

# 汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资 基金 2026 年第 1 季度报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	汇添富科创板 2 年定开混合
场内简称	添富科创
基金主代码	506006
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 07 月 28 日
报告期末基金份额总额(份)	1,398,652,853.60
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于科创板上市的优质公司，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采取的投资策略主要包括：资产配置策略、战略配售策略、个股精选策略、债券投资策略、可转债及可交换债投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。

业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率*70%+中债综合财富指数收益率*20%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注：扩位证券简称：汇添富科创板。

### § 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(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 03 月 31 日)
1. 本期已实现收益	193,799,742.97
2. 本期利润	14,888,429.09
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0106
4. 期末基金资产净值	1,595,104,521.86
5. 期末基金份额净值	1.1405

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

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

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	0.95%	1.70%	-4.80%	1.45%	5.75%	0.25%
过去六个月	0.24%	1.49%	-11.88%	1.40%	12.12%	0.09%
过去一年	28.66%	1.46%	17.34%	1.41%	11.32%	0.05%
过去三年	13.11%	1.66%	17.39%	1.45%	-4.28%	0.21%
过去五年	13.35%	1.66%	-4.23%	1.34%	17.58%	0.32%
自基金合同生效起至今	19.78%	1.62%	3.07%	1.34%	16.71%	0.28%

### 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

汇添富科创板2年定开混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2020年07月28日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

## § 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
夏正安	本基金的基金经理	2022 年 10 月 17 日	-	11	国籍：中国。学历：复旦大学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2015 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司行业分析师、高级行业分析师职位。2022 年 10 月 17 日至今任汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 30 日至今任汇添富创新活力混合型证券投资基金的基金经理。

注：基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

##### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，力争在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0。基金管理人严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告

期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度，A 股和港股市场整体呈现出“先强后震”的阶段性特征。A 股方面，1 月上证综指、深证成指和创业板指分别上涨 3.76%、5.03%、4.47%，北证 50 及科创 50 表现更为突出，分别达到 6.33%和 12.29%，显示出小盘成长板块的强劲走势。进入 2 月及 3 月，市场波动明显加剧，尤其是 3 月美伊冲突以来，市场经历了风险偏好快速收敛，以及之后的高波震荡。行业层面，年初至 2 月中旬，资金集中于 TMT（电子/计算机/通信/传媒）、国防军工与上游资源的贵金属/钨/化工涨价链。美伊冲突升级后，风险偏好回落与大宗再定价叠加，油气、煤炭、公用事业、银行相对占优，高弹性 TMT 与部分有色阶段承压，但“缺电与涨价”支撑下的电力设备/电网设备与存储链表现更具韧性。港股表现则更受外部资金和盈利预期主导。1 月，恒生指数及恒生科技分别获得 6.85%和 3.67%的涨幅，随后 2-3 月受南向资金流转向和盈利预期下修影响，市场波动加大，行业风格由成长科技向资源、高股息板块再均衡。

一季度，国内宏观核心矛盾主要体现为经济处于温和复苏阶段，内需恢复节奏相对平缓，地产链条仍处在调整优化过程中，消费动能恢复存在一定结构性差异。政策层面持续围绕稳增长发力，通过降准、宽信用等举措营造适宜的货币金融环境，政策效果正逐步显现，同时市场预期与信心仍在稳步修复过程中。外部地缘形势变化及海外高利率环境，也对出口、通胀预期及产业链稳定带来阶段性影响。海外方面，美国通胀粘性超出市场预期，导致美联储降息预期不断延后，高利率环境持续，叠加中东地缘冲突加剧推升油价，全球滞胀风险有所上升，全球经济整体增长动能不足，国际贸易与科技领域摩擦加剧，市场避险情绪显著升温。受此影响，全球资产交易逻辑从前期的降息交易转向滞胀与避险交易，股债商品走势分化，A 股市场防御性板块与高股息标的占优，成长及消费板块表现偏弱，港股则呈现成长领跌、价值抗跌的格局，资金流向出现明显分化，原油、黄金等商品价格走强，工业品表现相对疲软。

组合一季度聚焦科创领域核心赛道，立足行业周期与产业趋势，通过精细化调整实现持仓优化，聚焦高确定性投资机会。1 月份，组合重点增配国产算力与半导体设备相关标的，核心逻辑在于看好国产算力的确定性增长机会，依托国产 AI 芯片在性能、生态、产能上的全面突破，把握算力国产化带来的投资红利，同时看好存储大周期启动背景下，上游半导体设备的投资确定性，契合半导体设备国产化加速的行业趋势。2 月份，组合进一步优化持仓结构，在海外算力、AI 应用等行业开展个股调整，针对海外算力这一全年业绩主线，进行

标的新老迭代，筛选具备更强竞争力的标的；在 AI 应用领域，兑现前期涨幅较大标的的收益，新增工业 AI 标的，把握 AI 应用从 0 到 1 落地过程中工业领域的细分机会；同时增加半导体设备、功率半导体的配置，看好功率半导体周期触底回升的态势，以及存储大周期带来的上游半导体设备需求增长，契合 2026 年功率半导体“量价齐升”的行业景气特征。3 月份，结合行业景气度变化，重点增配 AI 光通信领域各高景气环节，依托 AI 算力爆发带动光通信需求激增的行业逻辑，布局相关高成长标的。一季度，组合始终围绕科创领域核心产业趋势，把握行业周期拐点，通过动态调整实现持仓结构优化，提升组合整体成长潜力与抗风险能力。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 0.95%，同期业绩比较基准收益率为-4.80%。

#### 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	1,311,407,481.35	82.00
	其中：股票	1,311,407,481.35	82.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	275,828,569.10	17.25
8	其他资产	11,966,542.80	0.75

9	合计	1,599,202,593.25	100.00
---	----	------------------	--------

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 24,559,529.73 元,占期末净值比例为 1.54%。

## 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	26,820,918.96	1.68
C	制造业	1,076,733,114.25	67.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,845.66	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	134,878,166.87	8.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	48,413,905.88	3.04
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,286,847,951.62	80.67

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	-	-
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	24,559,529.73	1.54
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	24,559,529.73	1.54

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	88,747	89,229,783.68	5.59
2	688072	拓荆科技	180,188	66,669,560.00	4.18

3	688012	中微半导体设备	207,379	63,536,778.02	3.98
4	688008	澜起科技	476,864	59,741,521.92	3.75
5	688041	海光信息	209,710	44,093,624.60	2.76
6	688147	微导纳米科技	670,933	42,973,258.65	2.69
7	688521	芯原微电子	185,500	37,526,650.00	2.35
8	301571	国科天成	540,499	34,154,131.81	2.14
9	688048	长光华芯	153,715	31,665,290.00	1.99
10	688313	仕佳光子	376,549	31,325,111.31	1.96

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	639,417.27
2	应收证券清算款	11,327,125.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,966,542.80

### 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

本报告期期初基金份额总额	1,398,652,853.60
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,398,652,853.60

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期未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科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富科创板 2 年定期开放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、报告期内汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](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

2026 年 04 月 22 日