

汇添富稳健收益混合型证券投资基金 2024 年 第 3 季度报告

2024 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 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)	1,466,913,420.14
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 B	汇添富稳健收益混合 C
下属分级基金的交易代码	009736	020623	009737
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	855,646,721.75	2,087.42	611,264,610.97

§ 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07月01日 - 2024年09月30日)		
	汇添富稳健收益混合 A	汇添富稳健收益混合 B	汇添富稳健收益混合 C
1. 本期已实现收益	3,587,651.95	-156.33	1,935,001.99
2. 本期利润	2,675,970.80	-271.40	1,196,076.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0030	-0.0068	0.0019
4. 期末基金资产净值	814,478,352.03	1,985.10	572,149,839.89
5. 期末基金份额净值	0.9519	0.9510	0.9360

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	0.34%	0.13%	3.45%	0.25%	-3.11%	-0.12%
过去六个月	2.40%	0.21%	4.43%	0.21%	-2.03%	0.00%
过去一年	6.64%	0.22%	5.25%	0.20%	1.39%	0.02%
过去三年	-3.09%	0.43%	2.38%	0.22%	-5.47%	0.21%
自基金合同生效起至今	-4.81%	0.42%	3.70%	0.22%	-8.51%	0.20%
汇添富稳健收益混合 B						
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	0.24%	0.13%	3.45%	0.25%	-3.21%	-0.12%
过去六个月	2.30%	0.21%	4.43%	0.21%	-2.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.30%	0.23%	6.38%	0.20%	-2.08%	0.03%
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	0.24%	0.13%	3.45%	0.25%	-3.21%	-0.12%
过去六个月	2.18%	0.21%	4.43%	0.21%	-2.25%	0.00%
过去一年	6.22%	0.22%	5.25%	0.20%	0.97%	0.02%
过去三年	-4.26%	0.43%	2.38%	0.22%	-6.64%	0.21%
自基金合同生效起至今	-6.40%	0.42%	3.70%	0.22%	-10.10%	0.20%

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比较基准收益率对比图



汇添富稳健收益混合B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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2024 年 1 月 29 日新增 B 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		
徐一恒	本基金的基金经理, 固收研究部副总经理	2020 年 08 月 05 日	-	14	<p>国籍：中国。学历：武汉大学金融工程硕士。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，现任固收研究部副总经理。</p> <p>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</p>

					<p>券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 6 月 4 日至 2023 年 5 月 12 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。2020 年 6 月 4 日至 2022 年 10 月 10 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。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 6 月 4 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。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。</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>2021 年 2 月 9 日至 2023 年 11 月 6 日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。2022 年 6 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日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>
邵佳民	本基金的基金经理, 首席固收投资官	2023 年 07 月 14 日	-	27	<p>国籍：中国。学历：上海财经大学国际金融专业硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：1997 年起先后任职于海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司、中国人寿养老保险股份有限公司、平安资产管理有限责任公司、</p>

					<p>博时基金管理有限公司。2022 年 08 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任首席固收投资官。2023 年 7 月 14 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。2024 年 1 月 17 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。</p>
李安	本基金的基金经理	2023 年 11 月 02 日	-	12	<p>国籍：中国。学历：浙江大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 10 月至 2023 年 4 月任中银基金股份有限公司专户投资部投资经理助理、投资经理。2013 年 8 月至 2016 年 10 月任上海银行金融市场部、资产管理部交易员、投资经理。2023</p>

					年 4 月 6 日加入汇添富基金管理股份有限公司多元资产部。2023 年 11 月 2 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。
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况说明

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 and 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 1 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

三季度货币市场整体流动性宽裕，银行间七天质押式回购加权平均利率以 1.85% 为中枢小幅震荡，波动幅度较窄，维持合理且稳定的货币市场环境。各类属债券资产走势趋同，但幅度发生分化，利率债品种相对于信用债资产更为强势，信用利差整体走阔。

我们以胜率-赔率的视角对债券资产进行剖析，并据此确立组合中长期债券资产配置结构。

债券资产的胜率分析以侧重于宏观基本面，货币-财政政策部分内生于宏观经济状况。从长期视角，债券利率中枢的关键影响因素是全社会资本回报率。经济结构转型的过程中，制造业与消费在经济中的占比逐年攀升。从国别比较与历史比较的研究来看，这将逐步降低利率中枢，并减少债券资产的波动性。这一长期趋势在过去两年已经显现，并且预计将持续下去。从中短期视角，经济复苏初期，较低的实际利率环境虽不能迅速促进经济增长，但过高的实际利率水平却可能阻碍经济复苏。因此，有必要在较长一段时间保持较低的实际利率水平。目前，债券资产的胜率水平维持在偏高水平。

债券资产的赔率分析聚焦于收益率曲线结构。根据央行政策利率管理框架，以 7 天逆回购利率作为分析的起点，通过期限利差与信用利差结构分析构建收益率曲线族的公允价值区间。一个倾斜向上的收益率曲线和适度的期限利差水平，有利于营造健康的金融市场环境，并有效支持实体经济的融资需求。当前 10 年期及以下的国债收益率曲线结构相对合理，曲线结构上的赔率定价充分。利率债资产的赔率水平处于相对中性合理水平。信用债收益率曲线上，信用利差经过了 8、9 月份的修复后，中短期信用债的信用利差已经处于合意水平，其资产的赔率较高，具备较高的投资价值。

综合胜率-赔率分析，债券资产整体投资价值仍处高位，部分收益率曲线上的“凸点”资产具有更强的 alpha 价值。因此组合从中长期维度，需要以积极的久期暴露，相对偏低的信用暴露，获取稳健回报。

报告期内，本基金债券部分定位于提供组合稳健的底仓收益来源，通过相对积极的暴露久期风险，与权益资产形成股债对冲，提升组合整体的夏普比率。报告期内，本组合债券资产从策略角度，坚持“信用+”的绝对收益投资策略，以高等级信用债为组合的核心资产，以骑乘交易等多种收益率曲线策略作为收益增厚。本组合债券资产从风险暴露分解的角度，维持相对较高的久期中枢水平，中性的杠杆水平，较低的信用风险暴露。在信用债底仓资产久期变动的基础上，组合挖掘利率债与高等级信用债市场的结构性机会作为收益增厚的来源。

2024 年三季度 A 股先跌后涨，节奏上 7 月走势震荡，8 月持续下跌，9 月先跌后涨，临近月底强反弹强势。整体来看，三季度沪指上涨 12.44%，沪深 300 上涨 16.07%，中证 500 上涨 16.19%，创业板指上涨 29.21%。风格方面，受 9 月底普涨行情的影响，大中小盘表现差异不大。行业层面，所有申万一级行业均收涨，其中非银金融、地产、商贸零售、社服和计算机涨幅居前；煤炭、石油石化、公用事业、农林牧渔和银行涨幅相对靠后。

回顾 2024 年三季度，7 月上市公司中报业绩密集披露，三中全会顺利召开，但指数由于流动性原因，赚钱效应较弱。8 月资金风险偏好较低，随着中报业绩披露截止日临近，资金态度谨慎，整体震荡下行后低位筑底。期间高股息板块如银行、石油石化、公共事业等表现较好。9 月下半月金融监管总局、央行、证监会联合出台一系列宽松政策，推出两个新型货币政策工具，力度空前，周四政治局会议加开，提出房地产和财政增量政策加码，市场和监管明确转向，在一系列政策强力提振下，市场连续大涨。

展望 2024 年四季度，看待市场可以更加积极，重点把握 10 月窗口期。首先，宏观政策明确转向稳增长，市场风险偏好得到明显提振；其次，市场政策整体超预期，新型货币政策

工具有望成为长线资金的底仓。此外，金融地位提升、融资条件放宽将吸引增量资金入市，充裕的微观流动性有望支持行情的继续发展。但由于政策到经济之间的传导存在时滞，市场上涨的节奏可能是先拔估值再验证基本面的过程。红利资产在拔估值阶段虽然弹性相对有限，但由于其中较多行业具备顺周期属性，因此在后续基本面验证阶段有望充分受益。继续关注煤炭、铜、金、油等上游资源类行业；同时，随着海外新一轮降息周期开启，预计海外经济衰退的预期可能会逐渐缓解，对出口链保持关注；此外，市场交易基本面预期的好转，核心资产等大盘成长方向也将受益。

报告期内本基金权益部分三季度先是适当降低了仓位，在前两个月的下跌中较好的控制了回撤。政策转向后，组合适当加仓，通过增配可转债，前期超跌类个股，以及部分核心资产来增强组合弹性，并进一步优化了持仓结构。尽管政策拐点已现，但底部的构筑也并非一蹴而就，受益于能源安全的上游资源品等低估值品种仍然是组合重要的底仓型品种。高度重视现金流和利润比较匹配的公司和资产，对于红利风格，虽然短期弹性有限，但优质高股息仍能带来稳定收益，央行股票互换政策也为红利资产提供了支撑。后续也会根据最新的宏观经济形势，结合市场风格变化进行灵活调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富稳健收益混合 A 类份额净值增长率为 0.34%，同期业绩比较基准收益率为 3.45%。本报告期汇添富稳健收益混合 B 类份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准收益率为 3.45%。本报告期汇添富稳健收益混合 C 类份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准收益率为 3.45%。

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	188,601,518.09	9.87
	其中：股票	188,601,518.09	9.87
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,632,884,835.67	85.44

	其中：债券	1,632,884,835.67	85.44
	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	9,967,183.29	0.52
	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	37,291,543.06	1.95
8	其他资产	42,489,343.72	2.22
9	合计	1,911,234,423.83	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 70,143,841.40 元，占期末净值比例为 5.06%。

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	48,393,029.50	3.49
C	制造业	14,078,767.25	1.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,220,000.00	2.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,757,000.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	15,081,000.00	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,338.26	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,541.68	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	5,856,000.00	0.42
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	118,457,676.69	8.54

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	11,400,429.18	0.82
15 原材料	14,911,999.44	1.08
20 工业	4,152,742.95	0.30
25 可选消费	4,134,166.08	0.30
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	28,350,924.92	2.04
55 公用事业	7,193,578.83	0.52
60 房地产	-	-
合计	70,143,841.40	5.06

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	600674	川投能源	900,000	16,965,000.00	1.22
2	01024	快手-W	330,000	16,322,849.90	1.18
3	002155	湖南黄金	900,994	15,992,643.50	1.15
4	600886	国投电力	900,000	15,255,000.00	1.10
5	01818	招金矿业	1,200,000	14,911,999.44	1.08
6	00700	腾讯控股	30,000	12,028,075.02	0.87
7	600547	山东黄金	375,000	10,983,750.00	0.79
8	601018	宁波港	2,700,000	10,368,000.00	0.75
9	000975	山金国际	534,800	9,952,628.00	0.72
10	01898	中煤能源	900,000	7,872,626.70	0.57

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	376,111,947.95	27.12
2	央行票据	-	-

3	金融债券	311,666,643.98	22.48
	其中：政策性金融债	81,640,065.57	5.89
4	企业债券	712,848,528.49	51.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	162,265,443.96	11.70
7	可转债（可交换债）	49,949,178.90	3.60
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	20,043,092.39	1.45
10	其他	-	-
11	合计	1,632,884,835.67	117.76

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	019735	24 国债 04	2,200,000	223,582,082.20	16.12
2	019753	24 国债 17	1,300,000	129,602,057.53	9.35
3	138614	葛洲 YK03	1,000,000	103,169,747.95	7.44
4	240821	24 穗投 02	800,000	81,754,520.54	5.90
5	240617	24 沪国 投	800,000	80,803,178.08	5.83

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，中国农业发展银行、中国银河证券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	746,428.57
2	应收证券清算款	41,657,155.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	85,760.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	42,489,343.72
---	----	---------------

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	110062	烽火转债	13,567,847.67	0.98
2	113043	财通转债	7,036,594.52	0.51
3	113682	益丰转债	6,632,324.38	0.48
4	113024	核建转债	6,457,290.41	0.47
5	113605	大参转债	6,378,657.53	0.46
6	127064	杭氧转债	3,599,926.03	0.26
7	127026	超声转债	3,264,793.15	0.24
8	110087	天业转债	3,011,745.21	0.22

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 B	汇添富稳健收益混合 C
本报告期期初基金份额总额	912,702,879.16	75,095.43	655,598,179.49
本报告期基金总申购份额	1,209,427.65	431.27	6,027,478.46
减：本报告期基金总赎回份额	58,265,585.06	73,439.28	50,361,046.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-

本报告期期末基金份额总额	855,646,721.75	2,087.42	611,264,610.97
--------------	----------------	----------	----------------

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

2024 年 10 月 25 日