

# 汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年第 1 季度报告

2021 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2021 年 04 月 22 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 20 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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          | 汇添富达欣混合  |
| 基金主代码         | 001801   |
| 基金运作方式        | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日       | 2015 年 12 月 02 日   |
| 报告期末基金份额总额(份) | 170,259,158.14   |
| 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          | 本基金的投资策略主要包括：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、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，其预期风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。                                |
| 基金管理人         | 汇添富基金管理股份有限公司  |

|                    |                |               |
|--------------------|----------------|---------------|
| 基金托管人              | 中国民生银行股份有限公司   |               |
| 下属分级基金的基金简称        | 汇添富达欣混合 A      | 汇添富达欣混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码        | 001801         | 002165        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 116,215,772.84 | 54,043,385.30 |

### § 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(2021年01月01日 – 2021年03月31日) |               |
|-----------------|--------------------------------|---------------|
|                 | 汇添富达欣混合 A                      | 汇添富达欣混合 C     |
| 1. 本期已实现收益      | 18,896,580.73                  | 7,017,613.22  |
| 2. 本期利润         | -24,365,427.77                 | -2,580,193.28 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1032                        | -0.0288       |
| 4. 期末基金资产净值     | 172,096,968.81                 | 78,252,479.48 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.481                          | 1.448         |

- 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

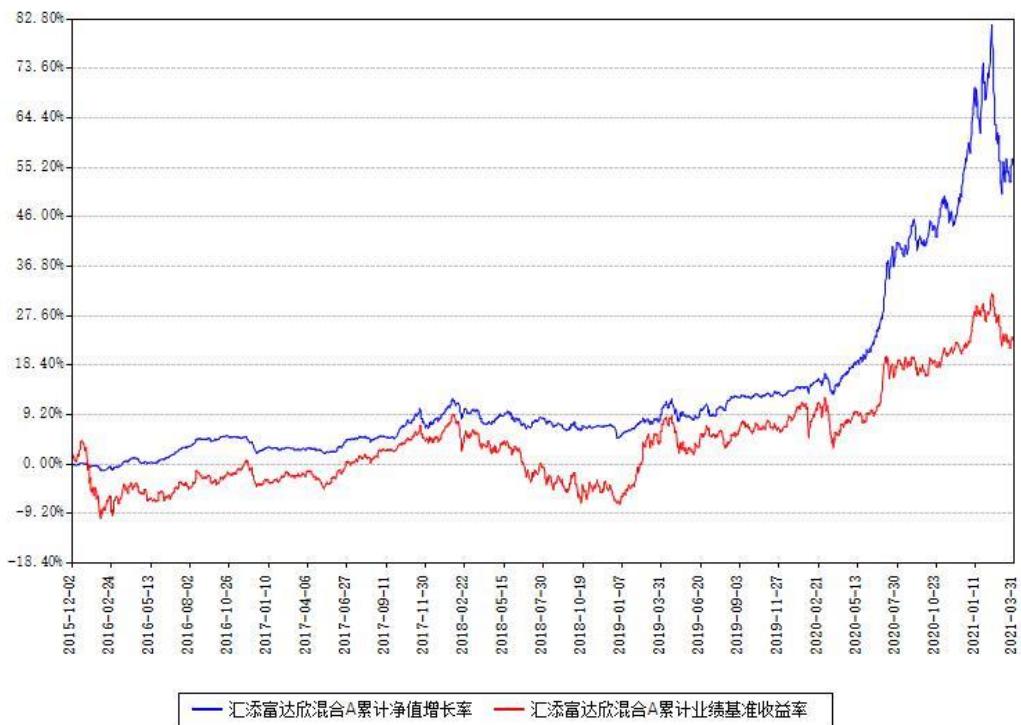
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富达欣混合 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     | -3.71%   | 1.54%       | -1.30%     | 0.80%         | -2.41% | 0.74% |
| 过去六个月     | 9.30%    | 1.20%       | 5.61%      | 0.67%         | 3.69%  | 0.53% |

| 过去一年        | 35.37%   | 0.96%       | 16.67%     | 0.66%         | 18.70% | 0.30%  |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三年        | 44.67%   | 0.61%       | 18.79%     | 0.68%         | 25.88% | -0.07% |
| 过去五年        | 54.43%   | 0.49%       | 28.49%     | 0.59%         | 25.94% | -0.10% |
| 自基金合同生效日起至今 | 55.66%   | 0.47%       | 23.16%     | 0.63%         | 32.50% | -0.16% |
| 汇添富达欣混合 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       | -3.79%   | 1.54%       | -1.30%     | 0.80%         | -2.49% | 0.74%  |
| 过去六个月       | 9.04%    | 1.20%       | 5.61%      | 0.67%         | 3.43%  | 0.53%  |
| 过去一年        | 34.82%   | 0.96%       | 16.67%     | 0.66%         | 18.15% | 0.30%  |
| 过去三年        | 42.75%   | 0.61%       | 18.79%     | 0.68%         | 23.96% | -0.07% |
| 过去五年        | 51.56%   | 0.49%       | 28.49%     | 0.59%         | 23.07% | -0.10% |
| 自基金合同生效日起至今 | 52.31%   | 0.47%       | 23.16%     | 0.63%         | 29.15% | -0.16% |

### 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

## 汇添富达欣混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



## 汇添富达欣混合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》生效之日起 6 个月，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<br>(年) | 说明   |
|-----|----------|------------------|------|---------------|--|
|     |          | 任职日期             | 离任日期 |               |  |
| 李云鑫 | 本基金的基金经理 | 2020 年 06 月 10 日 |      | 10            | 国籍：中国。学历：清华大学化工硕士。从业资格：证券投资基金管理从业资格。从业经历：曾任国泰君安证券、国信证券行业分析师。2015 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司任行业分析师。2020 年 3 月 3 日至 2020 年 6 月 10 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助理。2020 年 3 月 3 日至 2020 年 6 月 10 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。2020 年 3 月 18 日至 2020 年 5 月 20 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 4 月 14 日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 5 月 20 日至今任汇添富 |

|    |          |                  |  |   |   |
|----|----------|------------------|--|---|---|
|    |          |                  |  |   | 盈泰灵活配置混合型证券投资基金管理的基金经理。<br>2020 年 6 月 10 日至今任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金管理的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金管理的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 11 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助理。2020 年 8 月 5 日至今任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。<br>2020 年 11 月 4 日至今任汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 胡奕 | 本基金的基金经理 | 2020 年 07 月 01 日 |  | 7 | 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<br>月任汇添富基金<br>管理股份有限公<br>司固定收益研究<br>员；2018 年 7<br>月至 2019 年 8<br>月任汇添富基金<br>管理股份有限公<br>司固定收益高级<br>研究员。2019<br>年 9 月 1 日至<br>2020 年 7 月 1<br>日任汇添富安鑫<br>智选灵活配置混<br>合型证券投资基<br>金的基金经理助<br>理。2019 年 9<br>月 1 日至 2021<br>年 1 月 29 日任<br>汇添富多元收益<br>债券型证券投资<br>基金的基金经理<br>助理。2019 年 9<br>月 1 日至 2021<br>年 1 月 29 日任<br>汇添富年年丰定<br>期开放混合型证<br>券投资基金的基<br>金经理助理。<br>2019 年 9 月 1<br>日至 2021 年 1<br>月 29 日任汇添<br>富年年泰定期开<br>放混合型证券投资<br>基金的基金经理<br>助理。2019<br>年 9 月 1 日至今<br>任汇添富年年益<br>定期开放混合型证<br>券投资基金的基<br>金经理助理。<br>2019 年 9 月 1<br>日至 2021 年 1<br>月 29 日任汇添<br>富双利增强债券<br>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。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。2019 年 9 月 1 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助理。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。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。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<br>金的基金经理助<br>理。2019 年 10<br>月 8 日至 2021<br>年 1 月 29 日任<br>汇添富盈安灵活<br>配置混合型证券<br>投资基金的基金<br>经理助理。2019<br>年 10 月 8 日至<br>2020 年 7 月 1<br>日任汇添富盈润<br>混合型证券投资<br>基金的基金经理<br>助理。2019 年<br>10 月 8 日至<br>2021 年 1 月 29<br>日任汇添富盈泰<br>灵活配置混合型<br>证券投资基金的<br>基金经理助理。<br>2019 年 11 月 19<br>日至今任汇添富<br>稳健增长混合型<br>证券投资基金的<br>基金经理助理。<br>2020 年 7 月 1<br>日至今任汇添富<br>安鑫智选灵活配<br>置混合型证券投资<br>基金的基金经<br>理。2020 年 7<br>月 1 日至今任汇<br>添富达欣灵活配<br>置混合型证券投资<br>基金的基金经理。<br>2020 年 7 月 1<br>日至今任汇添富<br>弘安混合型证券<br>投资基金的基金<br>经理。2020<br>年 7 月 1 日至今<br>任汇添富睿丰混<br>合型证券投资基<br>金（LOF）的基<br>金经理。2020 |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | 年 7 月 1 日至今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 日至今任汇添富熙和精选混合型证券投资基<br>金的基金经理。<br>2020 年 7 月 1 日至今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。 |
|--|--|--|--|--|

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嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司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、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统中的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

#### 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，本公司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 9 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，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

2021 年 1 季度，市场经历了剧烈的波动和调整。1 月份市场仍延续 20Q4 的良好运行，但部分行业及个股已经显现出泡沫化的特征，透支了阶段性的潜在回报率。国内流动性延续边际收紧预期，这其中一个较大的变量来自于美国疫苗推广超出市场预期，美国经济的复苏动能更加充沛，美债收益率迎来了一个快速上行期，这对全球资产的定价产生了较大的冲击。考虑到之前市场已经向部分优秀资产集聚，交易较为拥挤，调整的幅度也超出了预期。

在基金的运作上，我们自始至终坚持我们的价值观和理念，中长期我们在资本市场上获得的所有超额收益均来自于我们组合中的优秀企业所创造，因此我们选择与数量稀少的一些伟大公司相伴成长，获得时间价值的回报。我们不对市场风格做极端判断，专注于寻找生意属性优越，竞争优势突出，拥有正直可靠管理层的优秀公司，构建我们的组合。在行业上，我们聚焦在消费升级、医疗服务、互联网、新能源、科技创新、高端制造等领域。基于组合平衡和稳定性的考虑，我们在 Q1 对部分透支较多潜在回报率的行业和个股做了一定的减持，增加了受益经济复苏的制造类资产，平滑组合的波动。

债券部分，一季度以来，国内经济延续向好态势，大部分行业 GDP 增速已超过疫情前水平，工业企业利润增速大幅回升，叠加海外疫情好转后生产恢复，工业品价格大幅上涨。随着经济增长的恢复，政策重心由之前的稳增长、保就业向稳杠杆、防风险倾斜，叠加通胀压力的回升，货币政策有所收紧，但是在“不急转弯”、“稳字当头”的指导下，总体力度较为温和。不过随着出口替代对经济的拉动作用趋于下降，结合国内政策重心转变，预计国内经济复苏开始进入后半段。此外，信用事件频出使得债券市场风险偏好下降，资金追逐利率债和高等级信用债，规避信用下沉，因此利率债和高等级信用债收益率震荡中小幅上行。一季度 10 年国债上升 4bp 至 3.19%，3 年 AAA 中票上升 5bp 至 3.59%。

组合债券仓位有所降低，保持中性久期，持仓以高等级信用债为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 -3.71%;C 类基金份额净值增长率为 -3.79%。同期业绩比较基准收益率为 -1.30%。

#### 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   | 99,606,183.93  | 34.57        |
|    | 其中：股票  | 99,606,183.93  | 34.57        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 136,808,259.20 | 47.48        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             | 136,808,259.20 | 47.48  |
|   | 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      | 9,953,631.74   | 3.45   |
| 8 | 其他资产              | 41,762,222.27  | 14.49  |
| 9 | 合计                | 288,130,297.14 | 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              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 72,892,232.07 | 29.12        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,036.12     | 0.01         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 20,254.06     | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 8,558,608.96  | 3.42         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 6,266,659.60  | 2.50         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 328,384.62    | 0.13         |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 11,516,008.50 | 4.60  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 99,606,183.93 | 39.79 |

### 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 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  | 600519 | 贵州茅台 | 4,400   | 8,839,600.00 | 3.53         |
| 2  | 601888 | 中国中免 | 27,962  | 8,558,608.96 | 3.42         |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 26,300  | 8,473,071.00 | 3.38         |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 28,100  | 7,530,238.00 | 3.01         |
| 5  | 600809 | 山西汾酒 | 21,600  | 7,188,480.00 | 2.87         |
| 6  | 000568 | 泸州老窖 | 31,700  | 7,133,134.00 | 2.85         |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 126,623 | 7,078,225.70 | 2.83         |
| 8  | 300015 | 爱尔眼科 | 108,162 | 6,408,598.50 | 2.56         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
|    |        | 科    |        |              |      |
| 9  | 603259 | 药明康德 | 44,698 | 6,266,659.60 | 2.50 |
| 10 | 600309 | 万华化学 | 57,300 | 6,050,880.00 | 2.42 |

#### 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      | 20,093,959.20  | 8.03         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | —              | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —              | —            |
| 4  | 企业债券      | 106,677,300.00 | 42.61        |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6  | 中期票据      | 10,037,000.00  | 4.01         |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 136,808,259.20 | 54.65        |

#### 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  | 122248 | 13 福新 02 | 200,000 | 20,732,000.00 | 8.28         |
| 2  | 175263 | 20 中金 12 | 200,000 | 20,178,000.00 | 8.06         |

|   |        |             |         |               |      |
|---|--------|-------------|---------|---------------|------|
| 3 | 019640 | 20 国债<br>10 | 201,020 | 20,093,959.20 | 8.03 |
| 4 | 152500 | 20 陆嘴<br>01 | 160,000 | 15,916,800.00 | 6.36 |
| 5 | 163449 | 20 浦创<br>03 | 150,000 | 14,700,000.00 | 5.87 |

## 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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、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   | 313,328.26    |
| 2  | 应收证券清算款 | 39,682,387.16 |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利  | —             |
| 4 | 应收利息  | 1,764,358.92  |
| 5 | 应收申购款 | 2,147.93      |
| 6 | 其他应收款 | —             |
| 7 | 待摊费用  | —             |
| 8 | 其他    | —             |
| 9 | 合计    | 41,762,222.27 |

#### 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            | 汇添富达欣混合 A      | 汇添富达欣混合 C      |
|---------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 161,445,817.22 | 122,307,929.81 |
| 本报告期基金总申购份额   | 132,845,413.25 | 7,239,347.62   |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 178,075,457.63 | 75,503,892.13  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | —              | —              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 116,215,772.84 | 54,043,385.30  |

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

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达欣灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富达欣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、报告期内汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金在指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

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 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。

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 04 月 22 日