

# 汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025 年 09 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 10 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

|               |                                                                                                                |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称          | 汇添富绝对收益定开混合                                                                                                    |
| 基金主代码         | 000762                                                                                                         |
| 基金运作方式        | 契约型开放式                                                                                                         |
| 基金合同生效日       | 2017 年 03 月 15 日                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额(份) | 2,349,701,749.57                                                                                               |
| 投资目标          | 基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。                                           |
| 投资策略          | 本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略，力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。绝对收益策略包括：市场中性投资策略、其他绝对收益策略。其他投资策略包括：债券投资策略、中小企业私募债投资策略、衍生品投资策略。 |

|                    |                                                                                                                |                   |
|--------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
| 业绩比较基准             | 一年期定期存款税后利率                                                                                                    |                   |
| 风险收益特征             | 本基金为特殊的混合型基金，采用多种绝对收益策略，其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险，使得多空组合的收益波动与市场相关性较低。本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种，其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。 |                   |
| 基金管理人              | 汇添富基金管理股份有限公司                                                                                                  |                   |
| 基金托管人              | 招商银行股份有限公司                                                                                                     |                   |
| 下属分级基金的基金简称        | 汇添富绝对收益定开混合 A                                                                                                  | 汇添富绝对收益定开混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码        | 000762                                                                                                         | 008140            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 2, 004, 124, 086. 58                                                                                           | 345, 577, 662. 99 |

§ 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(2025 年 07 月 01 日 - 2025 年 09 月 30 日) |                   |
|-----------------|------------------------------------------|-------------------|
|                 | 汇添富绝对收益定开混合 A                            | 汇添富绝对收益定开混合 C     |
| 1. 本期已实现收益      | -98, 649, 343. 09                        | -17, 038, 206. 55 |
| 2. 本期利润         | 85, 729, 512. 97                         | 13, 305, 798. 37  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0428                                  | 0. 0385           |
| 4. 期末基金资产净值     | 2, 489, 409, 510. 70                     | 409, 542, 182. 44 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 242                                   | 1. 185            |

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

| 汇添富绝对收益定开混合 A |          |             |            |               |         |       |
|---------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 阶段            | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④   |
| 过去三个月         | 3.59%    | 0.27%       | 0.38%      | 0.00%         | 3.21%   | 0.27% |
| 过去六个月         | 3.93%    | 0.23%       | 0.75%      | 0.00%         | 3.18%   | 0.23% |
| 过去一年          | 3.76%    | 0.28%       | 1.50%      | 0.00%         | 2.26%   | 0.28% |
| 过去三年          | -6.90%   | 0.26%       | 4.50%      | 0.00%         | -11.40% | 0.26% |
| 过去五年          | -10.20%  | 0.30%       | 7.50%      | 0.00%         | -17.70% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今    | 24.20%   | 0.31%       | 12.82%     | 0.00%         | 11.38%  | 0.31% |
| 汇添富绝对收益定开混合 C |          |             |            |               |         |       |
| 阶段            | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④   |
| 过去三个月         | 3.31%    | 0.26%       | 0.38%      | 0.00%         | 2.93%   | 0.26% |
| 过去六个月         | 3.49%    | 0.22%       | 0.75%      | 0.00%         | 2.74%   | 0.22% |
| 过去一年          | 2.95%    | 0.28%       | 1.50%      | 0.00%         | 1.45%   | 0.28% |
| 过去三年          | -9.06%   | 0.26%       | 4.50%      | 0.00%         | -13.56% | 0.26% |
| 过去五年          | -13.69%  | 0.30%       | 7.50%      | 0.00%         | -21.19% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今    | -7.06%   | 0.30%       | 8.83%      | 0.00%         | -15.89% | 0.30% |

### 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

汇添富绝对收益定开混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富绝对收益定开混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 03 月 15 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。

本基金于 2019 年 11 月 11 日新增 C 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限<br>(年) | 说明                                                   |
|-----|-------------------|------------------|------|---------------|------------------------------------------------------|
|     |                   | 任职日期             | 离任日期 |               |                                                      |
| 顾耀强 | 本基金的基金经理, 增强收益部总监 | 2017 年 03 月 15 日 | —    | 21            | 国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，现任增强收益部总监。</p> <p>2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |                                |                     |   |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|--------------------------------|---------------------|---|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                |                     |   |    | 基金的基金<br>经理。2017<br>年 3 月 15 日<br>至今任汇添<br>富绝对收益<br>策略定期开<br>放混合型发<br>起式证券投<br>资基金的基<br>金经理。<br>2019 年 8 月<br>24 日至 2024<br>年 10 月 18<br>日任汇添富<br>均衡增长混<br>合型证券投<br>资基金的基<br>金经理。<br>2021 年 1 月<br>20 日至今任<br>汇添富沪深<br>300 基本面增<br>强指数型证<br>券投资基金<br>的基金经<br>理。2021 年<br>2 月 5 日至<br>2022 年 9 月<br>22 日任汇添<br>富价值成长<br>均衡投资混<br>合型证券投<br>资基金的基<br>金经理。<br>2021 年 9 月<br>16 日至今任<br>汇添富中证<br>500 基本面增<br>强指数型证<br>券投资基金<br>的基金经<br>理。 |
| 吴江宏 | 本基金的基<br>金经理, 稳<br>健收益部总<br>经理 | 2017 年 03 月<br>15 日 | - | 14 | 国籍：中<br>国。学历：<br>厦门大学经<br>济学硕士。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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，历任固定收益分析师，现任稳健收益部总经理。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 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。2016 年 8 月 3 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添</p> |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 日任汇添富鑫永定定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经</p> |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>理。2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2019</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>年 8 月 28 日至 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月 25 日至今任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 10 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 3 月 4 日至今任汇</p> |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                              |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 添富实业债<br>债券型证券<br>投资基金的<br>基金经理。<br>2025 年 9 月<br>29 日至今任<br>汇添富双盈<br>回报一年持<br>有期债券型<br>证券投资基金<br>的基金经<br>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遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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中的公平交易模块,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

三季度 A 股市场呈现强势上行态势。在地缘冲突边际缓和、美联储政策独立性引发市场对流动性宽松预期升温的双重驱动下，全球主要股指同期均录得显著涨幅。市场投资主线主要聚焦于 AI 领域，电子、通信行业领涨全市场。全球 AI 巨头“模型能力提升-应用渗透加速-基建需求爆发”飞轮效应的叙事持续强化，以及中国科技自主可控能力的不断增强，推动光通信、PCB、国产芯片、半导体设备、存储等科技细分赛道景气度超预期，轮动上涨。此外，黄金、白银等大宗商品价格不断创出历史新高，也带动了有色金属行业大幅走强。前期表现亮眼的银行等低估值板块，受市场风格切换影响，阶段表现相对弱势。消费、房地产及基建产业链等领域则因基本面乏善可陈，整体表现平淡。三季度市场快速上涨过程中，本基金适度加大了优质个股偏离和多头暴露，通过阿尔法和多头贡献覆盖了股指期货基差快速收敛带来的对冲成本上升并实现了一定绝对收益。本基金管理人将继续密切跟踪市场变化，加强研究的深入性和前瞻性，努力挖掘更多优质公司，并不断提升投资策略的灵活性和适应性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富绝对收益定开混合 A 类份额净值增长率为 3.59%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。本报告期汇添富绝对收益定开混合 C 类份额净值增长率为 3.31%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

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              | 1,930,204,603.15 | 66.48        |
|    | 其中：股票             | 1,930,204,603.15 | 66.48        |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 517,620,107.77   | 17.83        |
|    | 其中：债券             | 517,620,107.77   | 17.83        |
|    | 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      | 229,299,855.84   | 7.90         |
| 8  | 其他资产              | 226,282,413.85   | 7.79         |
| 9  | 合计                | 2,903,406,980.61 | 100.00       |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | —       | —            |

|   |                  |                  |       |
|---|------------------|------------------|-------|
| B | 采矿业              | 181,257,878.50   | 6.25  |
| C | 制造业              | 1,125,367,552.84 | 38.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 39,833,405.50    | 1.37  |
| E | 建筑业              | 5,943,770.00     | 0.21  |
| F | 批发和零售业           | 18,627.99        | 0.00  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 56,023,229.00    | 1.93  |
| H | 住宿和餐饮业           | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 71,542,031.40    | 2.47  |
| J | 金融业              | 366,819,901.48   | 12.65 |
| K | 房地产业             | 13,913,532.40    | 0.48  |
| L | 租赁和商务服务业         | 31,103,988.47    | 1.07  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 10,649,903.34    | 0.37  |
| 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               | 23,839,980.23    | 0.82  |
| Q | 卫生和社会工作          | 3,890,802.00     | 0.13  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -                | -     |
| S | 综合               | -                | -     |
|   | 合计               | 1,930,204,603.15 | 66.58 |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 190,000   | 76,380,000.00 | 2.63         |
| 2  | 600276 | 恒瑞医药 | 885,220   | 63,337,491.00 | 2.18         |
| 3  | 601899 | 紫金矿业 | 2,017,900 | 59,406,976.00 | 2.05         |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 800,000   | 51,752,000.00 | 1.79         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 1,251,872 | 50,588,147.52 | 1.75         |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 29,780    | 43,002,022.20 | 1.48         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 504,417   | 36,650,939.22 | 1.26         |
| 8  | 600030 | 中信证券 | 1,127,496 | 33,712,130.40 | 1.16         |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 603,595   | 33,264,120.45 | 1.15         |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 1,225,500 | 33,235,560.00 | 1.15         |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | 196,150,715.95 | 6.77         |
| 2  | 央行票据 | —              | —            |
| 3  | 金融债券 | 247,479,951.22 | 8.54         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
|    | 其中：政策性金融债 | 134,223,432.87 | 4.63  |
| 4  | 企业债券      | 4,189,001.64   | 0.14  |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —     |
| 6  | 中期票据      | 10,167,736.99  | 0.35  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 59,632,701.97  | 2.06  |
| 8  | 同业存单      | —              | —     |
| 9  | 地方政府债     | —              | —     |
| 10 | 其他        | —              | —     |
| 11 | 合计        | 517,620,107.77 | 17.86 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称                 | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|---------|----------------------|---------|---------------|----------------------|
| 1  | 250011  | 25 付息<br>国债 11       | 900,000 | 89,599,866.85 | 3.09                 |
| 2  | 220313  | 22 进出<br>13          | 500,000 | 51,189,931.51 | 1.77                 |
| 3  | 250215  | 25 国开<br>15          | 400,000 | 39,081,863.01 | 1.35                 |
| 4  | 113052  | 兴业转<br>债             | 300,000 | 36,259,191.78 | 1.25                 |
| 5  | 2228024 | 22 工商<br>银行二<br>级 03 | 300,000 | 31,222,232.88 | 1.08                 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量<br>(买/<br>卖) | 合约市值(元)         | 公允价值变动<br>(元)  | 风险说明            |
|-------------------|--------|------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| IC2510            | IC2510 | -100.00          | -147,884,000.00 | -11,108,200.00 |                 |
| IC2512            | IC2512 | -40.00           | -58,310,400.00  | -1,097,600.00  |                 |
| IF2510            | IF2510 | -330.00          | -459,082,800.00 | -14,251,140.00 |                 |
| IF2512            | IF2512 | -334.00          | -463,044,240.00 | -26,666,700.00 |                 |
| IF2603            | IF2603 | -340.00          | -468,812,400.00 | -25,207,080.00 |                 |
| IM2510            | IM2510 | -130.00          | -196,466,400.00 | -7,962,960.00  |                 |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |                  |                 |                | -86,293,680.00  |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |                  |                 |                | -296,039,132.45 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |                  |                 |                | -39,805,260.00  |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将主要利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分

的优化创造额外收益。

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 市场中性策略执行情况

截止本报告期末，本基金持有的股票资产 1,930,204,603.15 元，占基金资产净值的比例为 66.58%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,793,600,240.00 元，占基金资产净值的比例为-61.87%，运用股指期货进行对冲的空头合约市值占股票资产的比例为-92.92%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-120,861,908.60 元，公允价值变动损益为 220,118,319.46 元。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、招商银行股份有限公司、国家开发银行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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 215,558,416.69 |
| 2  | 应收证券清算款 | 10,723,997.16  |
| 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 | 226,282,413.85 |
|---|----|----------------|

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 113052 | 兴业转债    | 36,259,191.78 | 1.25         |
| 2  | 127084 | 柳工转 2   | 7,167,653.21  | 0.25         |
| 3  | 118030 | 睿创转债    | 5,074,454.79  | 0.18         |
| 4  | 113652 | 伟 22 转债 | 2,528,429.83  | 0.09         |
| 5  | 110085 | 通 22 转债 | 1,739,523.60  | 0.06         |
| 6  | 127024 | 盈峰转债    | 1,717,320.81  | 0.06         |
| 7  | 113633 | 科沃转债    | 1,713,179.18  | 0.06         |
| 8  | 123254 | 亿纬转债    | 1,134,074.09  | 0.04         |

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目            | 汇添富绝对收益定开混合 A    | 汇添富绝对收益定开混合 C  |
|---------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 2,004,124,086.58 | 345,577,662.99 |
| 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  | 2,004,124,086.58 | 345,577,662.99 |

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末运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,001,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 03 月 15 日起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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、报告期内汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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。

### 10.2 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

### 10.3 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

2025 年 10 月 28 日