汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

基金简称	汇添富恒生指数（QDII-LOF）
基金主代码	164705
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 01 日
报告期末基金份额总额(份)	330,206,045.33
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%
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，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
下属分级基金场内简称	恒生 LOF	-
下属分级基金的交易代码	164705	010789
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	244,457,378.88	85,748,666.45
境外资产托管人	英文名称:The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.	
	中文名称:香港上海汇丰银行有限公司	

§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)	
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
1.本期已实现收益	3,338,910.89	1,249,701.46
2.本期利润	16,889,923.43	5,428,529.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0685	0.0583
4.期末基金资产净值	268,543,708.12	93,775,186.69
5.期末基金份额净值	1.0985	1.0936

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

汇添富恒生指数（QDII-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	6.36%	0.92%	6.01%	0.92%	0.35%	0.00%
过去六个月	-2.24%	1.00%	-3.25%	1.01%	1.01%	-0.01%
过去一年	-12.08%	1.07%	-13.10%	1.07%	1.02%	0.00%
过去三年	33.54%	1.30%	28.13%	1.31%	5.41%	-0.01%
过去五年	11.53%	1.39%	3.80%	1.42%	7.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	3.05%	1.36%	-4.43%	1.39%	7.48%	-0.03%
汇添富恒生指数（QDII-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	6.34%	0.92%	6.01%	0.92%	0.33%	0.00%
过去六个月	-2.30%	1.00%	-3.25%	1.01%	0.95%	-0.01%
过去一年	-12.22%	1.07%	-13.10%	1.07%	0.88%	0.00%
过去三年	33.20%	1.30%	28.13%	1.31%	5.07%	-0.01%
过去五年	11.04%	1.39%	3.80%	1.42%	7.24%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.32%	1.36%	-4.43%	1.39%	5.75%	-0.03%

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

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富恒生指数（QDII-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（2020 年 12 月 01 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。

本基金由原汇添富恒生指数分级证券投资基金于 2020 年 12 月 01 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		
董瑾	本基金的基金经理	2026 年 08 月 03 日	-	17	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪

					深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至 2026 年 7 月 15 日任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2026 年 7 月 3 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12

					月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 8 月 29 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2023 年 8 月 29 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 2 月 1 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。2021 年 8 月 9 日至 2026 年 7 月 15 日任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

					2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池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。2022 年 6 月

					13 日至 2026 年 8 月 3 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 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的基金经理。2022 年 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械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 1 月 16 日至今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 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023

					年 4 月 6 日至 2026 年 8 月 3 日任中证能源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 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)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 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2024 年 10 月 26 日任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年

					9 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 24 日至 2025 年 8 月 18 日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 6 月 12 日至 2025 年 8 月 18 日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 3 月 21 日至 2026 年 7 月 15 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。2025 年 5 月 22 日至今任汇添富中证港股通汽车产业主题交

					易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 2 日至 2026 年 7 月 15 日任汇添富沪深 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 3 月 25 日至今任汇添富中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月 9 日至今任汇添富中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月 22 日至今任汇添富中证家电龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月 15 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起

					式联接基金（QDII）的基金经理。2026 年 7 月 20 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月 20 日至今任汇添富中证医药卫生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 22 日至今任汇添富中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月 27 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月 27 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2026 年 8 月 3 日至今任

					汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2026 年 8 月 3 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2026 年 8 月 4 日至今任汇添富中证全指电力公用事业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。
乐无穷	本基金的基金经理	2023 年 04 月 13 日	2026 年 08 月 03 日	12	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证

					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。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至 2025 年 5 月 16 日任汇添富中证芯片产业交易型开放

					式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2026 年 7 月 15 日任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开

					放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至 2025 年 8 月 6 日任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月

					29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至 2026 年 8 月 3 日任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2026 年 8 月 3 日任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日

					至 2024 年 7 月 5 日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 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2025 年 5 月 9 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 3 月

					1 日至 2026 年 8 月 11 日任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 4 月 1 日至 2025 年 5 月 9 日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药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。2024 年 10 月 28 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的基金经理。2025 年 6 月 18 日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的基

					金经理。 2025 年 7 月 10 日至 2026 年 8 月 5 日任汇添富国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 6 日至今任汇添富国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2025 年 8 月 7 日至 2026 年 7 月 15 日任汇添富中证沪港深云计算产业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 27 日至今任汇添富恒生港股通中国科技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 17 日至今任汇添富中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投

					资基金的基金经理。2026 年 8 月 4 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理。2026 年 8 月 12 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2026 年 8 月 12 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2026 年 8 月 12 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2026 年 8 月 12 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金

					（QDII）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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

三季度，国民经济运行延续总体平稳、向新向优发展态势。政策方面，三季度货币政策委员会例会强调要继续实施适度宽松的货币政策、加大逆周期调节力度；综合运用并适时调整货币政策工具，保持流动性充裕。

除基本面因素外，港股还主要受到外部环境的不确定性及流动性等因素的影响。三季度，港股震荡修复，主要指数的表现在医疗保健、能源和金融等行业板块的带动下有所回升。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

本报告期汇添富恒生指数（QDII-LOF）A 类份额净值增长率为 6.36%，同期业绩比较基准收益率为 6.01%。本报告期汇添富恒生指数（QDII-LOF）C 类份额净值增长率为 6.34%，同期业绩比较基准收益率为 6.01%。

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	占基金总资产的比例

		（人民币元）	（%）
1	权益投资	337,208,138.59	91.87
	其中：普通股	335,231,472.02	91.33
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	1,976,666.57	0.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,359,361.45	7.45
8	其他资产	2,476,097.36	0.67
9	合计	367,043,597.40	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 319,707,433.06 元，占期末净值比例为 88.24%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	337,208,138.59	93.07
合计	337,208,138.59	93.07

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	16,749,911.67	4.62
15 原材料	7,153,771.83	1.97
20 工业	17,213,522.17	4.75
25 可选消费	60,997,349.11	16.84
30 日常消费	6,666,909.92	1.84
35 医疗保健	19,770,422.11	5.46
40 金融	113,292,468.91	31.27
45 信息技术	23,313,387.55	6.43
50 电信服务	50,803,195.28	14.02
55 公用事业	8,324,629.25	2.30
60 房地产	12,922,570.79	3.57
合计	337,208,138.59	93.07

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

5.4 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及存托凭证投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	HSBC Holdin	汇丰控股有限	5 HK	香港联合交易	中国香港	202,000	27,397,332.7	7.56

	gs PLC	公司		所			2	
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	73,500	27,193,457.97	7.51
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	293,900	26,894,075.41	7.42
4	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	中国香港	2,293,000	19,329,266.33	5.33
5	AIA Group Ltd	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	246,800	15,592,752.92	4.30
6	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	中国香港	1,966,000	13,011,810.18	3.59
7	China Mobile	中国移动有限	941 HK	香港联合交易	中国香港	148,500	10,127,918.1	2.80

	Ltd	公司		所			5	
8	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港交易及结算所有限公司	388 HK	香港联合交易所	中国香港	28,700	9,554,094.42	2.64
9	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	430,400	9,325,270.55	2.57
10	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	中国香港	1,695,000	8,853,808.26	2.44

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级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名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名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民	占基金资产净值

			币元）	比例（%）
1	期货品种_指数	HANG SENG IDX FUT Oct26	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，公允价值变动金额为-38,414.30 元，已包含在结算备付金中。

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十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	505,240.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,035,662.47
4	应收利息	-
5	应收申购款	935,194.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,476,097.36

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五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积极投资的股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
本报告期期初基金份额总额	251,129,996.51	86,502,071.54
本报告期基金总申购份额	19,906,219.01	42,160,350.32
减：本报告期基金总赎回份额	26,578,836.64	42,913,755.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	244,457,378.88	85,748,666.45

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恒生指数分级证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》；

3、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-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