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 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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)	1,626,130,080.47
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)	1,376,199,328.02	249,930,752.45

§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)	
	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	126,714,186.27	21,175,111.99
2.本期利润	-4,022,640.90	-1,328,347.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0029	-0.0053
4.期末基金资产净值	1,831,406,074.82	314,814,031.20
5.期末基金份额净值	1.331	1.260

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	-0.22%	0.43%	0.38%	0.00%	-0.60%	0.43%
过去六个	6.31%	0.44%	0.75%	0.00%	5.56%	0.44%

月						
过去一年	7.17%	0.40%	1.50%	0.00%	5.67%	0.40%
过去三年	8.92%	0.32%	4.50%	0.00%	4.42%	0.32%
过去五年	-5.74%	0.30%	7.50%	0.00%	-13.24%	0.30%
过去七年	5.97%	0.31%	10.50%	0.00%	-4.53%	0.31%
自基金合同生效起至今	33.10%	0.32%	14.32%	0.00%	18.78%	0.32%
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	-0.40%	0.43%	0.38%	0.00%	-0.78%	0.43%
过去六个月	5.97%	0.44%	0.75%	0.00%	5.22%	0.44%
过去一年	6.33%	0.41%	1.50%	0.00%	4.83%	0.41%
过去三年	6.42%	0.32%	4.50%	0.00%	1.92%	0.32%
过去五年	-9.42%	0.30%	7.50%	0.00%	-16.92%	0.30%
自基金合同生效起至今	-1.18%	0.32%	10.33%	0.00%	-11.51%	0.32%

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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
杨涛	本基金的基金经理	2026 年 03 月 06 日	-	17	国籍：中国。学历：上海财经大学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：之前曾在华泰柏瑞基金管理有限公司、上海泓湖投资管理有限公司、太平资产管理有限公司工作。2020 年 10 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2026 年 3 月 6 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。2026 年 8 月 21 日至今任汇添富稳颐优选债券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

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
杨涛	公募基金	2	2,683,950,500.89	2026 年 3 月 6 日
	私募资产管理计划	4	892,438,314.94	2021 年 1 月 22 日
	其他组合	-	-	
	合计	6	3,576,388,815.83	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，离任产品情况如下：

杨涛—离任产品类型：公募基金，离任数量：0 只，离任时间：无；离任产品类型：私募资产管理计划，离任数量：4 只，离任时间：2026 年 8 月 14 日,2026 年 8 月 26 日,2026 年 8 月 26 日,2026 年 9 月 21 日。

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

回顾三季度，A 股市场总体呈现"高位剧震、轮动加快"的运行特征。季初，前期领涨的算力、光模块等主线板块集中获利兑现，叠加海外流动性预期反复与业绩验证压力，风险偏

好快速收敛，主要指数自阶段高位出现大幅回落。但伴随中长期资金入市信号出现、流动性维持充裕以及中报业绩陆续兑现，八月上旬市场触底回升，展开修复行情，科技内部出现轮动式反弹。九月后由于美伊局势出现反复，部分硬科技出现回落，反观传统板块低位企稳，类红利资产则在调整中凸显防御属性。三季度主要指数全线收跌，但个股依然涨跌分化严重，赚钱效应由极致抱团转向业绩验证方向。本报告期内，面对市场的剧烈波动，管理人积极对组合进行动态调整，保持持仓结构的均衡，并对股指期货的结构进行持续优化，努力减少来自于基差的影响，总体净值在回撤后出现较好的修复。展望后市，管理人将继续秉承绝对收益的投资理念，加强前瞻性研究，同时积极运用更多的子策略工具来应对市场变化，努力为持有人创造更好的经风险调整后回报。

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-0.22%，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-0.40%，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	753,233,256.17	35.01
	其中：股票	753,233,256.17	35.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	572,998,877.99	26.64
	其中：债券	572,998,877.99	26.64
	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	389,014,687.48	18.08

	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	349,066,449.23	16.23
8	其他资产	86,888,164.39	4.04
9	合计	2,151,201,435.26	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	23,885,660.91	1.11
C	制造业	488,191,403.91	22.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,060,811.00	1.40
E	建筑业	18,351,825.00	0.86
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	20,591,249.00	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,722,342.88	1.94
J	金融业	112,569,366.62	5.25
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	12,367,843.85	0.58
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	5,492,753.00	0.26

S	综合	-	-
	合计	753,233,256.17	35.10

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	600036	招商银行	1,251,872	51,652,238.72	2.41
2	000651	格力电器	878,200	33,617,496.00	1.57
3	002384	东山精密	169,899	28,441,092.60	1.33
4	000333	美的集团	259,017	20,747,261.70	0.97
5	300308	中际旭创	24,400	19,725,936.00	0.92
6	601398	工商银行	2,320,600	19,214,568.00	0.90
7	000921	海信家电	703,900	18,850,442.00	0.88
8	601600	中国铝业	2,087,400	18,640,482.00	0.87
9	688498	源杰科技	11,323	18,263,999.00	0.85

10	600900	长江电力	573,200	16,359,128.00	0.76

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	149,705,343.06	6.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	406,934,293.15	18.96
	其中：政策性金融债	303,816,673.97	14.16
4	企业债券	2,078,500.82	0.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,151,736.99	0.47
7	可转债（可交换债）	4,129,003.97	0.19
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	572,998,877.99	26.70

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	170210	17 国开 10	1,300,000	134,310,693.15	6.26
2	260010	26 附息国债 10	600,000	60,611,804.35	2.82
3	250215	25 国开 15	600,000	59,966,794.52	2.79

4	220210	22 国开 10	500,000	54,426,315.07	2.54
5	242400009	24 农行永续债 02	500,000	51,513,115.07	2.40

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（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2612	IC2612	-13.00	-19,014,840.00	137,320.00	
IF2612	IF2612	-286.00	-368,888,520.00	6,898,357.08	
IH2612	IH2612	-231.00	-192,543,120.00	1,286,820.00	
IM2612	IM2612	-98.00	-140,641,760.00	483,240.00	
公允价值变动总额合计（元）					8,805,737.08
股指期货投资本期收益（元）					45,354,844.1

	2
股指期货投资本期公允价值变动（元）	25,146,517.08

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 753,233,256.17 元，占基金资产净值的比例为 35.10%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-721,088,240.00 元，占基金资产净值的比例为-33.60%，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-95.73%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 140,327,829.67 元，公允价值变动损益为-153,258,322.38 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，国家开发银行、招商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	86,882,810.03
2	应收证券清算款	5,354.36
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	86,888,164.39

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	3,988,513.41	0.19

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	1,376,199,328.02	249,930,752.45
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	1,376,199,328.02	249,930,752.45

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 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

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