汇添富中证800价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发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 800 价值 ETF 发起式联接
基金主代码	019162
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 21 日
报告期末基金份额总额(份)	14,015,271.86
投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，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	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，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

	及时对相关成份股进行调整。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；存托凭证的投资策略；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；国债期货投资策略；股票期权投资策略；融资投资策略和参与转融通证券出借业务策略等。	
业绩比较基准	中证 800 价值指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为汇添富中证 800 价值 ETF 的联接基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 800 价值 ETF 发起式联接 A	汇添富中证 800 价值 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	019162	019163
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	11,434,961.26	2,580,310.60

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	560030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 06 月 20 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 07 月 10 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	广发证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略及存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证 800 价值指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

§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)	
	汇添富中证800价值ETF发起式联接A	汇添富中证800价值ETF发起式联接C
1.本期已实现收益	30,557.16	3,266.52
2.本期利润	801,938.15	161,631.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0700	0.0652
4.期末基金资产净值	14,813,373.51	3,304,214.67
5.期末基金份额净值	1.2954	1.2805

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

汇添富中证800价值ETF发起式联接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	5.70%	0.74%	4.34%	0.77%	1.36%	-0.03%
过去六个月	-0.43%	0.79%	-2.93%	0.81%	2.50%	-0.02%
过去一年	2.02%	0.77%	-1.00%	0.79%	3.02%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.54%	0.88%	20.52%	0.90%	9.02%	-0.02%
汇添富中证800价值ETF发起式联接C						
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①－③	②－④

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	5.60%	0.74%	4.34%	0.77%	1.26%	-0.03%
过去六个月	-0.63%	0.79%	-2.93%	0.81%	2.30%	-0.02%
过去一年	1.61%	0.77%	-1.00%	0.79%	2.61%	-0.02%
自基金合同生效起至今	28.05%	0.88%	20.52%	0.90%	7.53%	-0.02%

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（2023 年 11 月 21 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		
李雅楠	本基金的基金经理	2026 年 06 月 29 日	-	6	国籍：中国。学历：清华大学应用统计硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2021 年 6 月至 2023 年 10 月在兴银理财有限责任公司工作，

					2023年10月至2026年1月在平安理财有限责任公司工作。2026年1月加入汇添富基金管理股份有限公司。2026年6月29日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026年6月29日至今任汇添富中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026年6月29日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026年6月29日至今任汇添富中证800价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2026年6月29日至今任汇添富中证800价值交易型开放式指数

					证券投资基金的基金经理。2026年7月3日至今任汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2026年7月15日至今任汇添富中证800交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026年7月15日至今任汇添富沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2026年7月15日至今任汇添富沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026年7月23日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2026年9月23日至今任汇添富国证航天

					航空行业交易型开放式指数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

回顾三季度，宏观经济运行总体平稳、转型升级持续推进，高质量发展扎实推进。从需求结构看，外需保持较强韧性，出口表现亮眼，在全球贸易格局深刻调整的背景下，我国产业链供应链优势持续巩固，高技术制造与"新三样"等优势产业景气延续，成为拉动经济增长的重要引擎；内需处于温和修复进程，消费潜力有待进一步释放，房地产处于转型调整期，政策托底力度持续加大，发展新模式构建稳步推进。宏观政策保持定力与连续性，财政支出节奏有序，货币政策精准有力，流动性合理充裕，社会融资成本保持低位，为市场营造了良好的货币环境。

A股市场以震荡整固为主基调，板块轮动加快，风格更趋均衡，大盘蓝筹相对稳健、成长风格波动加大、低估值资产受益于市场风格再平衡与配置需求抬升。海外无风险利率中枢抬升，全球流动性环境边际变化，前期领涨的成长板块进入估值消化阶段，资金积极挖掘低估值、高股息方向的配置机会，煤炭、银行、石油石化等板块表现活跃，红利资产持续受到青睐。与此同时，中长期资金入市步伐稳健，机构配置行为更趋理性，市场定价机制不断完善。成交中枢趋于收敛，市场情绪在整固中渐趋平稳理性，投资者结构优化的特征进一步显现。三季度的结构再平衡优化了市场生态，估值体系更趋合理，为投资者提供了更为从容的布局窗口。

展望四季度,随着库存周期与产能周期逐步走向共振,叠加稳增长政策空间进一步打开,经济有望延续平稳修复态势,内需修复动能有望增强。从政策维度看,财政政策有望继续靠前发力,货币政策保持灵活适度、精准有效,财政与货币政策协同发力,政策合力值得期待;从需求维度看,消费在一揽子政策支持下有望持续回暖,制造业投资在设备更新与产业升级带动下保持韧性,外需韧性可期,房地产调整逐步接近尾声,对经济的边际影响趋于减弱。流动性有望继续保持合理充裕,政策基础不断夯实,为经济高质量发展保驾护航。总体看,支撑经济平稳运行的积极因素正在累积,经济修复的基础有望进一步巩固。

经历三季度的蓄势整固后,权益资产的配置价值进一步凸显:主要指数估值处于更具吸引力的区间,股债性价比偏向权益,成长与价值的估值关系更加均衡,市场结构更为健康。展望后市,市场有望在政策催化、盈利修复和资金再配置的共同作用下迎来修复行情,居民财富向权益资产迁移、中长期资金持续入市等趋势性力量,将为市场提供坚实的资金基础。从结构上看,若总量政策进一步发力,顺周期与高股息方向具备底仓配置价值;TMT 与先进制造等产业趋势明确的板块,经过充分的估值消化后筹码结构趋于健康、性价比凸显,有望迎来修复与再出发的窗口。整体而言,市场有望在震荡中稳步前行,结构性机会有望持续演绎。

本基金为联接基金,报告期内主要通过投资目标 ETF 基本实现了对底层指数的良好跟踪。

作为被动投资的指数型基金,本基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的投资策略,积极采取有效方法严格控制偏离,实现对标的指数的紧密跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 800 价值 ETF 发起式联接 A 类份额净值增长率为 5.70%,同期业绩比较基准收益率为 4.34%。本报告期汇添富中证 800 价值 ETF 发起式联接 C 类份额净值增长率为 5.60%,同期业绩比较基准收益率为 4.34%。

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

本基金为发起式基金,且截至本报告期末,本基金基金合同生效未满 3 年,暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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	17,184,450.92	93.64
3	固定收益投资	201,664.38	1.10
	其中：债券	201,664.38	1.10
	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	961,789.67	5.24
8	其他资产	3,692.95	0.02
9	合计	18,351,597.92	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
汇添富中证800价值交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公司	17,184,450.92	94.85

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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。

5.3.2 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。

5.4 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

5.4.1 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。

5.5 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	201,664.38	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
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	201,664.38	1.11

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	019761	24国债24	2,000	201,664.38	1.11

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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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收到公开谴责、处罚的情况。

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	2,069.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,623.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	3,692.95

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证800价值ETF发起式联接A	汇添富中证800价值ETF发起式联接C
本报告期期初基金份额总额	11,505,365.22	2,376,782.84
本报告期基金总申购份额	245,800.09	699,089.54
减：本报告期基金总赎回份额	316,204.05	495,561.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,434,961.26	2,580,310.60

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

单位：份

	汇添富中证800价值ETF发起式联接A	汇添富中证800价值ETF发起式联接C
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金	87.45	-

份额占基金总份额比例（%）		

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。申购份额包括红利再投、转换入份额，因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额，因份额合并而减少的份额。

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

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	71.35	10,000,000.00	71.35	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	7,595.32	0.05	-	-	
合计	10,007,595.32	71.40	10,000,000.00	71.35	

§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

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	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	71.35

		月 30 日					
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、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 3、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。 4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。 5、提前终止基金合同的风险 基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于 2 亿元人民币的，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。《基金合同》生效三年后继续存续的，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。							

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中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集的文件；

2、《汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；

3、《汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；

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 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接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