

# 汇添富稳健回报债券型证券投资基金 2023 年 年度报告

2023 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：恒丰银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告 .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	24
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	24
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	24
§ 5 托管人报告 .....	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	25
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	25
§ 6 审计报告 .....	25
6.1 审计报告的基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
§ 7 年度财务报表.....	27
7.1 资产负债表 .....	27
7.2 利润表 .....	28
7.3 净资产变动表 .....	30
7.4 报表附注 .....	31
§ 8 投资组合报告.....	59
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	61

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
8.6 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.....	81
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	82
8.8 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贵金属投资明细.....	82
8.9 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.....	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
8.12 投资组合报告附注.....	82
§ 9 基金份额持有人信息.....	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	84
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	84
§ 10 开放式基金份额变动.....	84
§ 11 重大事件揭示.....	85
11.1 基金份额持有人大会决议.....	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
11.4 基金投资策略的改变.....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	87
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
12.1 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.....	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§ 13 备查文件目录.....	88
13.1 备查文件目录.....	88
13.2 存放地点.....	88
13.3 查阅方式.....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富稳健回报债券型证券投资基金	
基金简称	汇添富稳健回报债券	
基金主代码	018830	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 09 月 01 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	恒丰银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	725,428,774.05	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富稳健回报债券 A	汇添富稳健回报债券 C
下属分级基金的交易代码	018830	018831
报告期末下属分级基金的 份额总额(份)	482,762,433.87	242,666,340.18

### 2.2 基金产品说明

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，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取目标波动风险预算技术进行资产配置，量化与基本面相结合的股票投资策略进行权益部分投资，以及采用多种策略进行固定收益部分投资。通过综合运用以上技术，本基金将优化投资过程，力争将组合整体预期波动率限定在合适范围，实现风险约束下投资组合预期收益的最大化，从而实现较好的稳健回报。从长期来看，目标波动风险预算技术在风险控制方面效果显著，能够提高风险调整后收益。本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、多因子量化选股策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、可转债及可交换债投资策略及国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债-1-3 年政策性金融债财富(总值)指数*80%+中证 800 指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	恒丰银行股份有限公司
信息披露 姓名	李鹏	梁明

负责人	联系电话	021-28932888	021-63890689
	电子邮箱	service@99fund.com	liangming@hfbank.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95395
传真		021-28932998	021-63890708
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	济南市历下区泺源大街8号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	上海市黄浦区开平路88号瀛通绿地大厦16楼
邮政编码		200010	200023
法定代表人		李文	辛树人

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年09月01日（基金合同生效日）-2023年12月31日	
	汇添富稳健回报债券A	汇添富稳健回报债券C
本期已实现收益	-3,040,602.06	-2,121,832.86
本期利润	-4,978,297.22	-4,943,486.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0069	-0.0105
本期加权平均净值利润率	-0.69%	-1.06%
本期基金份额净值增长率	-0.43%	-0.57%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	
期末可供分配利润	-2,244,295.23	-1,451,453.15

期末可供分配基金份额利润	-0.0046	-0.0060
期末基金资产净值	480,665,072.40	241,287,352.58
期末基金份额净值	0.9957	0.9943
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.43%	-0.57%

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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2023 年 09 月 01 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 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

汇添富稳健回报债券 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	-0.23%	0.13%	-0.33%	0.12%	0.10%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-0.43%	0.12%	-0.64%	0.12%	0.21%	0.00%
汇添富稳健回报债券 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	-0.34%	0.13%	-0.33%	0.12%	-0.01%	0.01%

自基金合同生效日起至今	-0.57%	0.12%	-0.64%	0.12%	0.07%	0.00%
-------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

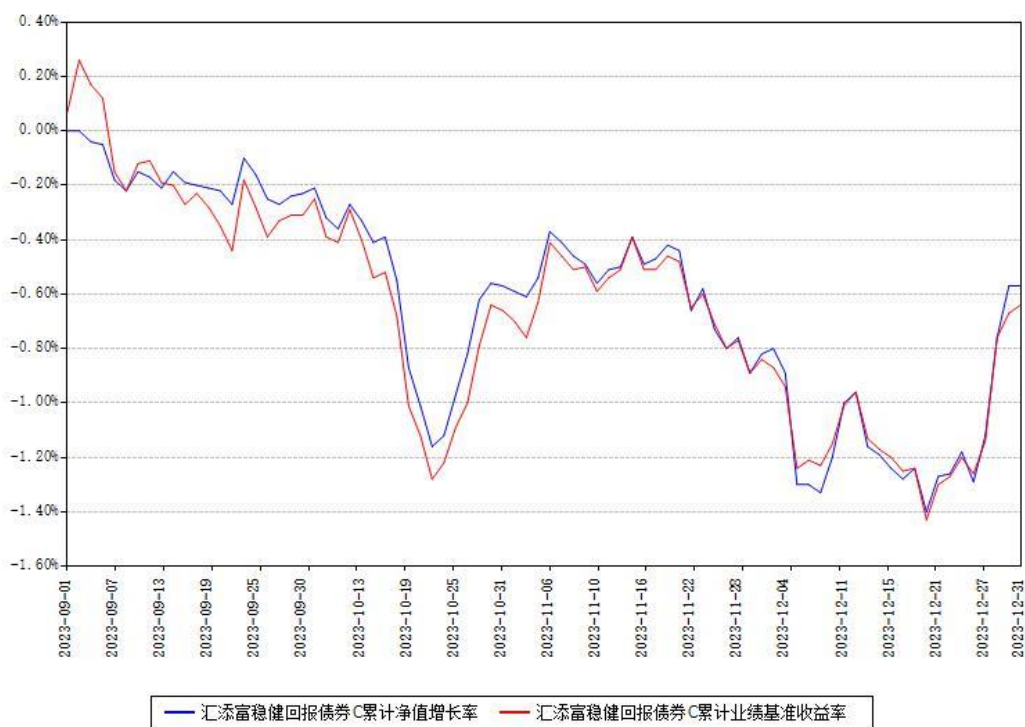
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富稳健回报债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图





汇添富稳健回报债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

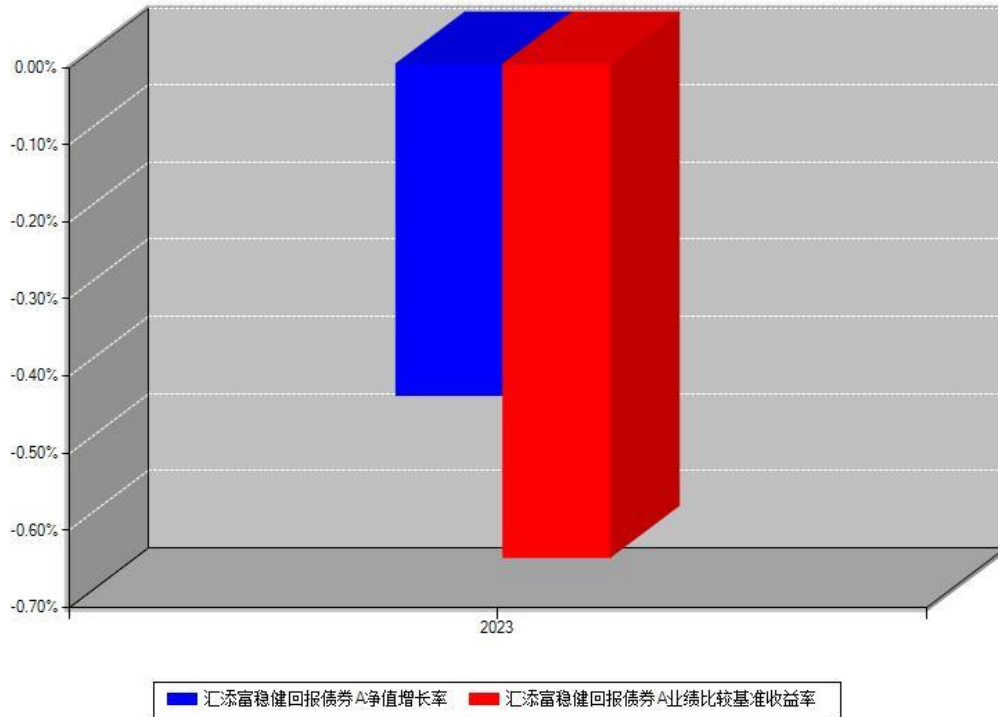


注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 09 月 01 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

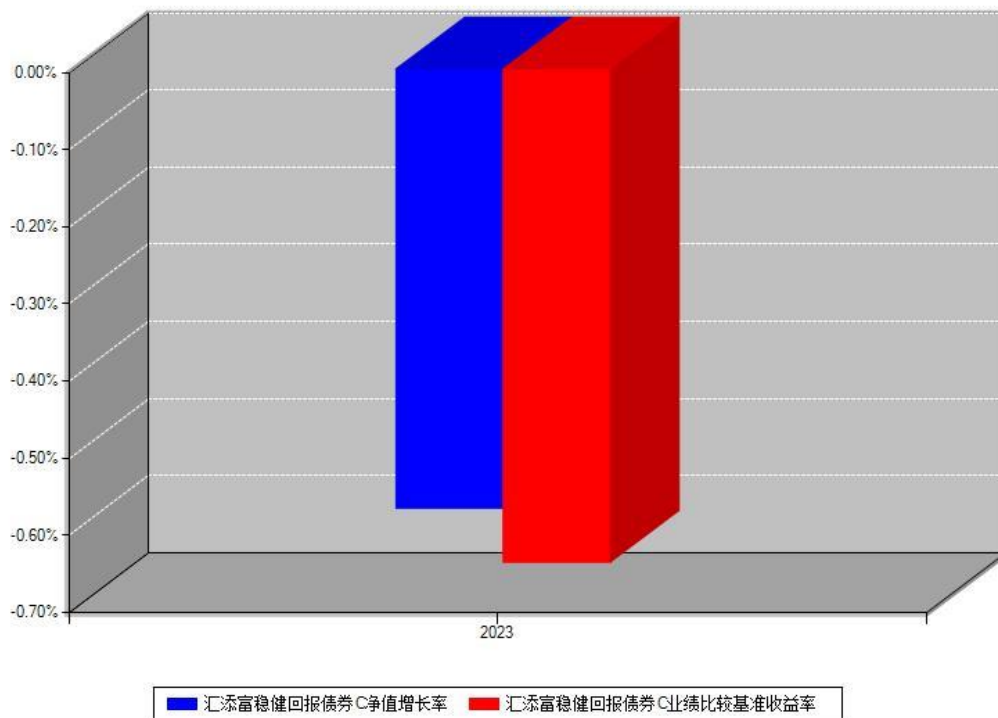
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富稳健回报债券A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富稳健回报债券C每年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 2023 年 09 月 01 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 09 月 01 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理(美国)控股有限公司、汇添富资产管理(新加坡)有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2023 年，汇添富基金新成立 48 只公募基金，包括 14 只混合型基金，21 只股票型基金，13 只债券型基金。2023 年底，公司公募基金产品总数达 318 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2023 年，汇添富基金坚持以“客户体验”为中心，以“创新”为宗旨，以“服务”为生命力，稳扎稳打实现互联网平台全方位发展。全年大力开拓投顾式销售及服务模式，持续提升自有平台创新能力。全面致力于基于买方视角下的投顾服务转型，提升客户投资的服务体验。通过打通公司投研端和销售端，实现资源共享最大化，为投顾转型提供更加充实的底层能力支持；同时针对客户端，通过投顾专区进行改版升级，优化投顾策略推荐逻辑，融入丰富的投资工具、工具使用场景和丰富的资讯、内容服务，提升客户投资体验，践行公司投

顾转型战略目标。

与此同时，积极拥抱第三方互联网基金销售平台，进一步加强与多家互联网巨头的深度战略合作。围绕客户需求，重构客户中心、资产中心、产品中心、内容中心、活动中心等，全面进行平台运营体系化建设。以开放、转型、服务、共享为目标，搭建以内容中台、营销运营中台、理财师中台、投顾中台等为主要模块的数字中台矩阵。坚持致力于为客户提供全生命周期服务，力争通过金融科技全流程赋能加持，进一步提升客户满意度。

2023 年，汇添富基金继续坚定推进与核心机构客户的合作战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。公司不断提升客户服务及产品运营能力，聚焦战略级机构客户，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位。积极布局多只创新型品种，满足机构投资者专业化需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2023 年渠道客户偏好低风险化、渠道运营线上线下一体化趋势愈加明显，公司持续深化核心渠道战略，始终秉持“客户第一”的价值观，围绕如何提升客户“获得感”，优化客户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具，对客户进行分类经营和分层触达，建立精准的客户画像，提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。积极践行金融科技创新，搭建了一站式投研资讯服务平台，提供紧贴市场的专业投资服务，以及便捷高效的营销辅助工具，赋能渠道客户经理。全年合计开展超 8481 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。大力开展走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列投资者教育活动，营销培训活动覆盖至各渠道分支机构。

2023 年是券商渠道业务服务深化的一年。为了更好地服务券商渠道客户，公司在 2023 年度组织了超过 2600 场的线上和线下投教、路演活动，主题包括 ETF 大讲堂、走进汇添富、基金经理面对面、投资策略报告会等，覆盖了各重点券商渠道的重点分支机构和营业部，旨在为一线投顾赋能的同时，也为广大投资者提供更全面的投资策略交流机会。此外，公司在重点券商渠道积极推广“指能添富”品牌和策略，并结合市场情况，为券商渠道提供相关 ETF 及指数增强产品的配置建议及以客户为中心的解决方案。

2023 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2023 年，汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显着成效，国际业务总资产管理规模保持稳定。汇添富香港子公司发行汇添富美元货币市场基金，进一步完善海外产品线布局，涵盖境外权益、固收、货币类产品，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础，“汇添富中港策略基金”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级。从 2023 年年初开始，继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2023 年以来，汇添富积极投身公益慈善，充分发挥公募基金力量，履行社会责任，助力实现“共同富裕”。教育助学方面，连续十五年开展“河流·孩子”公益助学项目，组织党支部开展 9 场公益行活动，约 300 名党员、员工、客户与合作伙伴成为公益志愿者，相继回访了四川美姑、贵州黎平、云南怒江、青海互助、内蒙扎兰屯、宁夏泾源、广西百色、湖北恩施、湖南城步等中西部的添富小学，开展学校调研、梦想课堂、学生走访。在上海成功举办“河流·孩子”十五周年公益音乐会及艺术夏令营，帮助来自大山深处、偏远河畔的孩子们开阔眼界、增长见识、提升素养；举办第十六期“河流·孩子”乡村优秀青年教师培训，赋能了 80 位乡村优秀青年教师，助力乡村教师掌握先进的教育理念与教学方法。金融慈善方面，积极探索创新公益新模式，在中国基金业协会的指导和支持下，举办第二期、第三期“基业上善”慈善资产管理研修营，三期累计已为 87 家基金会培养了 190 名慈善资产管理专业人才，涵盖的慈善资产规模超过 148 亿元，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展。参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，助力慈善资产管理的规范化和高质量发展。爱国拥军方面，携手上海市拥军优属基金会开展“崇敬英雄”公益项目，成为“爱国拥军支持单位”，进一步服务国防建设及拥军优属事业。社区公益方面，携手小东门街道开展南外滩健康直通车项目，参与小东门社区公益发展专项基金，支持本地社区建设，共建更有温度的美好社区。乡村振兴方面，参加云南、青海、内蒙古等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作帮扶，助力乡村振兴。

2024 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助	证券从业年限	说明
----	----	-------------	--------	----

		理) 期限		(年)	
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2023 年 09 月 01 日	-	17	国籍: 中国。学历: 中国科学技术大学管理学博士。从业资格: 证券投资基金从业资格。从业经历: 曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上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

				<p>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 2023 年 4 月 24 日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 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型</p>
--	--	--	--	--

				<p>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</p>
--	--	--	--	---



				<p>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 2023 年 8 月 23 日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。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选</p>
--	--	--	--	---

					<p>股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
郑文旭	本基金的基金经理助理	2023 年 09 月 01 日	-	12	<p>国籍：中国。学历：厦门大学金融工程硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2008 年 6 月至 2010 年 6 月担任万得资讯债券产品经理，2010 年 6 月至 2013 年 7 月担任东海证券固定收益部债券研究员及研究主管。2013 年 8 月起担任鑫元基金信用研究员，2014 年 4 月至 2018 年 1 月担任鑫元基金专户投资经理。2018 年 2 月至 2022 年 6 月担任鑫元基金基金经理。2022 年 7 月加入汇添富基金。2023 年</p>

					2月20日至今任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023年6月12日至今任汇添富丰利短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年9月1日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理助理。2023年9月5日至今任汇添富高息债债券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相关规定。

#### 4.1.3 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管

理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.3.2 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：

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。

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。

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。

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。

#### 4.3.3 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 45 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年，中国宏观经济整体呈现结构性复苏态势。经济趋势温和回暖，上半年节后复工复产加快，出行链持续修复，工业生产逐步复苏；下半年宏观调控组合政策发力显效，局部数据企稳回升，经济向好的态势得到延续。经济在结构上呈现新旧动能转换态势，消费和服务业、高端制造等对经济的贡献在上升，而地产、投资、出口的贡献在下降。政策方向上坚持高质量发展，宏观调控注重精准，维持流动性合理充裕，中央财政加杠杆和提高存量政策有效性等政策思路显现。海外方面，2023 年前三季度美债收益率和美元指数持续波动上涨，抑制全球风险资产表现；四季度美债利率见顶下行，美元指数走低，全球风险资产有

所提振。

2023 年，资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情，但自二季度起开始震荡下行，四季度呈现成交收缩、情绪持续低迷的态势。全年市场整体震荡下行，行业和风格波动较大，各子行业和概念板块来看，AI 及中特估相关板块上涨较多，地产链及消费板块跌幅靠前；风格方面，红利风格表现优异，市场整体上仍呈现小盘优于大盘、价值优于成长的特性。量化选股因子方面，质量、低波动、低估值等逆向类因子以及交易类因子仍延续之前的较好表现，与此同时，成长、预期等因子整体表现一般。相比于股票市场，债券市场表现较好，到期收益率尽管有波动，但受益于流动性好和防御性投资情绪，整体到期收益率下行明显。

政策层面看，10 月末召开了中央金融工作会议，12 月召开了中央经济工作会议。中央金融工作会议强调金融服务实体经济的定位，以提供高质量金融服务作为发展导向目标，提出全面加强金融监管防风险。中央经济工作会议提出当前风险隐患仍然较多，2024 年政策主基调需坚持稳中求进、以进促稳、先立后破。会议同时指出，积极的财政政策要适度加力、提质增效，稳健的货币政策要灵活适度、精准有效。

报告期内，本基金将按照二级债基的投资要求，以量化方式构建权益组合，以风险预算的策略来进行股债投资比例的确定，以稳健的方式构建债券组合，力求实现稳健的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富稳健回报债券 A 类份额净值增长率为-0.43%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%。本报告期汇添富稳健回报债券 C 类份额净值增长率为-0.57%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，高质量发展仍是时代主题，整体宏观经济以稳为主。调控效果预计在新的一年里逐步显现，三大工程相关的财政准财政支撑有望缓解地产的下滑困境，居民消费潜力仍有释放空间，这些因素有利于巩固经济回升态势。同时，随着海外通胀逐步得到控制，外部流动性有望边际宽松。经济结构性转型需要经历新旧动能切换，带来阶段性阵痛，居民就业及收入预期改善需要时间。政策基调在最近一次中央经济工作会议上明确为偏积极，有望促进市场信心稳定，加快转型出清。

从政策预期来看，财政准财政政策可能成为托底经济的主导力量，同时货币政策提供适度的流动性支持，降准降息存在一定空间，总体仍然是稳总量重结构，强调政策的精准有效。

尽管资本市场目前仍面临对经济信心不足、财富效应收缩的问题，A 股市场估值处于历史分位点极低状态，中长期有较好的投资价值，短期角度，一旦投资者情绪发生改善，也将

有较好的交易机会。在流动性宽松预期下，债券市场在 2024 年仍有利率下行空间，而股票和债券的组合，在一定程度上也将体现出风险分散的作用，二级债基这种产品形式在利率不断下行的阶段，对于低风险投资者来说也将具有更加突出的投资价值。

作为二级债基产品，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法实现组合构建和风险管理。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；优化从业人员管理机制，加强管理措施，严格执行合规考核问责机制，引导全体员工不断提升合规执业意识，强化公司合规履职保障。

##### 2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

##### 3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核

检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协调并协助监管机构、第三方独立机构开展各项自查、核查以及审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过对各项检查、审计发现的风险隐患的整改情况进行跟踪检查，持续优化内控管理水平，切实维护基金持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70015647_B301 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富稳健回报债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富稳健回报债券型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 9 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富稳健回报债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富稳健回报债券型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富稳健回报债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富稳健回报债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富稳健回报债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富稳健回报债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对汇添富稳健回报债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富稳健回报债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	许培菁 韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2024年03月27日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富稳健回报债券型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	2,663,785.95
结算备付金		18,339,424.65
存出保证金		422,786.84
交易性金融资产	7.4.7.2	886,580,638.15
其中：股票投资		134,621,481.98
基金投资		-
债券投资		751,959,156.17
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-

债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		2,166,036.54
应收股利		-
应收申购款		1,002.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		910,173,674.13
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		185,338,256.11
应付清算款		-
应付赎回款		1,857,700.83
应付管理人报酬		272,581.76
应付托管费		68,145.43
应付销售服务费		87,419.49
应付投资顾问费		-
应交税费		27,868.62
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.7	569,276.91
负债合计		188,221,249.15
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.8	725,428,774.05
未分配利润	7.4.7.9	-3,476,349.07
净资产合计		721,952,424.98
负债和净资产总计		910,173,674.13

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 725,428,774.05 份。本基金下属汇添富稳健回报债券 A 基金份额净值 0.9957 元，基金份额总额 482,762,433.87 份；本基金下属汇添富稳健回报债券 C 基金份额净值 0.9943 元，基金份额总额 242,666,340.18 份。

2、本基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富稳健回报债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 09 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 09 月 01 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-5,484,558.95</b>
1. 利息收入		1,431,663.34
其中：存款利息收入	7.4.7.10	222,457.95
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,209,205.39
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,157,589.39
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-9,358,661.87
基金投资收益	7.4.7.12	-
债券投资收益	7.4.7.13	6,793,085.45
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	407,987.03
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	-4,759,348.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	715.75
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,437,224.62</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,600,425.84
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	400,106.50
3. 销售服务费		632,813.46
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		1,639,152.24
其中：卖出回购金融资产支出		1,639,152.24
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-
7. 税金及附加		14,870.53
8. 其他费用	7.4.7.21	149,856.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）</b>		<b>-9,921,783.57</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-9,921,783.57</b>

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-9,921,783.57

注：本基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富稳健回报债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,529,110,575.98	-	1,529,110,575.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-803,681,801.93	-3,476,349.07	-807,158,151.00
（一）、综合收益总额	-	-9,921,783.57	-9,921,783.57
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-803,681,801.93	6,445,434.50	-797,236,367.43
其中：1. 基金申购款	50,515,357.46	-363,997.76	50,151,359.70
2. 基金赎回款	-854,197,159.39	6,809,432.26	-847,387,727.13
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	725,428,774.05	-3,476,349.07	721,952,424.98

注：本基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富稳健回报债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1238号文《关于准予汇添富稳健回报债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于2023年9月1日生效。首次设立基金募集规模为1,529,110,575.98份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第60466941\_B46号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、可转债与可交债的比例合并计算后不得超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：中债-1-3年政策性金融债财富（总值）指数×80%+中证800指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的

具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。



#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受

相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金可进行基金收益分配,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资,基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,无需召开基金份额持有人大会。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,663,785.95
等于：本金	2,662,451.26
加：应计利息	1,334.69
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,663,785.95

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	139,922,476.85	-	134,621,481.98	-5,300,994.87	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	276,168,200.37	2,297,674.53	278,457,674.53	-8,200.37
	银行间市场	467,736,153.41	5,215,481.64	473,501,481.64	549,846.59
	其他	-	-	-	-
	合计	743,904,353.78	7,513,156.17	751,959,156.17	541,646.22
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	883,826,830.63	7,513,156.17	886,580,638.15	-4,759,348.65	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。



#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	429,276.91
其中：交易所市场	419,291.91
银行间市场	9,985.00
应付利息	-
应付审计费	70,000.00
应付信息披露费	70,000.00
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	569,276.91

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富稳健回报债券 A	
项目	本期 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	847,873,540.89	847,873,540.89
本期申购	50,368,404.60	50,368,404.60
本期赎回（以“-”号填列）	-415,479,511.62	-415,479,511.62
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	482,762,433.87	482,762,433.87
汇添富稳健回报债券 C		
项目	本期 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	681,237,035.09	681,237,035.09
本期申购	146,952.86	146,952.86
本期赎回（以“-”号填列）	-438,717,647.77	-438,717,647.77
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	242,666,340.18	242,666,340.18

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,528,750,509.50 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 360,066.48 元，以上实收基金（本息）合计人民币 1,529,110,575.98 元，折合 1,529,110,575.98 份人民币基金份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富稳健回报债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生	-	-	-

效日			
本期利润	-3,040,602.06	-1,937,695.16	-4,978,297.22
本期基金份额交易产生的变动数	796,306.83	2,084,628.92	2,880,935.75
其中：基金申购款	-180,140.72	-182,508.43	-362,649.15
基金赎回款	976,447.55	2,267,137.35	3,243,584.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,244,295.23	146,933.76	-2,097,361.47
汇添富稳健回报债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,121,832.86	-2,821,653.49	-4,943,486.35
本期基金份额交易产生的变动数	670,379.71	2,894,119.04	3,564,498.75
其中：基金申购款	-559.88	-788.73	-1,348.61
基金赎回款	670,939.59	2,894,907.77	3,565,847.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,451,453.15	72,465.55	-1,378,987.60

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年09月01日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	162,334.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	58,877.56
其他	1,245.56
合计	222,457.95

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	337,197,589.16
减：卖出股票成本总额	345,729,349.60
减：交易费用	826,901.43
买卖股票差价收入	-9,358,661.87

#### 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	8,930,719.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,137,634.13
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	6,793,085.45

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,081,102,528.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,069,761,240.52
减：应计利息总额	13,462,009.52
减：交易费用	16,912.50
买卖债券差价收入	-2,137,634.13

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年09月01日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	407,987.03
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	407,987.03

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年09月01日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,759,348.65
——股票投资	-5,300,994.87
——债券投资	541,646.22
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,759,348.65

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年09月01日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	715.75

替代损益	-
其他	-
合计	715.75

#### 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	9,851.74
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	4.31
合计	149,856.05

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
恒丰银行股份有限公司（“恒丰银行股份有限公司”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期不存在向关联方支付佣金的情况。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,600,425.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	291,143.24
应支付基金管理人的净管理费	1,309,282.60

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.4% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	400,106.50

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富稳健回报债券 A	汇添富稳健回报债券 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	12.45	12.45
恒丰银行股份有限公司	-	629,561.33	629,561.33
合计	-	629,573.78	629,573.78



注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，销售服务费由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 09 月 01 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
恒丰银行股份有限公司	2,663,785.95	162,334.83

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款共人民币 185,338,256.11 元，于 2024 年 01 月 02 日, 2024 年 01 月 04 日, 2024 年 01 月 05 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组

织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	45,235,479.45
合计	45,235,479.45

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日
AAA	304,905,604.92
AAA 以下	-
未评级	401,818,071.80
合计	706,723,676.72

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3年 12 月 31 日	1 个月以内	1- 3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,663,785.95	-	-	-	-	-	2,663,785.95
结算备付金	18,339,424.65	-	-	-	-	-	18,339,424.65
存出保证金	422,786.84	-	-	-	-	-	422,786.84
交易性金融资产	-	-	45,235,479.45	706,723,676.72	-	134,621,481.98	886,580,638.15
衍生	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,166,036.54	2,166,036.54
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,002.00	1,002.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,425,997.44	-	45,235,479.45	706,723,676.72	-	136,788,520.52	910,173,674.13

计							
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	185,338,256.11	-	-	-	-	-	185,338,256.11
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,857,700.83	1,857,700.83
应付管理人	-	-	-	-	-	272,581.76	272,581.76

报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	68,145.43	68,145.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	87,419.49	87,419.49
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	27,868.62	27,868.62
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	569,276.91	569,276.91
负债总计	185,338,256.11	-	-	-	-	2,882,993.04	188,221,249.15



利率敏感度缺口	-163,912,258 .67	-	45,235,479 .45	706,723,676 .72	-	133,905,527 .48	721,952,424 .98
---------	---------------------	---	-------------------	--------------------	---	--------------------	--------------------

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	3,240,279.66
	基准利率增加 25 个基点	-3,217,279.83

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	134,621,481.98	18.65
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	751,959,156.17	104.16
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	886,580,638.15	122.80

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上涨 5%	4,816,070.63
	中证 800 指数下跌 5%	-4,816,070.63

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	134,621,481.98
第二层次	751,959,156.17
第三层次	-
合计	886,580,638.15

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

##### 7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

#### 7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	134,621,481.98	14.79
	其中：股票	134,621,481.98	14.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	751,959,156.17	82.62
	其中：债券	751,959,156.17	82.62
	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	21,003,210.60	2.31
8	其他各项资产	2,589,825.38	0.28
9	合计	910,173,674.13	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,179,347.00	0.16
B	采矿业	13,400,716.00	1.86
C	制造业	73,767,903.58	10.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,990,656.00	1.66
E	建筑业	1,084,165.00	0.15
F	批发和零售业	1,534,260.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,722,877.00	0.24
H	住宿和餐饮业	173,646.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,837,129.40	1.64
J	金融业	11,612,693.00	1.61
K	房地产业	905,731.00	0.13
L	租赁和商务服务业	1,659,050.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	1,398,912.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	171,702.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	126,888.00	0.02
Q	卫生和社会工作	697,552.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,224,782.00	0.17
S	综合	133,472.00	0.02
	合计	134,621,481.98	18.65

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	2,900	5,005,400.00	0.69
2	600900	长江电力	157,000	3,664,380.00	0.51
3	000333	美的集团	35,450	1,936,633.50	0.27
4	600028	中国石化	342,000	1,908,360.00	0.26
5	601088	中国神华	59,300	1,859,055.00	0.26
6	601225	陕西煤业	69,700	1,456,033.00	0.20
7	601857	中国石油	203,800	1,438,828.00	0.20
8	002475	立讯精密	38,600	1,329,770.00	0.18
9	002594	比亚迪	6,500	1,287,000.00	0.18
10	000858	五粮液	9,000	1,262,790.00	0.17
11	601318	中国平安	29,200	1,176,760.00	0.16
12	600276	恒瑞医药	25,500	1,153,365.00	0.16
13	300750	宁德时代	7,000	1,142,820.00	0.16
14	601985	中国核电	151,500	1,136,250.00	0.16
15	000725	京东方A	288,800	1,126,320.00	0.16
16	600941	中国移动	10,800	1,074,384.00	0.15
17	601899	紫金矿业	86,000	1,071,560.00	0.15
18	000651	格力电器	32,400	1,042,308.00	0.14
19	300760	迈瑞医疗	3,500	1,017,100.00	0.14
20	000063	中兴通讯	38,200	1,011,536.00	0.14
21	601728	中国电信	186,300	1,007,883.00	0.14
22	600905	三峡能源	229,600	1,003,352.00	0.14
23	600050	中国联通	229,000	1,003,020.00	0.14
24	002415	海康威视	28,800	999,936.00	0.14
25	600036	招商银行	33,500	931,970.00	0.13
26	300308	中际旭创	7,700	869,407.00	0.12
27	603259	药明康德	11,700	851,292.00	0.12
28	688981	中芯国际	15,200	805,904.00	0.11
29	600938	中国海油	37,600	788,472.00	0.11
30	600887	伊利股份	29,400	786,450.00	0.11
31	002027	分众传媒	121,300	766,616.00	0.11
32	600309	万华化学	9,800	752,836.00	0.10
33	002230	科大讯飞	14,300	663,234.00	0.09
34	601166	兴业银行	39,400	638,674.00	0.09
35	600886	国投电力	47,800	630,004.00	0.09

36	000100	TCL 科技	144,700	622,210.00	0.09
37	000568	泸州老窖	3,400	610,028.00	0.08
38	000625	长安汽车	35,800	602,514.00	0.08
39	688111	金山办公	1,897	599,831.40	0.08
40	603501	韦尔股份	5,600	597,576.00	0.08
41	600795	国电电力	143,100	595,296.00	0.08
42	601888	中国中免	7,000	585,830.00	0.08
43	600690	海尔智家	27,300	573,300.00	0.08
44	600011	华能国际	70,600	543,620.00	0.08
45	600674	川投能源	35,800	541,296.00	0.07
46	600030	中信证券	26,500	539,805.00	0.07
47	000938	紫光股份	27,500	532,125.00	0.07
48	600809	山西汾酒	2,300	530,679.00	0.07
49	688012	中微半导体设备	3,400	522,240.00	0.07
50	002714	牧原股份	12,600	518,868.00	0.07
51	688041	海光信息	7,300	518,154.00	0.07
52	300498	温氏股份	24,600	493,476.00	0.07
53	002371	北方华创	2,000	491,420.00	0.07
54	600188	兖矿能源	24,800	491,288.00	0.07
55	300059	东方财富	34,400	482,976.00	0.07
56	002050	三花智控	16,100	473,340.00	0.07
57	603986	兆易创新	5,100	471,189.00	0.07
58	601699	潞安环能	21,500	471,065.00	0.07
59	601138	工业富联	30,600	462,672.00	0.06
60	600104	上汽集团	33,700	455,961.00	0.06
61	601398	工商银行	95,000	454,100.00	0.06
62	000792	盐湖股份	28,400	452,980.00	0.06
63	600660	福耀玻璃	11,500	429,985.00	0.06
64	601328	交通银行	74,500	427,630.00	0.06
65	300015	爱尔眼科	26,600	420,812.00	0.06
66	300502	新易盛	8,500	419,220.00	0.06
67	300122	智飞生物	6,800	415,548.00	0.06
68	600436	片仔癀	1,700	411,383.00	0.06
69	688008	澜起科技	7,000	411,320.00	0.06
70	300782	卓胜微	2,900	408,900.00	0.06
71	000983	山西焦煤	40,800	403,104.00	0.06
72	003816	中国广核	126,200	392,482.00	0.05
73	002241	歌尔股份	18,500	388,685.00	0.05
74	300418	昆仑万维	10,200	381,480.00	0.05
75	601012	隆基绿能	16,020	366,858.00	0.05
76	000723	美锦能源	54,400	362,304.00	0.05
77	300124	汇川技术	5,700	359,898.00	0.05

78	603019	中科曙光	9,000	355,410.00	0.05
79	002049	紫光国微	5,200	350,740.00	0.05
80	002555	三七互娱	18,600	349,866.00	0.05
81	688036	传音控股	2,500	346,000.00	0.05
82	600570	恒生电子	11,700	336,492.00	0.05
83	600919	江苏银行	49,700	332,493.00	0.05
84	688271	联影医疗	2,400	328,824.00	0.05
85	600584	长电科技	11,000	328,460.00	0.05
86	601816	京沪高铁	65,000	319,800.00	0.04
87	601898	中煤能源	32,900	318,801.00	0.04
88	600348	华阳股份	32,400	316,224.00	0.04
89	601288	农业银行	86,500	314,860.00	0.04
90	600546	山煤国际	17,800	311,678.00	0.04
91	002353	杰瑞股份	11,000	309,210.00	0.04
92	002304	洋河股份	2,800	307,720.00	0.04
93	300408	三环集团	10,300	303,335.00	0.04
94	300394	天孚通信	3,300	302,016.00	0.04
95	002466	天齐锂业	5,400	301,266.00	0.04
96	600023	浙能电力	64,500	297,345.00	0.04
97	600985	淮北矿业	17,800	296,014.00	0.04
98	603288	海天味业	7,700	292,215.00	0.04
99	601666	平煤股份	25,000	289,000.00	0.04
100	002517	恺英网络	25,800	288,186.00	0.04
101	600745	闻泰科技	6,700	283,477.00	0.04
102	600585	海螺水泥	12,500	282,000.00	0.04
103	600588	用友网络	15,800	281,082.00	0.04
104	002236	大华股份	15,200	280,440.00	0.04
105	600019	宝钢股份	46,200	273,966.00	0.04
106	600845	宝信软件	5,500	268,400.00	0.04
107	002465	海格通信	20,800	267,280.00	0.04
108	601668	中国建筑	55,500	266,955.00	0.04
109	300033	同花顺	1,700	266,679.00	0.04
110	000703	恒逸石化	39,500	265,440.00	0.04
111	002352	顺丰控股	6,500	262,600.00	0.04
112	000661	长春高新	1,800	262,440.00	0.04
113	000977	浪潮信息	7,900	262,280.00	0.04
114	002920	德赛西威	2,000	259,020.00	0.04
115	600111	北方稀土	13,200	255,288.00	0.04
116	002460	赣锋锂业	5,900	252,520.00	0.03
117	600642	申能股份	39,300	252,306.00	0.03
118	600016	民生银行	67,300	251,702.00	0.03
119	000538	云南白药	5,100	250,665.00	0.03
120	600803	新奥股份	14,900	250,618.00	0.03

121	600025	华能水电	28,900	249,407.00	0.03
122	601360	三六零	27,500	247,775.00	0.03
123	000001	平安银行	26,300	246,957.00	0.03
124	600837	海通证券	26,200	245,494.00	0.03
125	300274	阳光电源	2,800	245,252.00	0.03
126	000591	太阳能	43,900	244,962.00	0.03
127	002252	上海莱士	30,300	242,400.00	0.03
128	002739	万达电影	18,300	238,266.00	0.03
129	600406	国电南瑞	10,600	236,592.00	0.03
130	600583	海油工程	39,700	235,818.00	0.03
131	601689	拓普集团	3,200	235,200.00	0.03
132	603799	华友钴业	7,100	233,803.00	0.03
133	601600	中国铝业	41,400	233,496.00	0.03
134	000988	华工科技	7,800	232,128.00	0.03
135	688256	寒武纪科技	1,700	229,432.00	0.03
136	300017	网宿科技	29,200	229,220.00	0.03
137	002463	沪电股份	10,300	227,836.00	0.03
138	601988	中国银行	57,100	227,829.00	0.03
139	300413	芒果超媒	9,000	226,800.00	0.03
140	601633	长城汽车	8,900	224,458.00	0.03
141	300496	中科创达	2,800	224,168.00	0.03
142	300661	圣邦股份	2,500	222,525.00	0.03
143	601601	中国太保	9,300	221,154.00	0.03
144	688126	上海硅产业集团	12,700	219,964.00	0.03
145	300142	沃森生物	9,200	216,292.00	0.03
146	600031	三一重工	15,700	216,189.00	0.03
147	600426	华鲁恒升	7,800	215,202.00	0.03
148	002142	宁波银行	10,700	215,177.00	0.03
149	600547	山东黄金	9,400	214,978.00	0.03
150	300058	蓝色光标	29,800	213,964.00	0.03
151	601058	赛轮轮胎	18,000	211,500.00	0.03
152	002195	岩山科技	68,700	210,909.00	0.03
153	600000	浦发银行	31,800	210,516.00	0.03
154	600085	同仁堂	3,900	209,430.00	0.03
155	000963	华东医药	5,000	207,300.00	0.03
156	600863	内蒙华电	52,400	204,360.00	0.03
157	300433	蓝思科技	15,400	203,280.00	0.03
157	301236	软通动力	4,400	203,280.00	0.03
159	000338	潍柴动力	14,400	196,560.00	0.03
160	601688	华泰证券	14,000	195,300.00	0.03
161	002422	科伦药业	6,700	194,635.00	0.03



162	600048	保利发展	19,500	193,050.00	0.03
163	002624	完美世界	16,300	192,992.00	0.03
164	000002	万科A	18,400	192,464.00	0.03
165	603993	洛阳钼业	36,900	191,880.00	0.03
166	600021	上海电力	22,600	191,196.00	0.03
167	002384	东山精密	10,500	190,890.00	0.03
168	600008	首创环保	70,700	190,183.00	0.03
169	002156	通富微电	8,200	189,584.00	0.03
170	688396	华润微电子	4,203	187,832.07	0.03
171	601016	节能风电	62,300	186,900.00	0.03
172	000596	古井贡酒	800	186,240.00	0.03
173	600741	华域汽车	11,400	185,592.00	0.03
174	688072	拓荆科技	800	185,040.00	0.03
175	600637	东方明珠	24,600	184,992.00	0.03
176	002558	巨人网络	16,600	184,924.00	0.03
177	600089	特变电工	13,400	184,920.00	0.03
178	002131	利欧股份	81,100	184,908.00	0.03
179	603000	人民网	6,600	184,668.00	0.03
180	600196	复星医药	7,300	182,719.00	0.03
181	601169	北京银行	40,100	181,653.00	0.03
182	601211	国泰君安	12,200	181,536.00	0.03
183	300628	亿联网络	6,100	180,255.00	0.02
184	600438	通威股份	7,200	180,216.00	0.02
185	301269	华大九天	1,700	179,945.00	0.02
186	300136	信维通信	7,500	177,000.00	0.02
187	300896	爱美客	600	176,598.00	0.02
188	002410	广联达	10,300	176,542.00	0.02
189	000733	振华科技	3,000	176,520.00	0.02
190	603712	七一二	5,600	176,456.00	0.02
191	600150	中国船舶	5,900	173,696.00	0.02
192	002180	纳思达	7,600	171,988.00	0.02
193	002311	海大集团	3,800	170,658.00	0.02
194	600989	宝丰能源	11,500	169,855.00	0.02
195	688169	石头科技	600	169,770.00	0.02
196	601766	中国中车	32,200	169,372.00	0.02
197	002185	华天科技	19,800	168,696.00	0.02
198	002138	顺络电子	6,200	167,462.00	0.02
199	600536	中国软件	4,600	166,796.00	0.02
200	600183	生益科技	9,100	166,621.00	0.02
201	603392	万泰生物	2,200	165,286.00	0.02
202	300347	泰格医药	3,000	164,910.00	0.02
203	002493	荣盛石化	15,900	164,565.00	0.02

204	300212	易华录	5,200	163,540.00	0.02
205	000598	兴蓉环境	28,700	163,303.00	0.02
206	688099	晶晨半导体	2,600	162,838.00	0.02
207	002821	凯莱英	1,400	162,540.00	0.02
208	601919	中远海控	16,900	161,902.00	0.02
209	600079	人福医药	6,500	161,590.00	0.02
210	601229	上海银行	27,000	161,190.00	0.02
211	601778	晶科科技	45,800	160,300.00	0.02
212	002439	启明星辰	5,800	156,600.00	0.02
213	601808	中海油服	10,600	154,972.00	0.02
214	601390	中国中铁	27,200	154,496.00	0.02
215	603596	伯特利	2,200	152,460.00	0.02
216	600995	南网储能	15,400	151,844.00	0.02
217	000975	银泰黄金	10,100	151,500.00	0.02
218	600489	中金黄金	15,200	151,392.00	0.02
219	000066	中国长城	14,900	150,788.00	0.02
220	688120	华海清科	800	150,160.00	0.02
221	002001	新和成	8,800	149,248.00	0.02
222	300144	宋城演艺	15,100	149,037.00	0.02
223	002601	龙佰集团	8,700	149,031.00	0.02
224	300474	景嘉微	2,100	148,491.00	0.02
225	300759	康龙化成	5,100	147,798.00	0.02
226	000027	深圳能源	22,900	147,705.00	0.02
227	002841	视源股份	3,200	146,432.00	0.02
228	600460	士兰微	6,400	146,112.00	0.02
229	002600	领益智造	21,600	146,016.00	0.02
230	601818	光大银行	50,300	145,870.00	0.02
231	600161	天坛生物	4,700	145,418.00	0.02
232	603160	汇顶科技	2,100	145,110.00	0.02
233	002273	水晶光电	10,700	144,878.00	0.02
234	600346	恒力石化	11,000	144,870.00	0.02
235	601991	大唐发电	59,700	144,474.00	0.02
236	300251	光线传媒	17,600	143,440.00	0.02
237	300285	国瓷材料	6,200	143,344.00	0.02
238	300223	北京君正	2,200	142,230.00	0.02
239	300866	安克创新	1,600	141,760.00	0.02
240	600498	烽火通信	8,500	141,440.00	0.02
241	603369	今世缘	2,900	141,375.00	0.02
242	601168	西部矿业	9,900	141,273.00	0.02
243	600839	四川长虹	26,600	140,714.00	0.02
244	601238	广汽集团	16,000	140,000.00	0.02
245	002007	华兰生物	6,300	139,419.00	0.02

246	600999	招商证券	10,100	137,764.00	0.02
247	000933	神火股份	8,200	137,760.00	0.02
248	300454	深信服	1,900	137,351.00	0.02
249	002281	光迅科技	4,800	136,800.00	0.02
250	000937	冀中能源	19,100	136,374.00	0.02
251	300014	亿纬锂能	3,200	135,040.00	0.02
252	002129	TCL 中环	8,600	134,504.00	0.02
253	600871	石化油服	73,200	133,956.00	0.02
254	688052	纳芯微电子	800	133,480.00	0.02
255	601233	桐昆股份	8,800	133,144.00	0.02
256	000883	湖北能源	31,400	132,822.00	0.02
257	000301	东方盛虹	13,800	132,480.00	0.02
258	601698	中国卫通	7,600	131,556.00	0.02
259	601799	星宇股份	1,000	131,110.00	0.02
260	600177	雅戈尔	20,000	131,000.00	0.02
261	601658	邮储银行	30,100	130,935.00	0.02
262	600893	航发动力	3,500	130,830.00	0.02
263	000630	铜陵有色	39,700	130,216.00	0.02
264	688301	奕瑞科技股份	400	130,104.00	0.02
265	002648	卫星化学	8,800	129,800.00	0.02
266	300604	长川科技	3,400	129,166.00	0.02
267	000423	东阿阿胶	2,600	128,232.00	0.02
268	000895	双汇发展	4,800	128,208.00	0.02
269	688122	西部超导	2,400	127,752.00	0.02
270	601628	中国人寿	4,500	127,575.00	0.02
271	600699	均胜电子	7,100	127,516.00	0.02
272	002472	双环传动	4,900	127,498.00	0.02
273	002607	中公教育	31,100	126,888.00	0.02
274	603290	斯达半导	700	126,700.00	0.02
275	300088	长信科技	18,900	126,441.00	0.02
276	603816	顾家家居	3,600	126,000.00	0.02
277	000997	新大陆	6,400	125,504.00	0.02
278	601989	中国重工	30,200	124,726.00	0.02
279	600176	中国巨石	12,500	122,875.00	0.02
280	688728	格科微有限公司	6,000	122,820.00	0.02
281	002409	雅克科技	2,200	122,606.00	0.02
282	603444	吉比特	500	122,560.00	0.02
283	600760	中航沈飞	2,900	122,322.00	0.02
284	600988	赤峰黄金	8,700	121,887.00	0.02
285	300003	乐普医疗	7,500	121,200.00	0.02

286	688002	睿创微纳	2,736	120,985.92	0.02
287	002938	鹏鼎控股	5,400	120,528.00	0.02
288	688220	翱捷科技	1,700	119,748.00	0.02
289	600600	青岛啤酒	1,600	119,600.00	0.02
290	601939	建设银行	18,200	118,482.00	0.02
291	002152	广电运通	9,600	117,696.00	0.02
292	002223	鱼跃医疗	3,400	117,572.00	0.02
293	601006	大秦铁路	16,300	117,523.00	0.02
294	600060	海信视像	5,600	117,040.00	0.02
295	000021	深科技	7,200	116,712.00	0.02
296	603939	益丰药房	2,900	116,116.00	0.02
297	600160	巨化股份	7,000	115,430.00	0.02
298	605358	立昂微	4,200	115,038.00	0.02
299	688521	芯原微电子	2,300	114,908.00	0.02
300	600332	白云山	4,000	114,400.00	0.02
301	000999	华润三九	2,300	114,379.00	0.02
302	600352	浙江龙盛	13,600	114,240.00	0.02
303	002916	深南电路	1,600	113,584.00	0.02
304	600959	江苏有线	36,000	113,040.00	0.02
305	688180	君实生物	2,700	112,941.00	0.02
306	002738	中矿资源	3,000	111,930.00	0.02
307	601669	中国电建	22,800	111,492.00	0.02
308	000932	华菱钢铁	21,600	111,240.00	0.02
309	002603	以岭药业	4,800	110,736.00	0.02
310	600977	中国电影	9,000	110,160.00	0.02
311	601377	兴业证券	18,700	109,769.00	0.02
312	002179	中航光电	2,800	109,200.00	0.02
313	600131	国网信通	7,200	109,080.00	0.02
314	000166	申万宏源	24,400	108,336.00	0.02
315	600009	上海机场	3,300	108,174.00	0.01
316	600219	南山铝业	36,700	107,898.00	0.01
317	300383	光环新网	11,100	107,892.00	0.01
318	002044	美年健康	17,900	107,579.00	0.01
319	002078	太阳纸业	8,800	107,096.00	0.01
320	601607	上海医药	6,400	107,072.00	0.01
321	600373	中文传媒	8,100	106,758.00	0.01
322	002065	东华软件	17,300	106,741.00	0.01
323	600096	云天化	6,700	104,520.00	0.01
324	002294	信立泰	3,200	104,512.00	0.01
325	002756	永兴材料	2,000	104,420.00	0.01
326	600968	海油发展	36,600	104,310.00	0.01
327	000408	藏格矿业	4,100	103,894.00	0.01

328	601009	南京银行	14,000	103,320.00	0.01
329	002268	电科网安	4,600	103,316.00	0.01
330	688114	华大智造	1,200	103,224.00	0.01
331	300601	康泰生物	3,800	103,170.00	0.01
332	601916	浙商银行	40,900	103,068.00	0.01
333	000425	徐工机械	18,800	102,648.00	0.01
334	001286	陕西能源	12,000	102,600.00	0.01
335	688536	思瑞浦股份	700	102,410.00	0.01
336	600129	太极集团	2,200	102,212.00	0.01
337	002532	天山铝业	17,000	102,170.00	0.01
338	601966	玲珑轮胎	5,300	101,919.00	0.01
339	002271	东方雨虹	5,300	101,760.00	0.01
340	000050	深天马 A	9,500	101,175.00	0.01
341	605117	德业股份	1,200	100,680.00	0.01
342	002368	太极股份	3,400	100,402.00	0.01
343	603882	金城医学	1,600	100,112.00	0.01
344	300395	菲利华	2,700	98,712.00	0.01
345	600754	锦江酒店	3,300	98,670.00	0.01
346	600298	安琪酵母	2,800	98,504.00	0.01
347	000876	新希望	10,500	97,860.00	0.01
348	601717	郑煤机	7,700	97,405.00	0.01
349	600529	山东药玻	3,800	97,280.00	0.01
350	600015	华夏银行	17,300	97,226.00	0.01
351	000636	风华高科	7,100	96,986.00	0.01
352	000967	盈峰环境	20,400	96,900.00	0.01
352	603260	合盛硅业	1,900	96,900.00	0.01
354	600362	江西铜业	5,400	96,444.00	0.01
355	600926	杭州银行	9,600	96,096.00	0.01
356	603195	公牛集团	1,000	95,650.00	0.01
357	002373	千方科技	8,500	95,285.00	0.01
358	689009	九号公司	3,200	94,912.00	0.01
359	300253	卫宁健康	13,200	94,908.00	0.01
360	600497	驰宏锌锗	18,600	93,930.00	0.01
361	300296	利亚德	15,600	93,600.00	0.01
362	300999	金龙鱼	2,800	93,464.00	0.01
363	001979	招商蛇口	9,800	93,394.00	0.01
364	601186	中国铁建	12,200	92,842.00	0.01
365	600563	法拉电子	1,000	92,600.00	0.01
366	002262	恩华药业	3,400	92,208.00	0.01
367	600398	海澜之家	12,400	92,008.00	0.01
368	300373	扬杰科技	2,500	91,750.00	0.01
369	600271	航天信息	8,600	91,504.00	0.01

370	601995	中金公司	2,400	91,320.00	0.01
371	000831	中国稀土	3,300	91,311.00	0.01
372	600339	中油工程	30,100	91,203.00	0.01
373	002385	大北农	15,300	91,188.00	0.01
374	002459	晶澳科技	4,400	91,168.00	0.01
375	600859	王府井	5,700	91,029.00	0.01
376	002429	兆驰股份	16,300	90,954.00	0.01
377	002812	恩捷股份	1,600	90,912.00	0.01
378	600873	梅花生物	9,500	90,725.00	0.01
379	603833	欧派家居	1,300	90,493.00	0.01
380	601111	中国国航	12,300	90,282.00	0.01
381	601901	方正证券	11,200	90,272.00	0.01
382	000893	亚钾国际	3,400	89,216.00	0.01
383	688561	奇安信集团	2,200	88,198.00	0.01
384	600115	中国东航	22,700	88,076.00	0.01
385	601098	中南传媒	8,600	87,462.00	0.01
386	600655	豫园股份	14,000	86,940.00	0.01
387	600535	天士力	5,100	86,802.00	0.01
388	000537	中绿电	9,000	86,670.00	0.01
389	600867	通化东宝	8,000	86,640.00	0.01
390	688200	华峰测控	700	85,960.00	0.01
391	688234	天岳先进	1,300	85,891.00	0.01
392	688599	天合光能	3,000	85,590.00	0.01
393	000157	中联重科	13,100	85,543.00	0.01
394	688385	复旦微电	2,200	84,986.00	0.01
395	300682	朗新科技	5,100	83,589.00	0.01
396	688082	盛美上海 半导体	800	83,528.00	0.01
397	002028	思源电气	1,600	83,264.00	0.01
398	002432	九安医疗	2,200	82,874.00	0.01
399	601066	中信建投	3,500	82,810.00	0.01
400	000768	中航西飞	3,700	82,769.00	0.01
401	603893	瑞芯微	1,300	82,420.00	0.01
402	600029	南方航空	14,300	82,368.00	0.01
403	600486	扬农化工	1,300	82,056.00	0.01
404	000156	华数传媒	11,100	81,807.00	0.01
405	601788	光大证券	5,300	81,726.00	0.01
406	601928	凤凰传媒	9,200	81,052.00	0.01
407	603927	中科软	2,700	80,946.00	0.01
408	000683	远兴能源	13,710	80,477.70	0.01
409	000623	吉林敖东	5,300	80,242.00	0.01
410	300146	汤臣倍健	4,700	80,041.00	0.01

411	300699	光威复材	3,000	80,010.00	0.01
412	000629	钒钛股份	24,300	79,704.00	0.01
412	600399	抚顺特钢	8,200	79,704.00	0.01
414	601555	东吴证券	10,900	79,679.00	0.01
415	000878	云南铜业	7,300	79,497.00	0.01
415	002608	江苏国信	12,100	79,497.00	0.01
417	002497	雅化集团	6,000	78,540.00	0.01
418	600143	金发科技	9,800	78,302.00	0.01
419	603688	石英股份	900	78,192.00	0.01
420	600998	九州通	11,100	77,811.00	0.01
421	688538	和辉光电	32,000	77,760.00	0.01
422	002709	天赐材料	3,100	77,748.00	0.01
423	002240	盛新锂能	3,400	77,350.00	0.01
424	601231	环旭电子	5,100	77,061.00	0.01
425	600516	方大炭素	14,700	77,028.00	0.01
426	603589	口子窖	1,700	77,010.00	0.01
427	601100	恒立液压	1,400	76,552.00	0.01
428	603077	和邦生物	32,300	76,228.00	0.01
429	002407	多氟多	5,000	76,100.00	0.01
430	002430	杭氧股份	2,600	75,946.00	0.01
431	600549	厦门钨业	4,400	75,592.00	0.01
432	603456	九洲药业	3,100	75,051.00	0.01
433	600258	首旅酒店	4,800	74,976.00	0.01
434	300316	晶盛机电	1,700	74,953.00	0.01
435	600925	苏能股份	13,600	74,936.00	0.01
436	600707	彩虹股份	11,100	74,925.00	0.01
437	600141	兴发集团	4,100	74,825.00	0.01
438	600521	华海药业	5,100	74,817.00	0.01
439	000960	锡业股份	5,200	74,464.00	0.01
440	000708	中信特钢	5,300	74,412.00	0.01
441	600392	盛和资源	7,300	74,314.00	0.01
442	600418	江淮汽车	4,600	74,290.00	0.01
443	002340	格林美	13,600	74,256.00	0.01
444	300450	先导智能	2,900	74,240.00	0.01
445	603658	安图生物	1,300	74,113.00	0.01
446	002508	老板电器	3,400	74,052.00	0.01
447	601933	永辉超市	26,100	73,602.00	0.01
448	000513	丽珠集团	2,100	73,521.00	0.01
449	002572	索菲亚	4,600	73,370.00	0.01
450	600132	重庆啤酒	1,100	73,095.00	0.01
451	605499	东鹏饮料	400	73,004.00	0.01
452	300748	金力永磁	3,600	72,792.00	0.01
453	300558	贝达药业	1,400	72,170.00	0.01

454	601868	中国能建	34,300	72,030.00	0.01
455	600739	辽宁成大	6,100	71,858.00	0.01
456	601336	新华保险	2,300	71,599.00	0.01
457	688065	凯赛生物	1,300	71,474.00	0.01
458	601800	中国交建	9,400	71,440.00	0.01
459	601881	中国银河	5,900	71,095.00	0.01
460	003031	中瓷电子	800	70,584.00	0.01
461	000887	中鼎股份	5,700	70,509.00	0.01
462	603486	科沃斯	1,700	70,448.00	0.01
463	300595	欧普康视	3,100	69,998.00	0.01
464	000539	粤电力A	14,300	69,927.00	0.01
465	002064	华峰化学	10,400	69,784.00	0.01
466	002203	海亮股份	6,200	69,130.00	0.01
467	000998	隆平高科	4,900	69,090.00	0.01
468	300244	迪安诊断	2,900	69,049.00	0.01
469	300487	蓝晓科技	1,300	68,978.00	0.01
470	600673	东阳光	9,400	68,902.00	0.01
471	600515	海南机场	18,600	68,820.00	0.01
472	601077	渝农商行	16,800	68,544.00	0.01
473	300009	安科生物	6,700	68,474.00	0.01
474	601108	财通证券	8,800	68,288.00	0.01
475	600372	中航机载	5,100	67,218.00	0.01
476	300676	华大基因	1,400	67,200.00	0.01
477	002128	电投能源	4,700	67,069.00	0.01
478	688363	华熙生物	1,000	66,930.00	0.01
479	002736	国信证券	7,800	66,612.00	0.01
480	300037	新宙邦	1,400	66,220.00	0.01
481	600566	济川药业	2,100	66,003.00	0.01
482	002092	中泰化学	10,800	65,880.00	0.01
483	600380	健康元	5,300	65,879.00	0.01
484	601216	君正集团	17,600	65,824.00	0.01
485	601021	春秋航空	1,300	65,260.00	0.01
485	603267	鸿远电子	1,300	65,260.00	0.01
487	603233	大参林	2,600	64,740.00	0.01
488	000009	中国宝安	5,500	64,570.00	0.01
489	600109	国金证券	7,100	64,468.00	0.01
490	002966	苏州银行	9,900	63,954.00	0.01
491	300012	华测检测	4,500	63,900.00	0.01
492	002032	苏泊尔	1,200	63,612.00	0.01
493	601139	深圳燃气	9,200	63,388.00	0.01
494	300888	稳健医疗	1,700	63,325.00	0.01
495	000786	北新建材	2,700	63,072.00	0.01
496	600511	国药股份	2,200	62,964.00	0.01



497	300529	健帆生物	2,800	62,244.00	0.01
498	002019	亿帆医药	4,200	62,076.00	0.01
499	688331	荣昌生物	1,000	62,060.00	0.01
500	601117	中国化学	9,700	61,692.00	0.01
501	002153	石基信息	6,300	61,362.00	0.01
502	600885	宏发股份	2,200	60,808.00	0.01
503	300677	英科医疗	2,600	60,736.00	0.01
504	601877	正泰电器	2,800	60,228.00	0.01
505	002074	国轩高科	2,800	60,200.00	0.01
506	601615	明阳智能	4,800	60,192.00	0.01
507	000830	鲁西化工	6,000	60,180.00	0.01
508	000877	天山股份	9,000	60,120.00	0.01
509	002192	融捷股份	1,100	59,631.00	0.01
510	600282	南钢股份	16,100	59,570.00	0.01
511	000060	中金岭南	13,700	59,184.00	0.01
512	688387	中信科移动	8,200	59,122.00	0.01
513	002625	光启技术	4,000	59,120.00	0.01
514	002568	百润股份	2,400	59,064.00	0.01
515	603228	景旺电子	2,600	58,656.00	0.01
516	601838	成都银行	5,200	58,552.00	0.01
517	002299	圣农发展	3,400	58,412.00	0.01
518	002202	金风科技	7,300	58,400.00	0.01
519	601162	天风证券	18,800	58,092.00	0.01
520	300026	红日药业	13,700	58,088.00	0.01
521	688029	南微医学科技	600	58,080.00	0.01
522	300979	华利集团	1,100	57,904.00	0.01
523	601618	中国中冶	18,900	57,834.00	0.01
524	300207	欣旺达	3,900	57,564.00	0.01
525	601636	旗滨集团	8,400	57,456.00	0.01
526	603225	新风鸣	4,000	56,800.00	0.01
527	600233	圆通速递	4,600	56,534.00	0.01
528	000783	长江证券	10,500	56,490.00	0.01
529	000729	燕京啤酒	6,500	56,095.00	0.01
530	002080	中材科技	3,500	55,720.00	0.01
531	601878	浙商证券	5,300	55,279.00	0.01
532	600827	百联股份	5,800	55,042.00	0.01
533	300957	贝泰妮	800	54,536.00	0.01
534	000581	威孚高科	3,600	54,252.00	0.01
535	002030	达安基因	5,600	54,208.00	0.01
536	600329	达仁堂	1,600	53,840.00	0.01
537	600415	小商品城	7,300	53,436.00	0.01

538	603858	步长制药	3,139	53,394.39	0.01
539	603305	旭升集团	2,700	53,271.00	0.01
540	002507	涪陵榨菜	3,700	52,873.00	0.01
541	002797	第一创业	9,100	52,871.00	0.01
542	000970	中科三环	5,100	52,785.00	0.01
543	300568	星源材质	3,400	52,428.00	0.01
544	603737	三棵树	1,100	52,371.00	0.01
545	000739	普洛药业	3,400	52,326.00	0.01
546	002831	裕同科技	1,900	52,269.00	0.01
547	688390	固德威电 源	400	52,232.00	0.01
548	600482	中国动力	2,900	52,229.00	0.01
549	300357	我武生物	1,800	52,200.00	0.01
550	601158	重庆水务	9,200	52,164.00	0.01
551	603127	昭衍新药	2,200	52,162.00	0.01
552	600918	中泰证券	7,600	52,136.00	0.01
553	300724	捷佳伟创	700	51,807.00	0.01
554	300751	迈为股份	400	51,804.00	0.01
555	600765	中航重机	2,700	51,597.00	0.01
556	600732	爱旭股份	2,900	51,156.00	0.01
557	600155	华创云信	6,100	50,874.00	0.01
558	603883	老百姓	1,700	50,813.00	0.01
559	688188	上海柏楚 电子科技	200	50,622.00	0.01
560	601872	招商轮船	8,600	50,568.00	0.01
561	688303	大全能源	1,700	50,269.00	0.01
562	000559	万向钱潮	9,500	49,305.00	0.01
563	002155	湖南黄金	4,400	49,016.00	0.01
564	603156	养元饮品	2,300	48,898.00	0.01
565	002557	洽洽食品	1,400	48,748.00	0.01
566	600862	中航高科	2,200	48,730.00	0.01
567	002867	周大生	3,200	48,576.00	0.01
568	603806	福斯特	2,000	48,540.00	0.01
569	000728	国元证券	7,100	48,493.00	0.01
570	688520	神州细胞 集团公司	900	48,483.00	0.01
571	601958	金铂股份	5,100	48,195.00	0.01
572	603659	璞泰来	2,300	48,139.00	0.01
573	600056	中国医药	4,300	48,031.00	0.01
574	601990	南京证券	6,000	47,880.00	0.01
575	688107	安路科技	1,300	47,814.00	0.01
576	300363	博腾股份	1,900	47,785.00	0.01
577	000778	新兴铸管	12,500	47,750.00	0.01

578	603529	爱玛科技	1,900	47,576.00	0.01
579	001289	龙源电力	2,400	47,544.00	0.01
580	601128	常熟银行	7,400	47,286.00	0.01
581	600061	国投资本	7,000	47,180.00	0.01
582	603606	东方电缆	1,100	47,025.00	0.01
583	688223	晶科能源	5,300	46,958.00	0.01
584	002925	盈趣科技	2,400	46,728.00	0.01
585	002673	西部证券	7,300	46,501.00	0.01
586	600066	宇通客车	3,500	46,375.00	0.01
587	600956	新天绿能	5,700	46,341.00	0.01
588	601696	中银证券	4,500	46,305.00	0.01
589	002683	广东宏大	2,300	46,184.00	0.01
590	000709	河钢股份	21,600	46,008.00	0.01
591	603517	绝味食品	1,700	45,662.00	0.01
592	002008	大族激光	2,200	45,584.00	0.01
593	600062	华润双鹤	2,400	44,640.00	0.01
594	000825	太钢不锈	11,900	44,387.00	0.01
595	601577	长沙银行	6,500	44,330.00	0.01
596	300919	中伟股份	900	44,217.00	0.01
597	603379	三美股份	1,300	44,200.00	0.01
598	600369	西南证券	10,800	44,172.00	0.01
599	002326	永太科技	3,800	44,156.00	0.01
600	002653	海思科	1,900	43,985.00	0.01
601	601998	中信银行	8,300	43,907.00	0.01
602	688276	长春百克 生物科技	800	43,848.00	0.01
603	600801	华新水泥	3,500	43,505.00	0.01
604	603650	彤程新材	1,300	43,290.00	0.01
605	600499	科达制造	4,100	43,255.00	0.01
606	603786	科博达	600	42,816.00	0.01
607	002444	巨星科技	1,900	42,788.00	0.01
608	600378	昊华科技	1,400	42,672.00	0.01
609	600875	东方电气	2,900	42,398.00	0.01
610	300118	东方日升	2,400	42,360.00	0.01
611	601319	中国人保	8,700	42,108.00	0.01
612	300073	当升科技	1,100	42,020.00	0.01
613	603707	健友股份	2,800	42,000.00	0.01
614	300763	锦浪科技	600	41,940.00	0.01
615	000400	许继电气	1,900	41,724.00	0.01
616	601992	金隅集团	21,800	41,638.00	0.01
617	600500	中化国际	9,400	41,548.00	0.01
618	000069	华侨城 A	13,300	41,363.00	0.01
619	603826	坤彩科技	700	41,321.00	0.01

620	600118	中国卫星	1,600	41,312.00	0.01
621	600884	杉杉股份	3,000	40,860.00	0.01
622	601997	贵阳银行	7,900	40,606.00	0.01
623	300390	天华新能	1,600	40,560.00	0.01
624	600895	张江高科	2,100	40,530.00	0.01
625	600737	中粮糖业	4,900	40,376.00	0.01
626	300001	特锐德	2,000	40,200.00	0.01
627	600879	航天电子	5,200	40,092.00	0.01
628	601865	福莱特	1,500	40,050.00	0.01
629	600416	湘电股份	2,500	39,700.00	0.01
630	688772	珠海冠宇 电池	1,800	39,618.00	0.01
631	600598	北大荒	3,300	39,501.00	0.01
632	688153	唯捷创芯	600	39,300.00	0.01
633	300024	机器人	3,300	39,171.00	0.01
634	002408	齐翔腾达	7,400	39,072.00	0.01
635	600170	上海建工	16,500	38,610.00	0.01
636	600153	建发股份	4,000	38,520.00	0.01
637	003022	联泓新科	2,100	38,451.00	0.01
638	603899	晨光股份	1,000	37,550.00	0.01
639	000039	中集集团	4,900	37,485.00	0.01
640	600126	杭钢股份	7,000	37,310.00	0.01
641	000617	中油资本	6,900	37,260.00	0.01
642	600909	华安证券	7,600	37,088.00	0.01
643	002511	中顺洁柔	3,700	37,000.00	0.01
644	000750	国海证券	10,400	36,816.00	0.01
645	600704	物产中大	8,200	36,326.00	0.01
646	600018	上港集团	7,400	36,260.00	0.01
647	688516	奥特维科 技	400	36,200.00	0.01
648	603338	浙江鼎力	700	35,819.00	0.00
649	688690	纳微科技	1,300	35,646.00	0.00
650	002939	长城证券	4,400	35,200.00	0.00
651	000401	冀东水泥	5,500	35,145.00	0.00
652	300114	中航电测	800	35,000.00	0.00
653	601456	国联证券	3,200	34,688.00	0.00
654	600166	福田汽车	12,700	34,671.00	0.00
655	600039	四川路桥	4,600	34,454.00	0.00
656	600808	马钢股份	12,600	34,272.00	0.00
657	600315	上海家化	1,600	33,888.00	0.00
658	000738	航发控制	1,700	33,830.00	0.00
659	002850	科达利	400	33,784.00	0.00
660	002025	航天电器	700	33,614.00	0.00

661	002563	森马服饰	5,800	33,466.00	0.00
662	600820	隧道股份	5,800	33,408.00	0.00
663	002926	华西证券	4,300	33,368.00	0.00
664	600435	北方导航	2,800	32,872.00	0.00
665	002414	高德红外	4,500	32,850.00	0.00
666	002595	豪迈科技	1,100	32,747.00	0.00
667	688567	孚能科技	2,000	32,620.00	0.00
668	600325	华发股份	4,500	32,445.00	0.00
669	688005	容百科技	800	31,840.00	0.00
670	688063	派能科技	300	31,800.00	0.00
671	002500	山西证券	5,800	31,262.00	0.00
672	000898	鞍钢股份	12,500	31,125.00	0.00
673	002865	钧达股份	400	30,992.00	0.00
674	000519	中兵红箭	2,200	30,888.00	0.00
675	600038	中直股份	800	30,824.00	0.00
676	002936	郑州银行	15,300	30,753.00	0.00
677	002372	伟星新材	2,100	30,387.00	0.00
678	600004	白云机场	3,100	30,318.00	0.00
679	002056	横店东磁	2,200	29,788.00	0.00
680	601568	北元集团	6,200	29,388.00	0.00
681	688187	时代电气	800	29,064.00	0.00
682	300070	碧水源	5,800	28,942.00	0.00
683	601236	红塔证券	3,800	28,842.00	0.00
684	000930	中粮科技	4,300	28,552.00	0.00
685	600390	五矿资本	6,100	28,548.00	0.00
686	601155	新城控股	2,500	28,525.00	0.00
687	000547	航天发展	3,400	28,458.00	0.00
688	002120	韵达股份	3,800	28,348.00	0.00
689	603866	桃李面包	3,700	28,342.00	0.00
690	600032	浙江新能	3,500	28,210.00	0.00
691	600580	卧龙电驱	2,400	28,152.00	0.00
692	000959	首钢股份	8,100	28,026.00	0.00
693	600597	光明乳业	3,200	27,936.00	0.00
694	002531	天顺风能	2,400	27,840.00	0.00
695	603885	吉祥航空	2,300	27,600.00	0.00
696	002958	青农商行	10,500	27,510.00	0.00
697	601000	唐山港	7,800	27,300.00	0.00
698	603185	弘元绿能	800	26,624.00	0.00
699	601179	中国西电	5,400	26,622.00	0.00
700	002487	大金重工	1,000	26,620.00	0.00
701	000155	川能动力	2,000	26,580.00	0.00
702	600906	财达证券	3,500	26,250.00	0.00
703	600606	绿地控股	11,400	26,220.00	0.00

704	600970	中材国际	2,800	26,152.00	0.00
705	600848	上海临港	2,600	26,130.00	0.00
706	688105	诺唯赞生物	800	25,616.00	0.00
707	300438	鹏辉能源	900	25,461.00	0.00
708	600481	双良节能	3,000	25,380.00	0.00
709	000563	陕国投 A	8,300	25,232.00	0.00
710	600208	新湖中宝	11,500	24,955.00	0.00
711	002244	滨江集团	3,400	24,718.00	0.00
712	000987	越秀资本	4,100	24,682.00	0.00
713	002399	海普瑞	2,100	24,633.00	0.00
714	601866	中远海发	10,500	24,570.00	0.00
715	001203	大中矿业	2,400	24,408.00	0.00
716	600755	厦门国贸	3,500	24,395.00	0.00
717	688295	中复神鹰碳纤维	800	24,248.00	0.00
718	601665	齐鲁银行	6,200	24,242.00	0.00
719	300776	帝尔激光	400	24,104.00	0.00
720	600582	天地科技	4,400	23,936.00	0.00
721	002266	浙富控股	6,900	23,460.00	0.00
722	600316	洪都航空	1,100	23,287.00	0.00
723	603568	伟明环保	1,400	22,400.00	0.00
724	600901	江苏金租	4,600	22,264.00	0.00
725	601611	中国核建	3,200	22,176.00	0.00
726	000785	居然之家	6,700	22,110.00	0.00
727	601598	中国外运	4,200	22,008.00	0.00
728	600528	中铁工业	2,900	21,576.00	0.00
729	600517	国网英大	4,500	21,465.00	0.00
730	000800	一汽解放	2,500	21,250.00	0.00
731	003035	南网能源	4,000	21,040.00	0.00
732	601106	中国一重	7,300	21,024.00	0.00
733	001227	兰州银行	7,700	20,020.00	0.00
734	600764	中国海防	800	19,960.00	0.00
735	603317	天味食品	1,500	19,935.00	0.00
736	601156	东航物流	1,300	19,214.00	0.00
737	688208	道通科技	800	19,000.00	0.00
738	600967	内蒙一机	2,300	18,998.00	0.00
739	688779	长远锂科	2,600	18,980.00	0.00
740	603026	胜华新材	400	18,344.00	0.00
741	601187	厦门银行	3,600	18,252.00	0.00
742	601608	中信重工	4,600	17,756.00	0.00
743	002690	美亚光电	900	17,676.00	0.00
744	600663	陆家嘴	2,000	17,500.00	0.00

745	000089	深圳机场	2,700	17,361.00	0.00
746	000958	电投产融	4,400	17,336.00	0.00
746	300257	开山股份	1,100	17,336.00	0.00
748	603218	日月股份	1,400	17,318.00	0.00
749	600095	湘财股份	2,300	17,273.00	0.00
750	688349	三一重能	600	17,172.00	0.00
751	002010	传化智联	3,700	17,094.00	0.00
752	002423	中粮资本	2,500	16,700.00	0.00
753	688425	铁建重工	4,200	16,674.00	0.00
754	300861	美畅股份	500	16,645.00	0.00
755	002518	科士达	600	16,560.00	0.00
756	688006	浙江杭可科技	700	16,436.00	0.00
757	601059	信达证券	900	16,191.00	0.00
758	300850	新强联	500	15,915.00	0.00
759	688778	厦钨新能源	400	15,856.00	0.00
760	002468	申通快递	2,000	15,580.00	0.00
761	688297	中航无人机	400	15,332.00	0.00
762	600299	安迪苏	1,900	15,200.00	0.00
763	603868	飞科电器	300	15,150.00	0.00
764	002761	浙江建投	1,400	14,364.00	0.00
765	688819	天能电池集团股份	500	13,960.00	0.00
766	600377	宁沪高速	1,300	13,325.00	0.00
767	001914	招商积余	1,100	13,156.00	0.00
768	301029	怡合达	500	12,890.00	0.00
769	600927	永安期货	800	12,568.00	0.00
770	601228	广州港	4,000	12,520.00	0.00
771	600350	山东高速	1,800	12,492.00	0.00
772	002791	坚朗五金	300	12,147.00	0.00
773	600928	西安银行	3,600	11,988.00	0.00
774	601298	青岛港	1,900	11,742.00	0.00
775	000402	金融街	3,200	11,616.00	0.00
776	603056	德邦股份	800	11,576.00	0.00
777	002945	华林证券	700	10,570.00	0.00
778	000031	大悦城	3,500	10,395.00	0.00
779	601061	中信金属	1,300	10,023.00	0.00
780	001872	招商港口	600	9,576.00	0.00
781	688248	南方电网电力科技	200	4,994.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	7,665,262.00	1.06
2	600900	长江电力	6,614,523.00	0.92
3	002600	领益智造	3,939,782.00	0.55
4	601225	陕西煤业	3,895,384.00	0.54
5	600959	江苏有线	3,843,133.00	0.53
6	600028	中国石化	3,767,806.00	0.52
7	601601	中国太保	3,753,963.00	0.52
8	601088	中国神华	3,621,182.00	0.50
9	600489	中金黄金	3,458,218.00	0.48
10	000333	美的集团	3,421,233.50	0.47
11	600050	中国联通	3,250,678.00	0.45
12	600875	东方电气	3,233,523.00	0.45
13	300750	宁德时代	3,226,138.21	0.45
14	600019	宝钢股份	3,188,242.00	0.44
15	601138	工业富联	3,167,469.00	0.44
16	601857	中国石油	3,065,208.00	0.42
17	300760	迈瑞医疗	3,063,156.00	0.42
18	600893	航发动力	2,967,863.00	0.41
19	601216	君正集团	2,940,804.00	0.41
20	600406	国电南瑞	2,922,551.00	0.40

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002600	领益智造	4,113,830.00	0.57
2	600959	江苏有线	3,700,295.00	0.51
3	600489	中金黄金	3,183,432.00	0.44
4	601601	中国太保	3,173,407.00	0.44
5	600900	长江电力	3,148,045.00	0.44
6	600875	东方电气	3,133,386.00	0.43
7	603367	辰欣药业	2,997,567.00	0.42
8	600019	宝钢股份	2,906,724.00	0.40



9	000050	深天马 A	2,876,409.00	0.40
10	002465	海格通信	2,799,427.00	0.39
11	601216	君正集团	2,778,931.00	0.38
12	600893	航发动力	2,746,781.00	0.38
13	600623	华谊集团	2,716,278.52	0.38
14	601225	陕西煤业	2,699,579.00	0.37
15	601607	上海医药	2,672,609.00	0.37
16	002065	东华软件	2,642,875.00	0.37
17	603858	步长制药	2,626,597.00	0.36
18	000157	中联重科	2,620,550.00	0.36
19	002736	国信证券	2,605,108.00	0.36
20	600332	白云山	2,601,629.00	0.36

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	485,651,826.45
卖出股票收入（成交）总额	337,197,589.16

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	45,235,479.45	6.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	153,751,475.41	21.30
	其中：政策性金融债	153,751,475.41	21.30
4	企业债券	233,222,195.08	32.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	319,750,006.23	44.29
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	751,959,156.17	104.16

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	-------	------	----------

					例 (%)
1	200212	20 国开 12	1,000,000	103,110,491.80	14.28
2	220406	22 农发 06	500,000	50,640,983.61	7.01
3	102382310	23 浙资运营 MTN001(科创 票据)	500,000	50,514,672.13	7.00
4	019709	23 国债 16	450,000	45,235,479.45	6.27
5	102381107	23 广州地铁 MTN003	400,000	40,976,052.46	5.68

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 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。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,国家开发银行、中国农业发展银行、中信建投证券股份有限公司、国泰君安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。

#### 8.12.2

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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	422,786.84
2	应收清算款	2,166,036.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,002.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,589,825.38

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添富稳健回报债券 A	492	981,224.46	448,357,722.54	92.87	34,404,711.33	7.13
汇添富稳健回报债	2,731	88,856.22	2,000,180.00	0.82	240,666,160.18	99.18

券 C						
合计	3,223	225,078.74	450,357,902.54	62.08	275,070,871.51	37.92

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富稳健回报债券 A	498,480.47	0.10
	汇添富稳健回报债券 C	10,007.65	0.00
	合计	508,488.12	0.07

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	汇添富稳健回报债券 A	0
	汇添富稳健回报债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富稳健回报债券 A	10~50
	汇添富稳健回报债券 C	0
	合计	10~50

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富稳健回报债券 A	汇添富稳健回报债券 C
基金合同生效日（2023 年 09 月 01 日）基金份额总额	847,873,540.89	681,237,035.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	50,368,404.60	146,952.86
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回	415,479,511.62	438,717,647.77

回份额		
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	482,762,433.87	242,666,340.18

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2023 年 09 月 01 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 70,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	822,849,415.61	100.00	605,533.79	100.00	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
长江证券	659,895,609.60	100.00	11,625,956,000.00	100.00	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 3 个交易单元：长江证券（上交所单元，深交所单元，北交所单元）。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富稳健回报债券型证券投资基金发行文件	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 14 日
2	关于汇添富稳健回报债券型证券投资基金线上直销系统认购费率执行标准的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 08 日
3	关于汇添富基金管理股份有限公司运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
4	汇添富稳健回报债券型证券投资基金基金合同生效公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 02 日
5	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与南京途牛基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 04 日
6	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与凤凰金信（海口）基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 12 日
7	汇添富稳健回报债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 23 日
8	关于汇添富运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 09 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富稳健回报债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳健回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳健回报债券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回报债券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。

### 13.2 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

### 13.3 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

2024 年 03 月 29 日