汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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：中国工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。

基金托管人中国工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	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）
基金主代码	501305
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 06 月 12 日
报告期末基金份额总额(份)	599,902,637.45
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、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。	
业绩比较基准	中证港股通高股息投资指数收益率×95%（经估值汇率调整后）+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为汇添富中证港股通高股息投资 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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时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。本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定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	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）A	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）C
下属分级基金场内简称	港股高息	港股高 C
下属分级基金的交易代码	501305	501306
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	348,258,106.14	251,644,531.31

注：汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）A 类份额扩位证券简称：港股高股息 LOF；汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）C 类份额扩位证券简称：港股高股息 LOFC。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	513820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 04 月 24 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 05 月 16 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	中国工商银行股份有限公司

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。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金力争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：1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生工具投资策略；5、参与融资投资策略；6、参与转融通证券出借业务策略；7、存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证港股通高股息投资指数收益率（经估值汇率调整后）
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。 本基金除了投资 A 股以外，还将根据法律法规规定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。

§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)	
	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）A	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）C
1.本期已实现收益	6,725,343.09	4,280,918.50
2.本期利润	51,570,281.01	31,387,865.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.1348	0.1188
4.期末基金资产净值	445,000,791.94	310,125,931.57
5.期末基金份额净值	1.2778	1.2324

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

汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）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	10.25%	0.80%	10.07%	0.83%	0.18%	-0.03%
过去六个月	-1.80%	0.80%	-2.02%	0.83%	0.22%	-0.03%
过去一年	1.74%	0.81%	6.36%	0.85%	-4.62%	-0.04%
自基金合同生效起至今	26.63%	1.00%	24.02%	1.08%	2.61%	-0.08%
汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）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	10.14%	0.80%	10.07%	0.83%	0.07%	-0.03%
过去六个月	-2.00%	0.80%	-2.02%	0.83%	0.02%	-0.03%
过去一年	1.34%	0.81%	6.36%	0.85%	-5.02%	-0.04%
自基金合同生效起至今	25.47%	1.00%	24.02%	1.08%	1.45%	-0.08%

3.2.2 自基金转型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

汇添富中证港股通高股息投资ETF联接（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证港股通高股息投资ETF联接（LOF）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（2024 年 06 月 12 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。

本基金由原汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）于 2024 年 06 月 12 日转型而来。

§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		
晏阳	本基金的基金经理	2024 年 06 月 12 日	-	10	国籍：中国。学历：哥伦比亚大学统计学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 9 月至 2021 年 8 月任中证指数有限公司研究员、高级研究员。2021 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经

					理。2022 年 12 月 27 日至今任汇添富北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月 14 日至 2026 年 3 月 14 日任汇添富中证上海环交所碳中和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。2023 年 4 月 13 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2023 年 5 月 22 日

					至 2025 年 5 月 16 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 22 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 20 日至 2026 年 6 月 29 日任汇添富中证800价值交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 11 日至 2025 年 1 月 22 日任汇添富华证专精特新 100 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 26 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金

					经理。2023年11月21日至2026年6月29日任汇添富中证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。2023年11月28日至2025年3月21日任汇添富中证细分有色金属产业主题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。2023年12月5日至2025年8月18日任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月2日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024年4月24日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指

					数证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月 31 日至今任汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 12 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2025 年 5 月 13 日至 2025 年 7 月 28 日任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 4 日至今任汇添富中证油气资源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。2025 年 7 月 29 日至 2026 年 6 月 22 日任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的

					基金经理。2025 年 8 月 5 日至 2026 年 9 月 1 日任汇添富中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 11 月 19 日至今任汇添富恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月 25 日至今任汇添富标普港股通低波红利指数型证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月 11 日至 2026 年 7 月 7 日任汇添富沪深 300 自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月 11 日至今任汇添富中证红利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 11 日至今任中证银行交易型开放

					式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 6 月 30 日至今任汇添富沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月 8 日至今任汇添富沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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 年三季度国民经济运行延续总体平稳、向新向优发展态势。生产端，1-8 月份全国规模以上工业增加值同比增长 5.3%，装备制造业和高技术制造业快速增长；投资端，1-8 月份全国固定资产投资（不含农户）同比下降 7.2%，知识产权产品投资快速增长；消费端，1-8 月份社会消费商品和服务零售总额同比增长 2.5%，其中服务零售增长较快。物价方面，

8 月份全国居民消费价格（CPI）同比上涨 0.8%，涨幅比上月扩大 0.3 个百分点；全国工业生产者出厂价格同比上涨 3.8%，涨幅比上月扩大 0.3 个百分点。

资本市场方面，三季度港股市场整体震荡上行，表现好于 A 股。分阶段看，7 月港股在海外资金回流、企业盈利预期企稳以及内地政策预期改善的带动下明显反弹，恒生指数震荡走高；8 月上行动能放缓、转为高位震荡；进入 9 月，随着美债长端利率高位运行、海外加息预期升温以及地缘扰动反复，市场风险偏好回落，主要指数震荡回调，但全季仍录得正收益。行业层面分化明显，金融、能源与原材料等低估值红利方向，以及软件服务、硬件设备等人工智能产业链和医药生物板块表现居前；消费、地产链及部分前期涨幅较高的科技标的有所回调。

报告期内，本基金按照被动投资的原则，采用完全复制法，主要通过投资于目标 ETF 实现了对标的指数的良好跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）A 类份额净值增长率为 10.25%，同期业绩比较基准收益率为 10.07%。本报告期汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）C 类份额净值增长率为 10.14%，同期业绩比较基准收益率为 10.07%。

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	714,667,458.83	94.31
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	42,715,729.06	5.64
8	其他资产	405,820.25	0.05
9	合计	757,789,008.14	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（%）
汇添富中证港股通高股息投资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	714,667,458.83	94.64

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

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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	89,614.64
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	316,205.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	405,820.25

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	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）A	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）C
本报告期期初基金份额总额	433,205,983.95	281,657,068.50
本报告期基金总申购份额	24,182,822.56	29,544,635.67
减：本报告期基金总赎回份额	109,130,700.37	59,557,172.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	348,258,106.14	251,644,531.31

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

	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）A	汇添富中证港股通高股息投资 ETF 联接（LOF）C
报告期初持有的基金份额	10,000,450.04	-

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	10,000,450.04	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.87	-

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 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中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》；

3、《汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（LOF）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