汇添富中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 3 季度报告

2026 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：国泰海通证券股份有限公司

送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 07 月 01 日起至 2026 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	汇添富中证 AAA 科创债 ETF
场内简称	科创债汇
基金主代码	551520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 09 月 17 日
报告期末基金份额总额(份)	245,741,636.00
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、优化抽样复制策略 本基金为指数基金，采用优化抽样复制法。通过对标的指数中各成份债券的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的债券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪

	偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 本基金运作过程中，当标的指数成份券发生明显负面事件面临违约，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 2、替代性策略 当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份债券和备选成份债券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份债券和备选成份债券外寻找其他债券构建替代组合，对标的指数进行跟踪复制。 替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 其他投资策略还包括资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证 AAA 科技创新公司债指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证 AAA 科技创新公司债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司

注：扩位证券简称：科创债 ETF 汇添富。

§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 07 月 01 日 - 2026 年 09 月 30 日)
1.本期已实现收益	96,210,873.26
2.本期利润	156,151,500.35

3.加权平均基金份额本期利润	0.7397
4.期末基金资产净值	25,187,222,688.43
5.期末基金份额净值	102.4947

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。

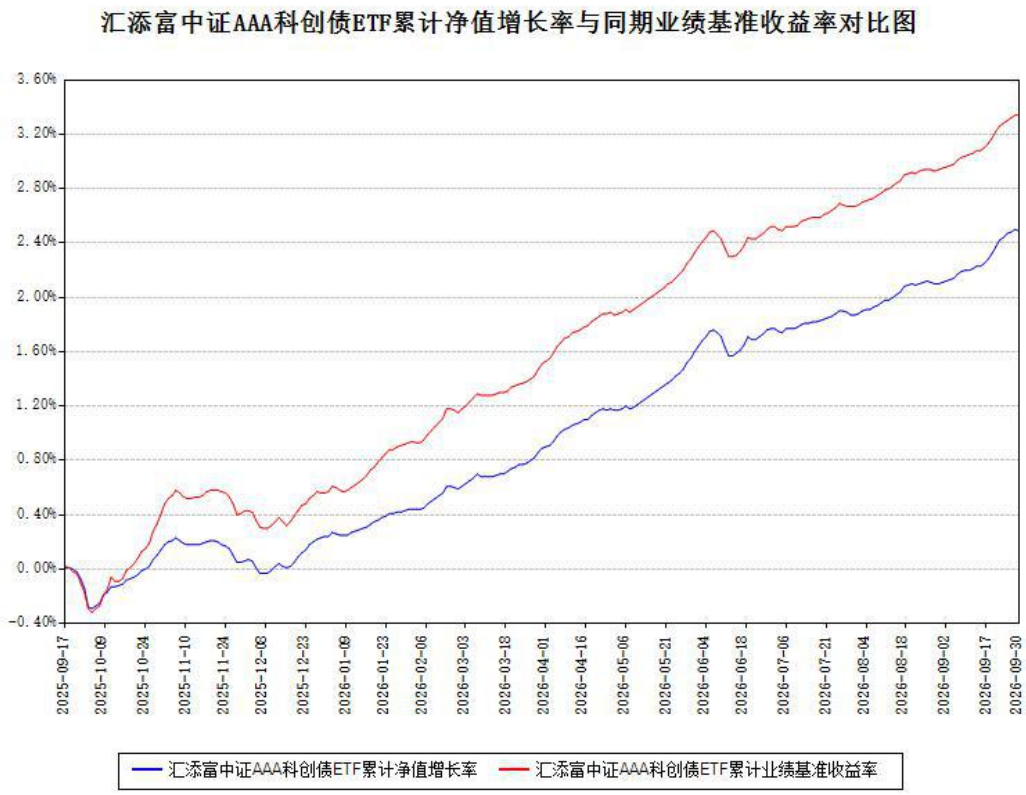
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.71%	0.01%	0.80%	0.01%	-0.09%	0.00%
过去六个月	1.59%	0.02%	1.80%	0.02%	-0.21%	0.00%
过去一年	2.75%	0.02%	3.62%	0.02%	-0.87%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.49%	0.02%	3.34%	0.03%	-0.85%	-0.01%

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



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2025 年 09 月 17 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		
陶宏伟	本基金的基金经理	2025 年 09 月 17 日	-	8	国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2019 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2024 年 11 月 19 日

					至今任汇添富鑫荣纯债债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月 17 日至今任汇添富中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
晏建军	本基金的基金经理	2025 年 09 月 18 日	-	14	国籍：中国。学历：华中科技大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2013 年 8 月至 2016 年 6 月就职于中信保诚基金管理有限公司，2016 年 6 月至 2023 年 4 月就职于前海开源基金管理有限公司，2023 年 5 月至 2024 年 7 月就职于上海海通证券资产管理有限公司。2024 年 7 月起加入汇添富基金管理股份有限公司。2024 年 9 月 4 日至 2025 年 9 月 17 日任汇添富鑫裕一年定期开

					放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024年9月4日至今任汇添富鑫荣纯债债券型证券投资基金的基金经理。2024年9月4日至今任汇添富中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2024年9月13日至今任汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）的基金经理。2024年11月11日至2026年1月23日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。2025年6月30日至今任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2025年8月21日至今任汇添富鑫弘定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2025年9月18日

					至今任汇添富中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月 28 日至今任汇添富丰泰纯债债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月 28 日至今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。

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和流程，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

2026 年三季度债券市场在“适度宽松”的货币政策与“资产荒”逻辑下延续此前偏强趋势，科创债表现同样亮眼，但行情的结构与二季度则明显不同--收益率曲线由二季度的稳中有降转为“先震荡、后加速下行”，且下行集中在中长端与超长端，曲线显著平坦化。以中证 AAA 科创债收益率为例，3 年期收益率由 6 月末的 1.58%小幅上行至 8 月末的 1.63%

后，9 月转为快速下行，至 9 月末回落至 1.56%，全季基本持平、变动不足 3bp；而 10 年期收益率则由 6 月末的 2.06%一路下行至 9 月末的 1.92%，全季累计下行约 14bp，长端贡献了绝大部分的收益率下行。

与此同时，科创债 ETF 规模在三季度出现爆发式增长。7 月市场调整阶段，科创债 ETF 规模一度净流出约 107 亿元；8 月震荡蓄势、小幅回补；9 月随着债牛行情加速确认，科创债 ETF 规模单月净增超 520 亿元，创下赛道单月纪录。全季度科创债 ETF 规模由 6 月末的 3221 亿元增至 9 月末的 3692 亿元，累计净增约 471 亿元，增幅 14.6%。规模扩容与收益率下行形成“量价共振”,科创债在被动投资扩容的背景下一跃成为本轮债券牛市中表现最亮眼的结构品种之一。

报告期内，组合通过综合运用品种策略、期限结构选择、骑乘策略、择券策略等，努力追求跟踪误差最小化，尽可能完整复制中证 AAA 科技创新公司债指数的风险收益特征。

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 0.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.80%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,851,682,043.29	94.65
	其中：债券	23,851,682,043.29	94.65
	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	1,341,677,034.98	5.32
8	其他资产	7,268,448.96	0.03
9	合计	25,200,627,527.23	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

注:本基金报告期末未投资境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	101,471,810.41	0.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	23,750,210,232.88	94.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
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	23,851,682,043.29	94.70

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	245495	26 国能 K1	2,200,000	225,006,054.79	0.89
2	245960	26 中证 K2	1,600,000	160,738,586.30	0.64
3	242484	25 东风 K3	1,499,960	151,537,465.74	0.60
4	245970	沪国投 K2	1,500,000	151,492,438.35	0.60
5	245949	26 国能 K3	1,498,000	151,155,176.98	0.60

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:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,东风汽车集团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。

5.11.2

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,238,203.17
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	30,245.79
8	其他	-
9	合计	7,268,448.96

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：本基金本报告期末未持有股票。

§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	195,771,636.00
本报告期基金总申购份额	51,970,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	245,741,636.00

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 22 日,2026 年 9 月 28 日至 2026 年 9 月 28 日	56,160,067.00	50,433,088.00	68,440,168.00	38,152,987.00	15.53
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险							

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。
2、基金规模较小导致的风险
持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。
3、提前终止基金合同的风险
持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

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中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数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、报告期内汇添富中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数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

2026 年 10 月 27 日