

汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资 基金 2023 年第 4 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 01 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 2024 年 1 月 18 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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 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)	1,814,723,903.74
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	中国战略新兴产业成份指数收益率*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(2023年10月01日 - 2023年12月31日)
1. 本期已实现收益	-85,164,544.40
2. 本期利润	-17,700,100.77
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0098
4. 期末基金资产净值	1,496,922,782.01
5. 期末基金份额净值	0.8249

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

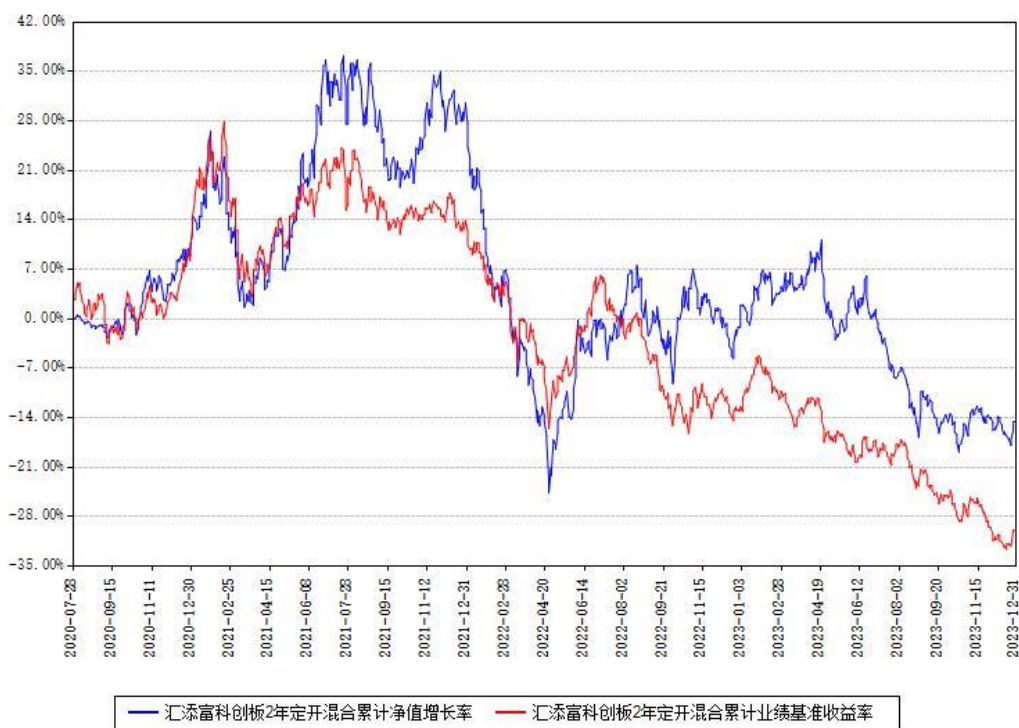
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.16%	0.94%	-6.58%	0.94%	5.42%	0.00%

过去六个月	-15.19%	1.06%	-14.48%	0.90%	-0.71%	0.16%
过去一年	-13.57%	1.15%	-19.39%	0.89%	5.82%	0.26%
过去三年	-24.34%	1.56%	-37.37%	1.17%	13.03%	0.39%
自基金合同生效日起至今	-14.55%	1.49%	-29.88%	1.15%	15.33%	0.34%

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。

§ 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		
马翔	本基金的 基金经理	2020年07 月28日	-	12	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业分析师。2016年3月11日至今任汇添富民营活力混合型证券投资基金的基金经理。2019年5月6日至今任汇添富科技创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年3月19日至2021年9月22日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年6月22日至今任汇添富创新增长一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2020年7月24日至今任汇添富策略增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年7月28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。2021年2月9日至今任汇添富成长精选

					<p>混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月 23 日至今任汇添富北交所创新精选两年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月 2 日至今任汇添富全球汽车产业升级混合型证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富数字经济核心产业一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
夏正安	本基金的基金经理	2022 年 10 月 17 日	-	8	<p>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。</p>

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年四季度，宏观经济整体延续了前期的弱复苏态势。在此背景下，A 股整体表现一般，沪深 300 指数下跌 7.0%、中证 500 指数下跌 4.6%、中证 1000 指数下跌 3.2%、创业板指数下跌 5.6%、科创 50 指数下跌 4.0%、科创 100 指数下跌 2.4%；港股在低位震荡，恒生指数下跌 4.3%、恒生科技指数下跌 4.0%。从行业角度看，有表现的行业不多，煤炭、电子、农林牧渔等申万一级行业实现正收益，而非银金融、建筑装饰、电力设备、商贸零售、建筑材料、房地产、美容护理等行业下跌较大。

9 月以来，随着 CPI、PPI、PMI、社融等一系列宏观数据弱于市场预期，叠加房地产行业未能在刺激政策下逆转下行趋势，使得市场对国内经济走向持观望态度，包括陆股通在内的部分投资者在悲观预期的驱使下持续降低 A 股核心资产的仓位配置，导致市场主要指数均表现不佳。大量资金采取了买入低估值防御或参与主题博弈的策略，驱动了煤炭、电子等行业的相对收益。

从产业周期的角度看，2023 年是科技创新的大年，除了以大模型驱动的 AIGC 产业浪潮外，人形机器人、卫星互联网、MR、创新药等前沿科技也在 2023 年取得了长足的发展。AIGC 产业，大模型环节一超多强、应用环节蓄势待发，基本符合当年移动互联网发展早期的产业规律；人形机器人产业，特斯拉于年初、年末分别发布 Optimus 一代、二代，迭代速度远超传统机器人产业；卫星互联网产业，Starlink 已累计发射近 6000 颗低轨卫星，建成了覆盖全球的卫星服务网络，并已实现现金流收支平衡，大超产业预期，与此同时，我国的低轨卫星服务网络也正在加速建设中；MR 产业，苹果于 2023 年 6 月发布了 VisionPro，并预期于 2024 年 1 月正式发售，正式拉开了 MR 产业发展的帷幕；创新药产业，基于 GLP-1、ADC 等技术平台的创新层出不穷，海内外创新药 license out 案例屡见不鲜。科技创新产业必将带来股票投资领域的新增机会，且在创新萌芽期、落地期、成长期、成熟期均有不同范式的投资机会。

结合上述对宏观、市场、产业的综合判断，本季度组合具体执行了如下操作：（1）大幅降低了软件行业、军工行业的配置，减持了与宏观经济关联度较高、基本面修复不及预期的个股；（2）战略性增加了半导体制造、设备材料、设计行业的配置，以获取 AIGC、半导体国产化等行业趋势带来的超额收益；（3）增加了医药行业的配置，优选创新药研发能力强、管

线预期差大、估值向上空间大的个股进行投资；（4）优化了机械行业的配置，增加了人形机器人产业链标的，减少了与宏观经济关联度高的个股。

往后看，随着中央经济工作会议确立了 2024 年“稳中求进、以进促稳、先立后破”的工作总方针，我相信 2024 年的 A 股市场会迎来真正的转机，在宏观经济整体平稳向上的基础上，结构性机会将层出不穷。作为一支主投科创板的成长型基金，组合将继续在科技创新赛道内深挖个股机会，力争为组合创造可持续的收益。

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-1.16%。同期业绩比较基准收益率为-6.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

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	1,312,749,130.70	87.53
	其中：股票	1,312,749,130.70	87.53
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	186,816,833.36	12.46
8	其他资产	227,033.08	0.02
9	合计	1,499,792,997.14	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 34,772,486.06 元，占期末净

值比例为 2.32%。

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	1,083,656,441.96	72.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	820,536.00	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,046.40	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	166,425,520.48	11.12
J	金融业	6,442,650.00	0.43
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	36,981.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	3,739,246.71	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	16,831,240.28	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,277,976,644.64	85.37

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	34,772,486.06	2.32
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	34,772,486.06	2.32

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	688981	中芯国际	2,014,414	106,804,230.28	7.13
2	688036	传音控股	768,469	106,356,109.60	7.10
3	688012	中微半	669,860	102,890,496.00	6.87

		导体设备			
4	688628	优利德科技	1,111,061	43,775,803.40	2.92
5	688169	石头科技	152,630	43,186,658.50	2.89
6	688375	国博电子	437,660	34,807,099.80	2.33
7	688425	铁建重工	8,757,334	34,766,615.98	2.32
8	688100	威胜信息	1,149,503	33,243,626.76	2.22
9	688008	澜起科技	497,447	29,229,985.72	1.95
10	00268	金蝶国际	2,705,000	27,896,079.64	1.86

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	227,033.08
2	应收证券清算款	-
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	227,033.08

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	1,814,723,903.74
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	1,814,723,903.74

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 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 01 月 22 日