嘉实中证港股通高股息投资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 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

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	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接
基金主代码	024705
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 7 月 15 日
报告期末基金份额总额	17,244,251.58 份
投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
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。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过投资目标所述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。 在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。具体投资策略包括：目标 ETF 投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
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）×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为嘉实中证港股通高股息投资 ETF 的联接基金，

	主要通过投资于嘉实中证港股通高股息投资 ETF 来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证港股通高股息投资指数及嘉实中证港股通高股息投资 ETF 的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 A	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 C
下属分级基金的交易代码	024705	024706
报告期末下属分级基金的份额总额	13,772,065.49 份	3,472,186.09 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	嘉实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	513830
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 26 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 3 月 7 日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	招商证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。 本基金的标的指数为中证港股通高股息投资指数。
业绩比较基准	经估值汇率调整后的中证港股通高股息投资指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

	本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

§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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 A	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 C
1.本期已实现收益	23,665.83	2,053.70
2.本期利润	1,239,517.42	357,713.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0931	0.0813
4.期末基金资产净值	13,912,995.59	3,496,657.26
5.期末基金份额净值	1.0102	1.0070

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）上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

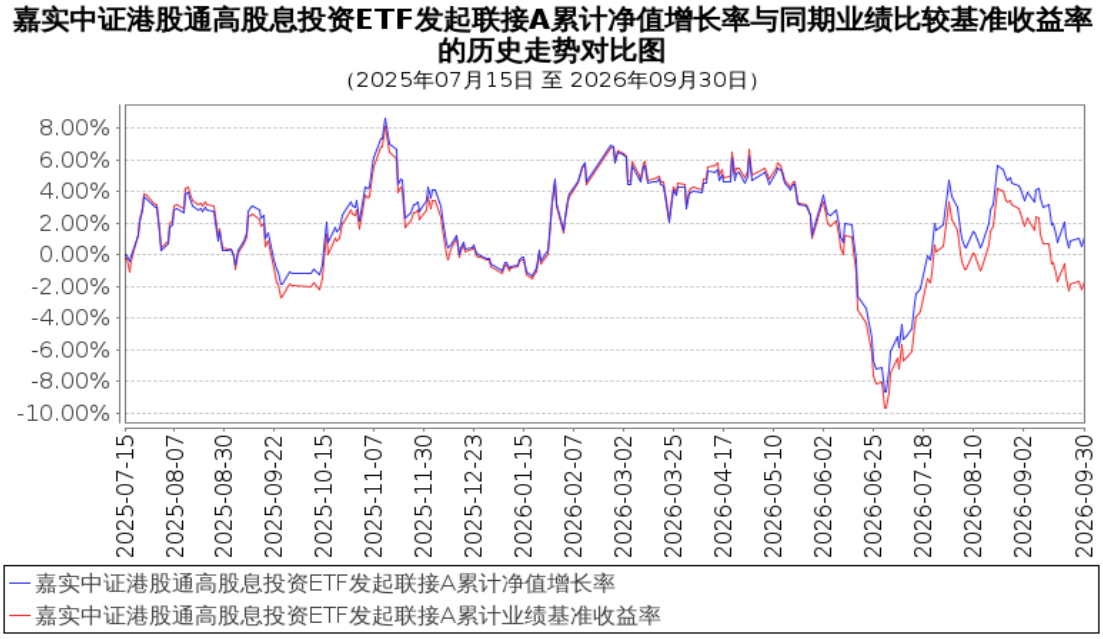
嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 A

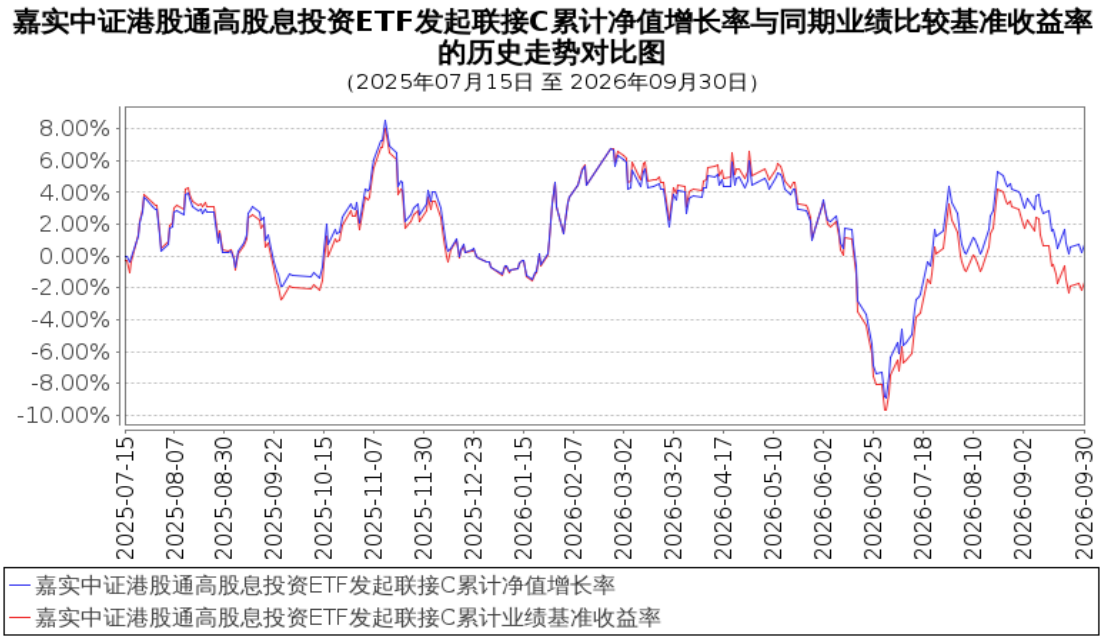
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	10.62%	0.81%	8.85%	0.83%	1.77%	-0.02%
过去六个月	-1.78%	0.81%	-4.61%	0.82%	2.83%	-0.01%
过去一年	2.27%	0.82%	0.31%	0.84%	1.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.09%	0.80%	-1.65%	0.82%	2.74%	-0.02%

嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 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	10.55%	0.81%	8.85%	0.83%	1.70%	-0.02%
过去六个月	-1.90%	0.81%	-4.61%	0.82%	2.71%	-0.01%
过去一年	1.98%	0.82%	0.31%	0.84%	1.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.75%	0.80%	-1.65%	0.82%	2.40%	-0.02%

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：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王紫菡	本基金、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实医药健康 100ETF、嘉实中证医药健康	2025 年 7 月 15 日	-	10 年	2016 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，历任指数投资部投资经理助理、投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	100 策略 ETF 联接、嘉实恒生科技 ETF（QDII）、嘉实中证海外中国互联网 30ETF（QDII）、嘉实国证绿色电力 ETF、嘉实国证绿色电力 ETF 发起联接、嘉实恒生消费 ETF 发起联接（QDII）、嘉实恒生医疗保健 ETF 发起联接（QDII）、嘉实上证科创板生物医药 ETF、嘉实恒生医疗保健 ETF（QDII）、嘉实上证科创板生物医药 ETF 发起联接、嘉实中证港股通高股息投资 ETF、嘉实恒生消费 ETF、嘉实恒生科技 ETF 发起联接				

	（QDII）、嘉实中证港股通医疗主题 ETF 基金经理				

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证港股通高股息投资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》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 2 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪中证港股通高股息投资指数，中证港股通高股息投资指数从符合港股通条件的香港上市公司证券中选取 30 只流动性好、连续分红、股息率高的上市公司证券作为指数样本，采用股息率加权，以反映港股通范围内连续分红且股息率较高的上市公司证券的整体表现。本基金的投资策略为通过投资于目标 ETF 实现基金投资目标。

三季度国内经济呈“生产出口强、内需待修复”的分化格局，出口与工业生产保持韧性，高

技术制造等新动能成为亮点，物价温和回升带动名义增长改善。政策重心明确转向稳增长，财政加快支出与政府债券发行、新型政策性金融工具落地投放，银行间流动性保持充裕。金融市场上，人民币汇率逆势走强，债券市场偏强运行，权益市场虽有所调整但季末情绪边际回暖，积极因素正在积累。三季度海外主线是能源价格高企推升输入性通胀，主要央行集体转向紧缩，长端利率普遍上行。美国经济韧性强于预期、通胀回落受阻，美联储重启加息。欧洲增长边际走弱、通胀反弹，欧央行加息。日本经济阶段性转弱，央行加息、日债利率上行、股市回落。韩国连续加息、韩元走强，股市先抑后弹。美股风险溢价压至低位，欧股估值对利率更敏感，全球资金对高估值成长与 AI 相关资产趋于谨慎。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离绝对值为 0.04%，年化跟踪误差为 1.36%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 4.00%的限制。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 A 基金份额净值为 1.0102 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.62%；截至本报告期末嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 C 基金份额净值为 1.0070 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.55%；业绩比较基准收益率为 8.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用。

§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	16,483,211.00	93.68
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	1,094,123.93	6.22
8	其他资产	18,078.22	0.10
9	合计	17,595,413.15	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

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

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

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	嘉实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	嘉实基金管理有限公司	16,483,211.00	94.68

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只基金。

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

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

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股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,266.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,811.44
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,078.22

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

无。

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 A	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 C
报告期期初基金份额总额	12,807,202.46	3,749,670.82
报告期期间基金总申购份额	1,442,974.56	6,113,498.43
减:报告期期间基金总赎回份额	478,111.53	6,390,983.16
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	13,772,065.49	3,472,186.09

注：报告期期间基金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

项目	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 A	嘉实中证港股通高股息投资 ETF 发起联接 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,333.56	1,000.23
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	10,002,333.56	1,000.23
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	72.63	0.03

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额，赎回/卖出含转换出份额、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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	现金分红	2026-09-15	-	-4,000.93	-
合计			-	-4,000.93	

§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	10,003,333.79	58.01	10,003,333.79	58.01	3 年

有资金					
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	-	-	-	-	-
合计	10,003,333.79	58.01	10,003,333.79	58.01	3 年

§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	2026-07-01 至 2026-09-30	10,003,333.79	-	-	10,003,333.79	58.01
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项。							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予嘉实中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复文件。

（2）《嘉实中证港股通高股息投资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）《嘉实中证港股通高股息投资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）《嘉实中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金公告的各项原稿。

10.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

10.3 查阅方式

（1）书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日