

# 汇添富创新活力混合型证券投资基金(原汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金) 2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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。

汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金于 2022 年 07 月 13 日变更注册为汇添富创新活力混合型证券投资基金。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金主代码亦保持不变。转型后基金的运作方式、投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《汇添富创新活力混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。其中，2022 年 07 月 13 日起，“汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金”转型为“汇添富创新活力混合型证券投资基金”。汇添富创新活力混合型证券投资基金合同及托管协议即日生效。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	汇添富创新活力混合
基金主代码	002419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 13 日

报告期末基金份额总额(份)	134,596,975.36		
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，以基本面分析为立足点精选优质上市公司股票，力争实现基金资产的中长期稳健增值。		
投资策略	本基金投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转债及可交换债投资策略、股指期货投资策略、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*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+中债综合指数收益率*20%		
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	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富创新活力混合 A	汇添富创新活力混合 C	汇添富创新活力混合 D
下属分级基金的交易代码	002419	014836	014837
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	122,042,161.97	10,958.14	12,543,855.25

## 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	汇添富盈安灵活配置混合
基金主代码	002419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 04 月 27 日
报告期末基金份额总额(份)	172,239,944.32
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、存托凭证投资策略。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%		
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	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富盈安灵活配置混合 A	汇添富盈安灵活配置混合 C	汇添富盈安灵活配置混合 D
下属分级基金的交易代码	002419	014836	014837
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	159,010,346.30	4,584.27	13,225,013.75

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年07月13日 - 2022年09月30日)		
	汇添富创新活力混合 A	汇添富创新活力混合 C	汇添富创新活力混合 D
1. 本期已实现收益	-9,046,066.27	-1,147.96	-764,761.82
2. 本期利润	-24,855,637.20	-2,802.60	-3,609,605.43
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1658	-0.4148	-0.2503
4. 期末基金资产净值	223,508,462.32	19,951.38	22,943,492.27
5. 期末基金份额净值	1.8314	1.8207	1.8291

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、本基金的《基金合同》生效日为 2022 年 07 月 13 日,至本报告期末不满一季度,因此主要财务指标只列示从基金合同生效日至 2022 年 09 月 30 日数据,特此说明。

### 3.1 主要财务指标 (转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2022 年 07 月 01 日 - 2022 年 07 月 12 日)		
	汇添富盈安灵活配置混合 A	汇添富盈安灵活配置混合 C	汇添富盈安灵活配置混合 D
1. 本期已实现收益	-988,272.48	5.97	-82,313.38
2. 本期利润	-15,072,870.14	-417.55	-1,251,951.56
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0943	-0.1024	-0.0947
4. 期末基金资产净值	320,921,008.97	9,213.73	26,668,662.59
5. 期末基金份额净值	2.018	2.010	2.017

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 (转型后)

#### 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

汇添富创新活力混合 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
自基金	-9.25%	1.71%	-9.58%	0.74%	0.33%	0.97%

合同生效日起至今						
汇添富创新活力混合 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
自基金合同生效日起至今	-9.42%	1.71%	-9.58%	0.74%	0.16%	0.97%
汇添富创新活力混合 D						
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
自基金合同生效日起至今	-9.32%	1.71%	-9.58%	0.74%	0.26%	0.97%

### 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

汇添富创新活力混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富创新活力混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富创新活力混合D累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金由原汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金于 2022 年 07 月 13 日转型而来。本基金自转型之日起至本报告期末未满一年。

2、本基金建仓期为《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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

汇添富盈安灵活配置混合 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
自 2022-05-01 至 2022-07-12	17.94%	1.77%	3.80%	0.56%	14.14%	1.21%
自 2022-02-01 至 2022-07-12	-5.88%	1.94%	-2.60%	0.74%	-3.28%	1.20%
自 2021-	-18.07%	1.73%	-4.49%	0.61%	-13.58%	1.12%

08-01 至 2022- 07-12						
自 2019- 08-01 至 2022- 07-12	77.17%	1.54%	9.40%	0.63%	67.77%	0.91%
自 2019- 04-27 至 2022- 07-12	84.63%	1.48%	9.40%	0.64%	75.23%	0.84%
汇添富盈安灵活配置混合 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
自 2022- 05-01 至 2022- 07-12	17.82%	1.77%	3.80%	0.56%	14.02%	1.21%
自 2022- 02-01 至 2022- 07-12	-6.21%	1.93%	-2.60%	0.74%	-3.61%	1.19%
自 2022- 01-19 至 2022- 07-12	-12.19%	1.92%	-5.01%	0.73%	-7.18%	1.19%
汇添富盈安灵活配置混合 D						
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 2022- 05-01 至 2022- 07-12	17.95%	1.77%	3.80%	0.56%	14.15%	1.21%
自 2022- 02-01 至 2022- 07-12	-5.92%	1.94%	-2.60%	0.74%	-3.32%	1.20%
自 2022- 01-18 至 2022-	-12.11%	1.91%	-4.49%	0.73%	-7.62%	1.18%

07-12						
-------	--	--	--	--	--	--

### 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

汇添富盈安灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富盈安灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富盈安灵活配置混合D累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金由原汇添富盈安保本混合型证券投资基金于 2019 年 4 月 27 日转型而来。  
 2、本基金建仓期为《基金合同》生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3、本基金于 2022 年 1 月 17 日新增 C、D 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（转型后）

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		
沈若雨	本基金的 基金经理	2022 年 07 月 13 日		10	国籍：中国。学历：复旦大学微电子学学士，悉尼大学数量金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 11 月至 2013 年 9 月任申银万国证券研究所分析师，2013 年 10 月至 2015 年 3 月任富国基金分析师，2015 年 4 月至 2020 年 4 月任易方达基金研究部高级研究员。2020 年 5 月至今任汇添富基金管理股份有限公司研究部高级行业分析师。2020 年 6 月 18 日至今任汇添富全球移动

					<p>互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 6 月 18 日至今任汇添富移动互联网股票型证券投资基金的基金经理助理。2021 年 1 月 12 日至 2022 年 7 月 12 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。2021 年 9 月 15 日至今任汇添富互联网核心资产六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 2 月 21 日至今任汇添富自主核心科技一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富创新活力混合型证券投资基金的基金经理。</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《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。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
沈若雨	本基金的基金经理	2021 年 01 月 12 日	2022 年 07 月 12 日	10	国籍：中国。学历：复旦大学微电子学学士，悉尼大学数量金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 11 月至 2013 年 9 月任申银万国证券研究所分析师，2013 年 10 月至 2015 年 3 月任富国基金分析师，2015 年 4 月至 2020 年 4 月任易方达基金研究部高级研究员。2020 年 5 月至今任汇添富基金管理股份有限公司研究部高级行业分析师。2020 年 6 月 18 日至今任

					<p>汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 6 月 18 日至今任汇添富移动互联网股票型证券投资基金的基金经理助理。2021 年 1 月 12 日至 2022 年 7 月 12 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。2021 年 9 月 15 日至今任汇添富互联网核心资产六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 2 月 21 日至今任汇添富自主核心科技一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富创新活力混合型证券投资基金的基金经理。</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《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 15 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

2022 年三季度，A 股市场波动加大，沪深 300 指数下跌 15.2%，创业板指数下跌 18.6%。以煤炭、石油石化、交运为代表的低估值防守板块表现较好。总体来看，今年整体经济运行面临的宏观环境较为复杂，影响市场表现的变量较多。俄乌冲突长期化影响了市场对于全球经济增长前景的展望，通胀仍然是各国货币政策关注的焦点之一，与此同时供应链安全、自主可控成为各方关注的重点。

在报告期内，本基金延续了以科技股投资为主的策略，适当调整了股票仓位结构，行业分布上仍然坚持聚焦于低渗透率的新兴产业方向，包括半导体国产化、光伏储能、汽车智能化方向，这些行业目前处在发展的早期阶段，仍然有较大的发展空间，未来预计有潜力保持较高的增长速度。在行业投资占比上，组合增加了对于供应链安全、自主可控方向的投资比例。尽管在行业的发展过程中，节奏可能充满起伏，但我们认为底层的技术自主可控是未来科技行业能够可持续发展的基石，也是未来发展的核心方向之一。

从长期的角度，我们持续看好这些驱动经济增长，提高生产效率的科技主航道方向。在和这些公司日常的交流中，我们发现从企业家精神、组织战略、核心技术、人才供给等多个微观层面，在我国已经涌现了一批具备国际竞争力的企业。我们将持续、耐心的挖掘这类投资机会，争取为投资人创造更多收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2022 年 7 月 13 日变更注册为汇添富创新活力混合型证券投资基金。转型前，汇添富盈安灵活配置混合 A 类份额净值增长率为-4.50%，同期业绩比较基准收益率为-1.89%，汇添富盈安灵活配置混合 C 类份额净值增长率为-4.51%，同期业绩比较基准收益率为-1.89%，汇添富盈安灵活配置混合 D 类份额净值增长率为-4.45%，同期业绩比较基准收益率为-1.89%。

转型后，汇添富创新活力混合 A 类份额净值增长率为-9.25%，同期业绩比较基准收益率为-9.58%，汇添富创新活力混合 C 类份额净值增长率为-9.42%，同期业绩比较基准收益率为-9.58%，汇添富创新活力混合 D 类份额净值增长率为-9.32%，同期业绩比较基准收益率为-9.58%。

#### 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（转型后）

### 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	174,614,177.52	70.42
	其中：股票	174,614,177.52	70.42
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	65,030,802.77	26.23
8	其他资产	8,315,682.88	3.35
9	合计	247,960,663.17	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	11,896.60	0.00
B	采矿业	3,230,480.68	1.31
C	制造业	141,283,736.39	57.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,060.89	0.02
E	建筑业	46,378.66	0.02
F	批发和零售业	211,238.43	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	27,592.40	0.01

H	住宿和餐饮业	13,970.88	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,272,341.95	4.98
J	金融业	11,033,610.49	4.48
K	房地产业	5,473,620.00	2.22
L	租赁和商务服务业	18,238.46	0.01
M	科学研究和技术服务业	364,148.22	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	301,241.10	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	161,464.28	0.07
R	文化、体育和娱乐业	114,158.09	0.05
S	综合	-	-
	合计	174,614,177.52	70.85

### 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	002371	北方华创	55,839	15,545,577.60	6.31
2	300274	阳光电源	105,600	11,681,472.00	4.74
3	688037	芯源微电子	42,830	9,338,653.20	3.79

4	300604	长川科技	152,000	8,667,040.00	3.52
5	300496	中科创达	81,100	8,562,538.00	3.47
6	300750	宁德时代	21,200	8,498,868.00	3.45
7	002881	美格智能	203,500	6,959,700.00	2.82
8	688082	盛美上海半导体	62,696	6,527,907.52	2.65
9	002409	雅克科技	101,500	6,241,235.00	2.53
10	688630	芯碁微装	93,775	6,236,037.50	2.53

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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	214,814.27
2	应收证券清算款	8,092,243.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,625.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,315,682.88

### 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。

## § 5 投资组合报告(转型前)

## 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	294,918,951.58	84.31
	其中：股票	294,918,951.58	84.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	54,583,779.48	15.60
8	其他资产	285,877.61	0.08
9	合计	349,788,608.67	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	3,761,399.86	1.08
B	采矿业	3,472,675.00	1.00
C	制造业	237,894,874.79	68.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	50,198.16	0.01
F	批发和零售业	473,124.05	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	28,599.45	0.01
H	住宿和餐饮业	13,286.16	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,586,294.75	7.65
J	金融业	18,046,969.06	5.19
K	房地产业	3,219,264.00	0.93
L	租赁和商务服务业	19,119.36	0.01
M	科学研究和技术服务业	277,184.09	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	675,220.80	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	374,669.29	0.11
R	文化、体育和娱乐业	26,072.76	0.01
S	综合	-	-
	合计	294,918,951.58	84.84

### 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	300750	宁德时代	69,100	34,804,979.00	10.01
2	603799	华友钴业	251,480	22,303,761.20	6.42
3	002466	天齐锂业	156,200	19,962,360.00	5.74
4	300059	东方财富	776,704	17,972,930.56	5.17

		富			
5	601012	隆基绿 能	299,460	17,647,177.80	5.08
6	002463	沪电股 份	1,162,700	14,777,917.00	4.25
7	300627	华测导 航	359,000	12,116,250.00	3.49
8	603197	保隆科 技	208,300	10,498,320.00	3.02
9	002460	赣锋锂 业	96,740	9,720,435.20	2.80
10	300274	阳光电 源	80,700	9,353,130.00	2.69

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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，江西赣锋锂业集团股份有限公司出现在报告期内受监管机构立案调查的情况。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	251,360.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,516.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,877.61

#### 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（转型后）

单位：份

项目	汇添富创新活力混合 A	汇添富创新活力混合 C	汇添富创新活力混合 D

基金合同生效日（2022 年 07 月 13 日）基金份额总额	159,010,346.30	4,584.27	13,225,013.75
本报告期基金总申购份额	2,582,766.22	11,983.62	4,623,256.45
减：本报告期基金总赎回份额	39,550,950.55	5,609.75	5,304,414.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	122,042,161.97	10,958.14	12,543,855.25

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。

### § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	汇添富盈安灵活配置混合 A	汇添富盈安灵活配置混合 C	汇添富盈安灵活配置混合 D
本报告期期初基金份额总额	160,292,274.60	3,323.72	13,218,867.52
本报告期基金总申购份额	106,326.73	1,516.83	6,163.01
减：本报告期基金总赎回份额	1,388,255.03	256.28	16.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	159,010,346.30	4,584.27	13,225,013.75

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（转型后）

#### 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。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 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盈安保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富创新活力混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《汇添富创新活力混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富盈安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；
- 8、报告期内汇添富创新活力混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 9、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](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。

2022 年 10 月 26 日