

# 汇添富鑫添利 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	汇添富鑫添利 6 个月持有混合（FOF）
基金主代码	015241
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 06 月 01 日
报告期末基金份额总额(份)	70,901,284.63
投资目标	本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要投资策略包括：资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中债新综合（财富）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+中证港股通综合指数收益率*2%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金中基金。 本基金可以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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富鑫添利 6 个月持有混合 (FOF) A	汇添富鑫添利 6 个月持有混合 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	015241	015242
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	66,828,346.43	4,072,938.20

### § 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(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 03 月 31 日)	
	汇添富鑫添利 6 个月持有混合 (FOF) A	汇添富鑫添利 6 个月持有混合 (FOF) C
1. 本期已实现收益	91,576.59	6,297.11
2. 本期利润	649,759.93	43,024.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0083	0.0072
4. 期末基金资产净值	67,815,194.98	4,122,659.52
5. 期末基金份额净值	1.0148	1.0122

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

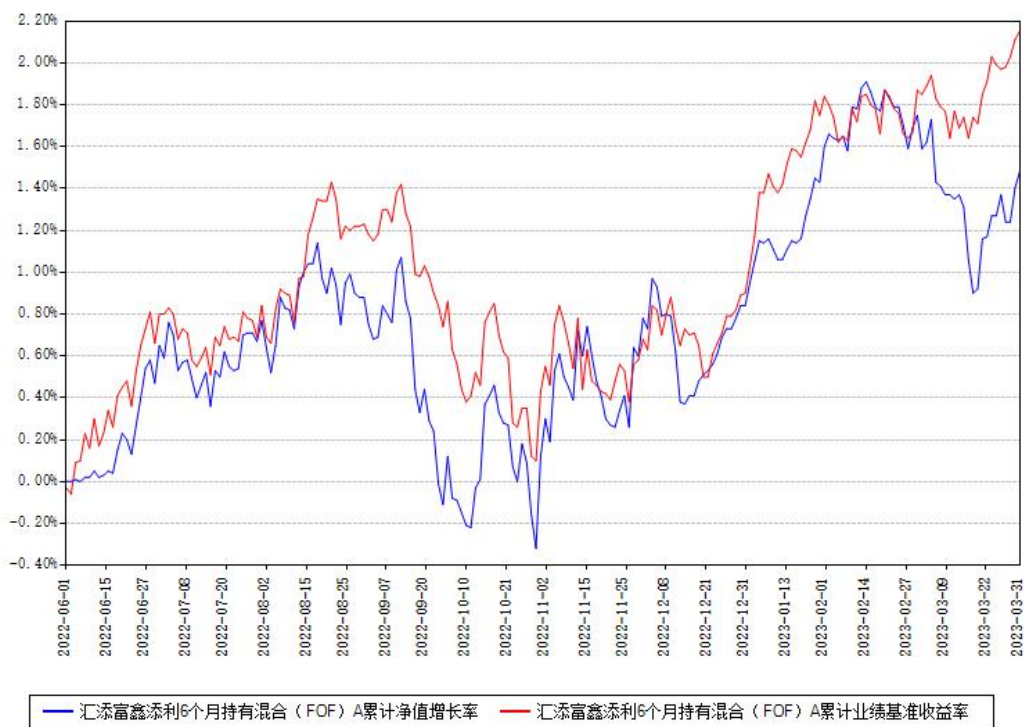
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富鑫添利 6 个月持有混合 (FOF) 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	0.63%	0.10%	1.24%	0.09%	-0.61%	0.01%

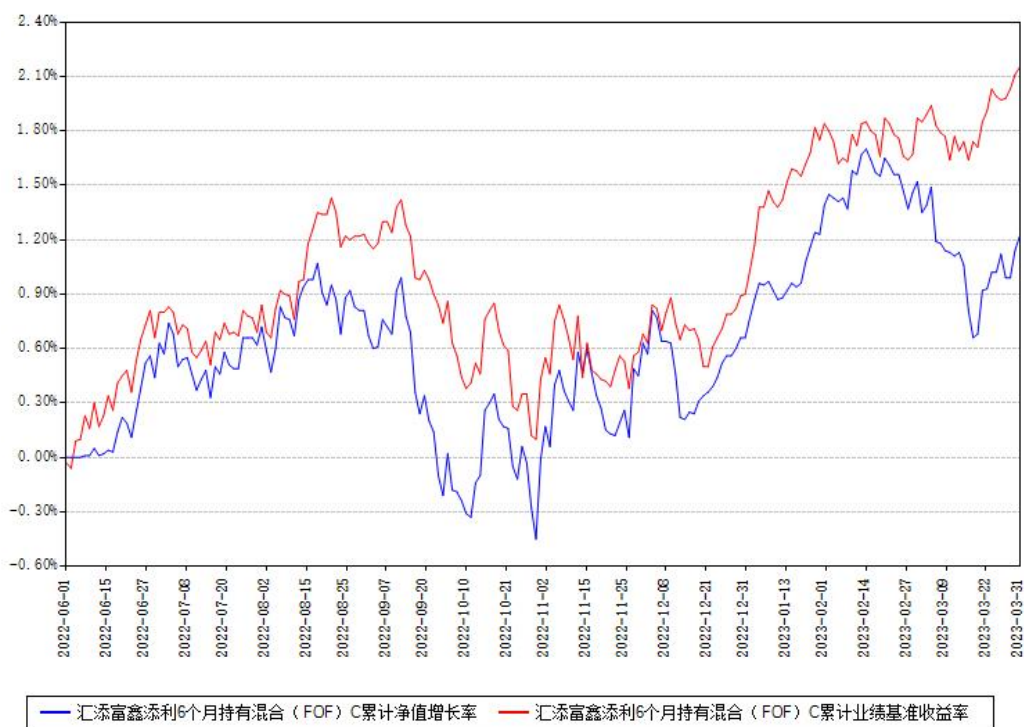
过去六个月	1.63%	0.13%	1.71%	0.11%	-0.08%	0.02%
自基金合同生效日起至今	1.48%	0.12%	2.15%	0.11%	-0.67%	0.01%
汇添富鑫添利6个月持有混合（FOF）C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	0.10%	1.24%	0.09%	-0.68%	0.01%
过去六个月	1.46%	0.13%	1.71%	0.11%	-0.25%	0.02%
自基金合同生效日起至今	1.22%	0.12%	2.15%	0.11%	-0.93%	0.01%

### 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

汇添富鑫添利6个月持有混合（FOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富鑫添利6个月持有混合（FOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2022年06月01日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，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		
蔡健林	本基金的基金经理	2022年06月01日		13	国籍：中国。 学历：上海交通大学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任太平洋资产管理有限责任公司高级

				<p>投资经理。</p> <p>2017年8月加入汇添富基金管理股份有限公司。</p> <p>2018年12月27日至今任汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。</p> <p>2019年4月29日至2022年7月7日任汇添富养老目标日期2040五年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2019年5月17日至2022年7月7日任汇添富养老目标日期2050五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。</p> <p>2021年8月20日至今任汇添富添福睿选稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。</p> <p>2021年9月13日至今任汇添富添福</p>
--	--	--	--	---

					<p>盈和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 15 日至今任汇添富添福汇盈稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。</p> <p>2021 年 11 月 9 日至今任汇添富添福增长稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)的基金经理。</p> <p>2022 年 5 月 18 日至今任汇添富添福睿享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。</p> <p>2022 年 6 月 1 日至今任汇添富鑫添利 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

回顾一季度，债券市场表现突出，信用表现优于利率，城投债利差持续压缩。资金成本较低，杠杆策略比较有效。我们维持债券市场上半年机会更大的判断。目前经济弱复苏，流动性宽松的宏观状态，债券票息行情仍然比较确定。预计债券市场转向要等到经济恢复比较强，或者有很强的财政政策预期的时候，我们对此保持重点跟踪和关注。

权益市场整体上表现还可以，但是结构性差异特别大。市值风格上，中小市值风格表现更加突出。行业主题投资机会也比较多，消费恢复比较确定、国央企考核更加注重经营质量和分红意愿提升下的估值重估、半导体国产化替代加速、AI 创新产品推出带动相关硬件需求和各种后端应用的产生、欧美加息周期结束和经济衰退预期下的贵金属避险价值。操作上，年初港股快速上涨过程中减持港股基金，逐渐止盈中小市值风格基金，增持处于周期底部的养殖板块。创业板指数基金下跌过程中做了重点增持，该指数受到新能源和创新药板块影响调整比较多，其核心成分股的电池龙头公司估值调整比较充分，国内电池业务保持稳定，美国电池业务拓展和储能业务高速增长具有很强的增长动力。

本基金设定最短 6 个月持有期，投资策略上偏保守，力求做成一个低回撤的基金产品。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富鑫添利 6 个月持有混合（FOF）A 类份额净值增长率为 0.63%，同期业绩比较基准收益率为 1.24%。本报告期汇添富鑫添利 6 个月持有混合（FOF）C 类份额净值增长率为 0.56%，同期业绩比较基准收益率为 1.24%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	66,040,436.93	91.33
3	固定收益投资	3,054,454.52	4.22
	其中：债券	3,054,454.52	4.22
	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	2,857,172.15	3.95
8	其他资产	361,297.89	0.50
9	合计	72,313,361.49	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

注：本基金报告期末未投资境内股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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	3,054,454.52	4.25
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	3,054,454.52	4.25

### 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	019638	20 国债 09	30,000	3,054,454.52	4.25

### 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	60,779.89
2	应收证券清算款	300,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	518.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	361,297.89

### 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:本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联
----	------	------	------	---------	---------	--------------	-----------------

							方所管 理的基 金
1	519137	海富通 瑞福债 券 A	契约型 开放式	7,500,0 00.00	8,146,5 00.00	11.32	否
2	004920	富国泓 利纯债 债券型 发起式 A	契约型 开放式	7,681,8 97.56	8,042,9 46.75	11.18	否
3	007616	富国投 资级信 用债债 券 A	契约型 开放式	7,663,2 20.89	7,880,8 56.36	10.96	否
4	270048	广发纯 债债券 A	契约型 开放式	6,052,3 69.19	7,394,1 79.44	10.28	否
5	009343	泰康长 江经济 带债券 A	契约型 开放式	6,152,4 47.30	6,323,4 85.33	8.79	否
6	040026	华安信 用四季 红债券 A	契约型 开放式	5,000,0 00.00	5,217,0 00.00	7.25	否
7	000406	汇添富 双利增 强债券 A	契约型 开放式	4,009,6 00.62	4,226,1 19.05	5.87	是
8	004089	汇添富 鑫瑞债 券 A	契约型 开放式	3,500,0 00.00	3,780,7 00.00	5.26	是
9	159915	易方达	交易型	1,580,0	3,676,6	5.11	否

		创业板 ETF	开放式	00.00	60.00		
10	159949	华安创 业板 50ETF	交易型 开放式	3,560,0 00.00	3,631,2 00.00	5.05	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 03 月 31 日	其中：交易及持有基金管理 人以及管理人关联方所管理 基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费 (元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	13,351.91	-
当期持有基金产生的应支付销 售服务费 (元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管 理费 (元)	73,543.07	14,682.90
当期持有基金产生的应支付托 管费 (元)	19,685.43	3,704.20
当期交易基金产生的交易费 (元)	1,900.36	-
当期交易基金产生的转换费 (元)	-	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

注：本基金本报告期持有的基金无重大影响事件。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富鑫添利 6 个月持有混 合 (FOF) A	汇添富鑫添利 6 个月持有混 合 (FOF) C
本报告期初基金份额总额	101,464,633.97	8,604,517.96
本报告期基金总申购份额	651,332.36	5,656.50

减：本报告期基金总赎回份额	35,287,619.90	4,537,236.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	66,828,346.43	4,072,938.20

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。

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 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未运用固有资金投资本基金。

### 8.2 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未运用固有资金投资本基金。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	31,999,990.00	-	-	31,999,990.00	45.13

#### 产品特有风险

##### 1、持有人大会投票权集中的风险

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长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富鑫添利 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件；
- 2、《汇添富鑫添利 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《汇添富鑫添利 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富鑫添利 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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。

### 10.2 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

### 10.3 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