138, 600	8, 848, 224. 0	1. 12
2	002497	雅化集团	366, 600	8, 523, 450. 0 0	1. 07
3	300073	当升科技	149, 900	8, 454, 360. 0 0	1. 07
4	603605	珀莱雅	50, 400	8, 440, 992. 0 0	1.06

5	688122	西部超导	87, 749	8, 308, 952. 8	1.05
6	601058	赛轮轮胎	805, 213	8, 068, 234. 2 6	1. 02
7	300357	我武生物	142, 100	7, 829, 710. 0	0. 99
8	600563	法拉电子	46, 700	7, 466, 396. 0 0	0. 94
9	600160	巨化股份	473, 300	7, 340, 883. 0 0	0. 93
10	002507	涪陵榨菜	267, 300	6, 888, 321. 0 0	0.87

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	1, 020, 209. 59	0. 13
2	央行票据	_	-
3	金融债券	_	-
	其中: 政策性金融债	_	-
4	企业债券	_	-
5	企业短期融资券	_	-
6	中期票据	_	-
7	可转债 (可交换债)	_	-
8	同业存单	_	-
9	地方政府债	_	-
10	其他	_	-
11	合计	1, 020, 209. 59	0. 13

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	019666	22 国债 01	10,000	1, 020, 209. 5 9	0. 13

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,重庆市涪陵榨菜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	208, 698. 55
2	应收证券清算款	2, 330, 081. 11

3	应收股利	_
4	应收利息	-
5	应收申购款	238, 503. 52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	_
8	其他	-
9	合计	2, 777, 283. 18

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	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票C
本报告期期初基金份额总额	489, 486, 943. 83	_
本报告期基金总申购份额	23, 978, 912. 60	76, 023. 88
减:本报告期基金总赎回份额	49, 175, 090. 80	12, 958. 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	464, 290, 765. 63	63, 064. 96

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成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富成长多因子量化策略股票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、报告期内汇添富成长多因子量化策略股票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01月20日