鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 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。

基金托管人华泰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、净值表现和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及其更新。

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	鹏华中证港股通消费 ETF 联接
基金主代码	016952
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 5 月 18 日
报告期末基金份额总额	40,763,420.04 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。 1、目标 ETF 投资策略 本基金投资目标 ETF 的方式如下： （1）申购、赎回：按照目标 ETF 法律文件约定的方式申赎目标 ETF。 （2）二级市场方式：在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。 当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调

	整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。 本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标 ETF 的投资。 2、股票投资策略 本基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标 ETF。因此对可投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。 3、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 4、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，以增强本基金的收益。 5、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 6、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 7、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素

	基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。		
业绩比较基准	中证港股通消费主题指数收益率（经估值汇率调整）*95%+活期存款利率（税后）*5%。		
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。 本基金投资港股通标的股票，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，本基金还面临港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。		
基金管理人	鹏华基金管理有限公司		
基金托管人	华泰证券股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 A	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 C	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 I
下属分级基金的交易代码	016952	016953	022793
报告期末下属分级基金的份额总额	24,010,982.10 份	16,725,390.58 份	27,047.36 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上	风险收益特征同上

注：无。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	513590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 3 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 8 月 19 日
基金管理人名称	鹏华基金管理有限公司
基金托管人名称	华泰证券股份有限公司

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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。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。 1、股票投资策略 （1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 （2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1）定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2）不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具

	债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，以增强本基金的收益。 3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 5、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
业绩比较基准	中证港股通消费主题指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 本基金主要通过港股通投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。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，本基金还面临港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

注：无。

§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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）		
	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 A	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 C	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 I
1.本期已实现收益	-524,200.95	-361,052.37	-883.53
2.本期利润	-360,469.49	-744,662.40	3,273.30

3.加权平均基金份额本期利润	-0.0149	-0.0388	0.0645
4.期末基金资产净值	22,777,406.73	15,743,290.17	24,312.11
5.期末基金份额净值	0.9486	0.9413	0.8989

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等未实现收益。

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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），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

鹏华中证港股通消费 ETF 联接 A

阶段	净值增长率①	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	-1.64%	0.88%	-2.00%	0.95%	0.36%	-0.07%
过去六个月	-14.39%	0.93%	-16.41%	1.00%	2.02%	-0.07%
过去一年	-30.05%	1.06%	-30.65%	1.12%	0.60%	-0.06%
过去三年	1.52%	1.53%	3.69%	1.66%	-2.17%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-5.14%	1.50%	2.34%	1.65%	-7.48%	-0.15%

鹏华中证港股通消费 ETF 联接 C

阶段	净值增长率①	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	-1.68%	0.88%	-2.00%	0.95%	0.32%	-0.07%
过去六个月	-14.47%	0.93%	-16.41%	1.00%	1.94%	-0.07%
过去一年	-30.18%	1.06%	-30.65%	1.12%	0.47%	-0.06%
过去三年	0.90%	1.52%	3.69%	1.66%	-2.79%	-0.14%

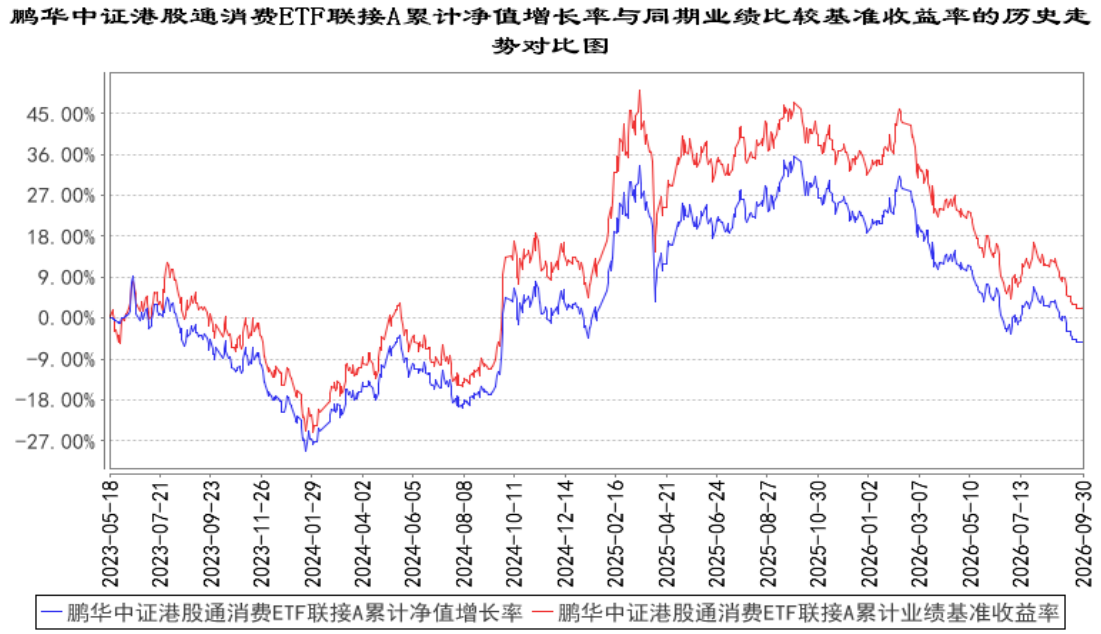
自基金合同生效起至今	-5.87%	1.50%	2.34%	1.65%	-8.21%	-0.15%

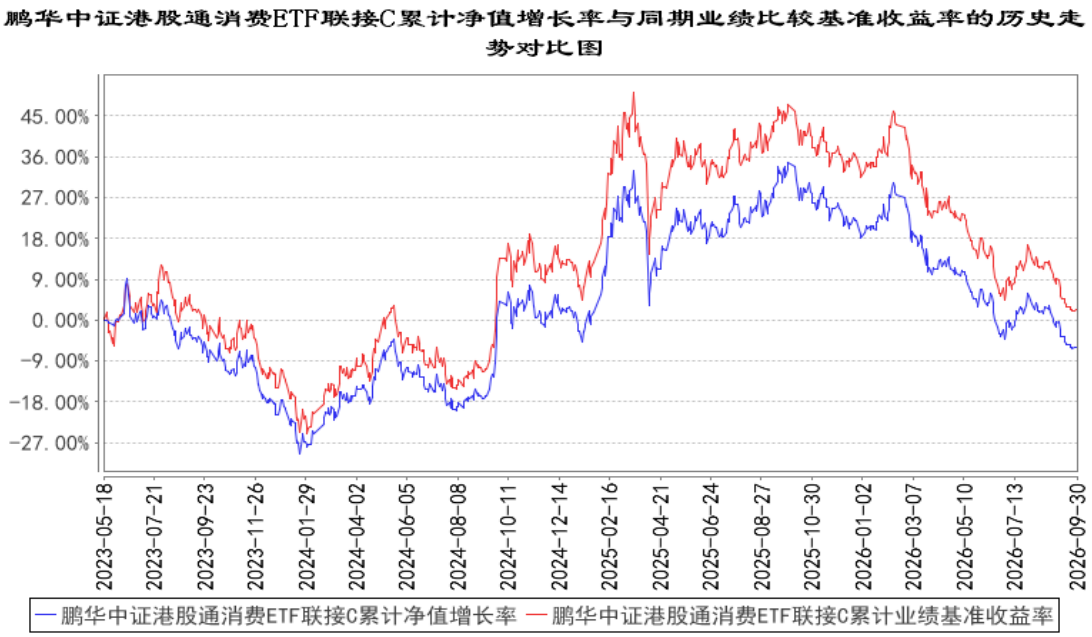
鹏华中证港股通消费 ETF 联接 I

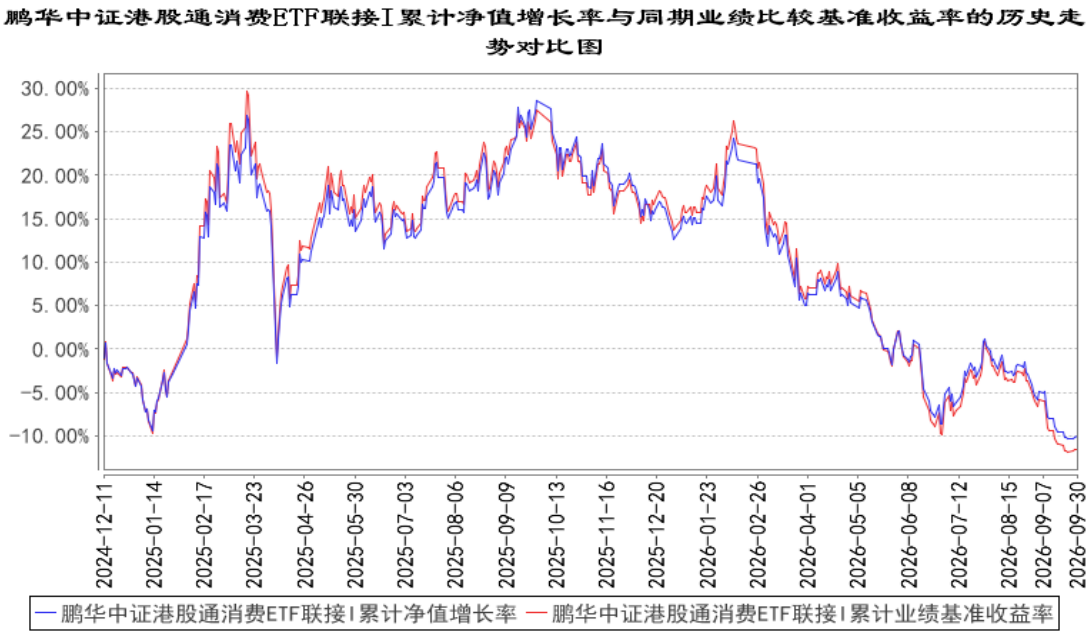
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.65%	0.88%	-2.00%	0.95%	0.35%	-0.07%
过去六个月	-14.43%	0.93%	-16.41%	1.00%	1.98%	-0.07%
过去一年	-30.11%	1.06%	-30.65%	1.12%	0.54%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-10.11%	1.47%	-11.59%	1.57%	1.48%	-0.10%

注：业绩比较基准=中证港股通消费主题指数收益率（经估值汇率调整）*95%+活期存款利率（税后）*5%。鹏华中证港股通消费 ETF 联接 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 11 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：1、本基金基金合同于 2023 年 05 月 18 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。鹏华中证港股通消费 ETF 联接 I 基金份额的首次确认日为 2024 年 12 月 11 日。

3.3 其他指标

注：无。

§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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
张羽翔	本基金的基金经理	2023-05-18	-	19 年	张羽翔先生,国籍中国,工学硕士,19 年证券从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师;2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员,先后从事金融工程、量化研究等工作;现担任指数与量化投资部基金经理。2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理,2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理,2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2020 年 12 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理,2018 年 05 月至 2021 年 10 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金（LOF）基金经理,2019 年 04 月至今担任鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019 年 07 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019 年 11 月至今担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金（LOF）基金经理,2019 年 12 月

					至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020 年 02 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020 年 03 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至今担任鹏华中证酒指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证银行指数型证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 08 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 08 月至 2026 年 06 月担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）基金经理,2021 年 12 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 07 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2022 年 11 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2023 年 05 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2024 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开

					放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2025 年 01 月至 2026 年 09 月担任鹏华恒生港股通红利指数发起式证券投资基金基金经理,2025 年 04 月至 2026 年 05 月担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 06 月至今担任鹏华国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 07 月至 2026 年 08 月担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 08 月至今担任鹏华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2025 年 11 月至今担任鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 04 月至今担任鹏华恒生港股通汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 05 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2026 年 05 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2026 年 06 月至今担任鹏华中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2026 年 08 月至今担任鹏华中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理,张羽翔先生具备基金从业资格。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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%的交易共有 6 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证港股通消费主题指数，中证港股通消费主题指数选取港股通范围内流动性较好、市值较大的 50 只消费主题相关股票组成指数样本，采用自由流通市值加权，以反映港股通内消费类股票的整体表现。

本基金采用被动式指数化投资方法，当因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

政策端持续发力助推消费提质升级，国庆消费数据验证国内消费市场具备较强韧性，消费场景持续创新、需求结构不断优化，国内消费行业长期成长动能充足。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为-1.64%，同期业绩比较基准增长率为-2.00%；C 类份额净值增长率为-1.68%，同期业绩比较基准增长率为-2.00%；I 类份额净值增长率为-1.65%，同期业绩比较基准增长率为-2.00%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2026 年 08 月 28 日至 2026 年 09 月 30 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

本基金自 2026 年 05 月 22 日至 2026 年 07 月 28 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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	36,516,582.50	94.33
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	2,153,812.12	5.56
8	其他资产	42,607.96	0.11
9	合计	38,713,002.58	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：无。

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：无。

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：无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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：无。

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：无。

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：无。

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

序号	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（%）
1	鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	鹏华基金管理有限公司	36,516,582.50	94.74

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定的证券备选库。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）

1	存出保证金	25,414.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,193.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	42,607.96

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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：无。

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 A	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 C	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 I
报告期期初基金份额总额	24,615,531.26	12,520,348.10	55,792.73
报告期期间基金总申购份额	1,537,362.80	24,189,103.55	222,016.48
减:报告期期间基金总赎回份额	2,141,911.96	19,984,061.07	250,761.85
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	24,010,982.10	16,725,390.58	27,047.36

§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

项目	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 A	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 C	鹏华中证港股通消费 ETF 联接 I
报告期期初管理人持有的本基金份额	4,621,943.70	-	-
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	4,621,943.70	-	-

金份额			
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	19.25	-	-

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§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	20260701~20260930	19,067,350.97	0.00	0.00	19,067,350.97	46.78
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

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

（一）《鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

（二）《鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

（三）《鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2026 年第 3 季度报告》（原文）。

9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（http://www.phfund.com.cn）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 10 月 26 日