# 华泰柏瑞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：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 |
| 基金主代码 | 018387 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 6 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 764,603,135.03 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准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。<br>1、资产配置策略<br>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。<br>2、目标 ETF 投资策略<br>华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 是采用完全复制法实现对中证港股通高股息投资指数紧密跟踪的全被动指数基金。<br>3、成份股、备选成份股投资策略<br>根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，也可 |

| | |
|---|---|
| | 以通过买入标的指数成份股、备选成份股紧密跟踪标的指数。<br>4、存托凭证投资策略<br>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。<br>5、衍生品投资策略<br>（1）股指期货投资策略<br>本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。<br>（2）股票期权投资策略<br>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。<br>6、债券投资策略<br>本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。<br>7、资产支持证券投资策略<br>资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。<br>8、融资及转融通证券出借业务投资策略<br>本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证港股通高股息投资指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 的联接基金，主要投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证港股通高股息投资指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金可投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除需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，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |

| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | | |
|---|---|---|---|
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 A | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 C | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 I |
| 下属分级基金的交易代码 | 018387 | 018388 | 022663 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 356,116,385.93 份 | 357,027,131.65 份 | 51,459,617.45 份 |

## 2.1.1 目标基金基本情况

| 基金名称 | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII） |
|---|---|
| 基金主代码 | 513530 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 4 月 8 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2022 年 4 月 25 日 |
| 基金管理人名称 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 交通银行股份有限公司 |

## 2.1.2 目标基金产品说明

| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数表现，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，年化跟踪误差控制在 4%以内。 |
|---|---|
| 投资策略 | 1、股票的投资策略<br>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：当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，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。<br>但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，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，追求尽可能贴近目标指数的表现。<br>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）其他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。<br>在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。<br>2、债券的投资策略<br>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。<br>其中可转换债券和可交换债券，结合了权益类证券与固定收益类证券的 |

| | |
|---|---|
| | 特性，具有下行风险有限同时可分享基础股票价格上涨的特点。本基金将评估其内在投资价值，结合对可转换债券、可交换债券市场上的溢价率及其变动趋势、行业资金的配置以及基础股票基本面的综合分析，最终确定其投资权重及具体品种。<br>3、股指期货的投资策略<br>本基金投资股指期货时，将严格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等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。<br>4、资产支持证券的投资策略<br>资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。<br>5、融资及转融通证券出借业务<br>本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。<br>本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。<br>6、存托凭证投资策略<br>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 业绩比较基准 | 业绩比较基准为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中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。<br>本基金主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除需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，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

# §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） | | |
|---|---|---|---|
| | 华泰柏瑞中证港股通高股息 | 华泰柏瑞中证港股通高股息 | 华泰柏瑞中证港股通高股 |

| | 投资 ETF 发起式联接 A | 投资 ETF 发起式联接 C | 息投资 ETF 发起式联接 I |
|---|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 7,176,370.17 | 7,449,063.95 | 1,603,212.74 |
| 2.本期利润 | 43,564,896.82 | 50,422,040.17 | 10,455,849.80 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1271 | 0.1326 | 0.1361 |
| 4.期末基金资产净值 | 476,225,708.34 | 471,685,898.92 | 68,525,384.75 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3373 | 1.3211 | 1.3316 |

注：1、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。

2、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。

## 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

华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 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 | 10.57% | 0.80% | 8.77% | 0.81% | 1.80% | -0.01% |
| 过去六个月 | -1.51% | 0.80% | -4.82% | 0.81% | 3.31% | -0.01% |
| 过去一年 | 2.34% | 0.81% | -0.34% | 0.83% | 2.68% | -0.02% |
| 过去三年 | 42.39% | 1.04% | 32.64% | 1.08% | 9.75% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.57% | 1.02% | 29.01% | 1.07% | 12.56% | -0.05% |

华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 C

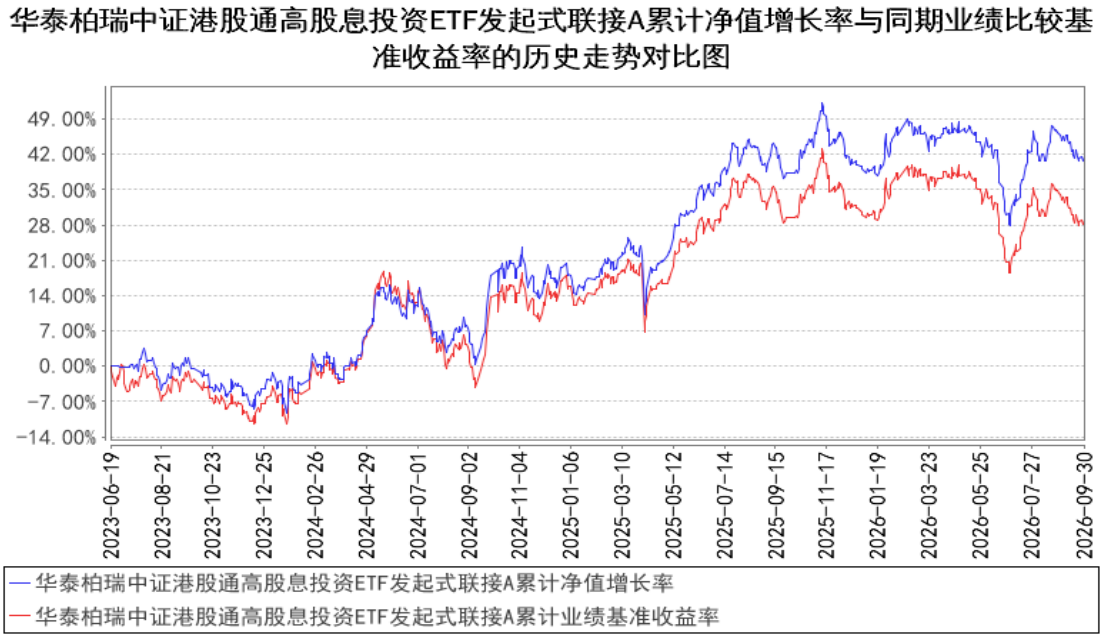
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 10.50% | 0.80% | 8.77% | 0.81% | 1.73% | -0.01% |
| 过去六个月 | -1.64% | 0.80% | -4.82% | 0.81% | 3.18% | -0.01% |

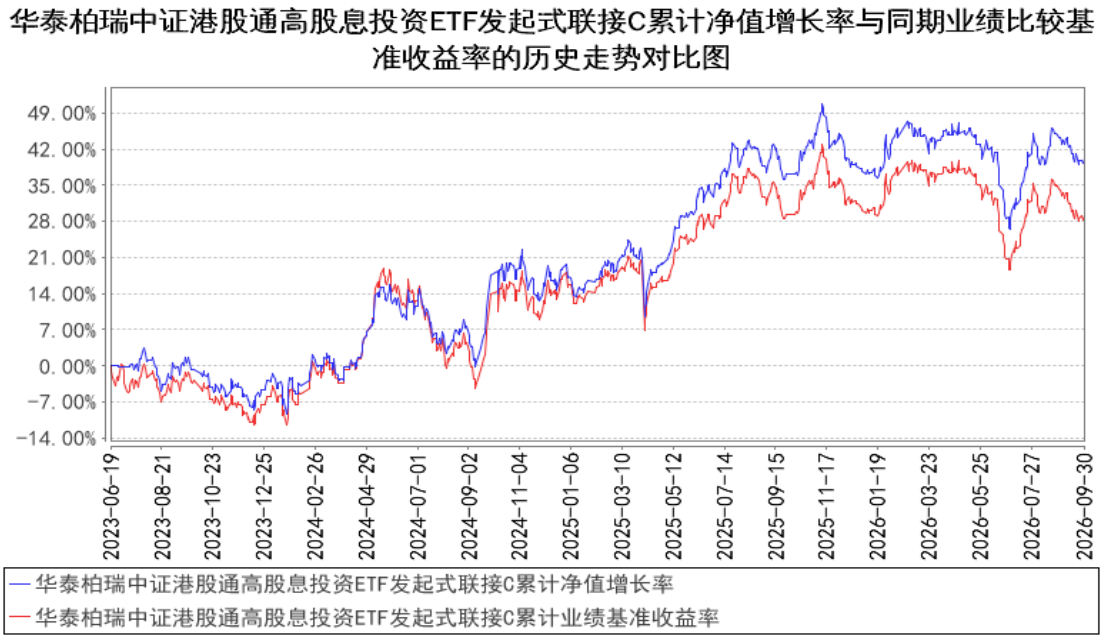
| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一年 | 2.08% | 0.81% | -0.34% | 0.83% | 2.42% | -0.02% |
| 过去三年 | 40.83% | 1.04% | 32.64% | 1.08% | 8.19% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 39.94% | 1.02% | 29.01% | 1.07% | 10.93% | -0.05% |

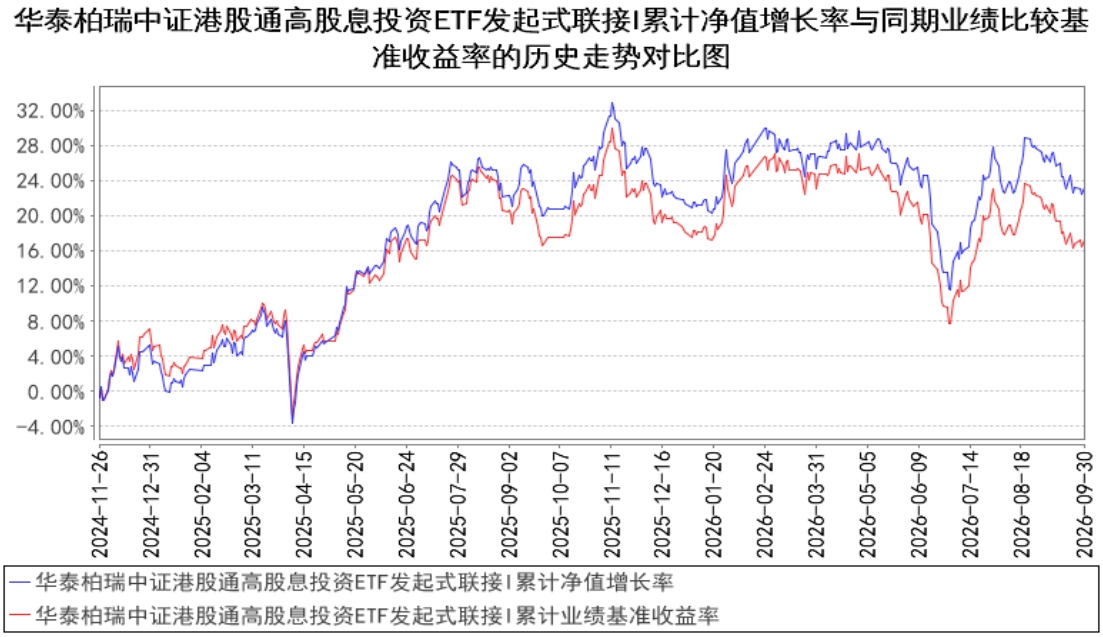
华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 I

| 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 | 10.25% | 0.80% | 8.77% | 0.81% | 1.48% | -0.01% |
| 过去六个月 | -1.82% | 0.80% | -4.82% | 0.81% | 3.00% | -0.01% |
| 过去一年 | 1.93% | 0.81% | -0.34% | 0.83% | 2.27% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.16% | 0.92% | 17.19% | 0.95% | 5.97% | -0.03% |

### 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：A 类图示日期为 2023 年 6 月 19 日至 2026 年 09 月 30 日。C 类图示日期为 2023 年 6 月 19 日至 2026 年 09 月 30 日。I 类图示日期为 2024 年 11 月 26 日至 2026 年 09 月 30 日。

# §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 | | |
| 李茜 | 指数投资部总监助理、本基金的基金 | 2023 年 6 月 19 日 | - | 11 年 | 伦敦政治经济学院金融数学硕士。曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 经理 | | | | 2019 年 11 月至 2022 年 12 月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞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 2 月至 2024 年 5 月任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2026 年 4 月任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华泰柏瑞中证港股通 50 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。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利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 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证港股通金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞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的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产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。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 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。2024 年 3 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月起任华泰柏瑞中证 A50 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 9 月起任华泰柏瑞恒生港股通红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞恒生创新药交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金的基金经理。2024 年 12 月至 2026 年 2 月任华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月至 2026 年 2 月任华泰柏瑞上证 180 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 9 月起任华泰柏瑞中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒生港股通红利低波动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 月起任华泰柏瑞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。2026 年 5 月起任华泰柏瑞中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月起任华泰柏瑞中证全指证券公司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。 |

### 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

## 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，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，

确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的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%的交易共有 1 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

回顾三季度，随着前期科技成长板块估值与交易拥挤度快速抬升，市场风格发生明显再平衡，资金重新回流高股息、低估值、现金流稳定的红利资产，红利风格相较成长类资产呈现显著相对收益优势。三季度港股通高股息全收益指数上涨 9.69%。

展望 2026 年四季度，红利资产所处的宏观与制度环境仍然总体有利。当前国内经济仍处于弱修复阶段，政策有望继续加大逆周期调节力度，流动性环境保持合理充裕，而外部不确定性与市场风险偏好波动仍可能反复。在这种背景下，具备稳定现金流、持续分红能力和估值安全边际的红利资产，仍有望继续发挥组合底仓和波动管理工具的作用。从资金面看，随着保险资产负债管理新规落地，红利资产对险资的配置吸引力进一步增强，若五大上市险企落实全年 30%入市目标，Q3-Q4 潜在增量资金规模可观，红利资产仍可能迎来中长期资金增配。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 A 的基金份额净值为 1.3373 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.57%，同期业绩比较基准收益率为 8.77%，截至本报告期末华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 C 的基金份额净值为 1.3211 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.50%，同期业绩比较基准收益率为 8.77%，截至本报告期末华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 I 的基金份额净值为 1.3316 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.25%，同期业绩比较基准收益率为 8.77%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §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 | 962,445,800.81 | 94.23 |
| 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 | 56,149,974.98 | 5.50 |
| 8 | 其他资产 | 2,783,837.90 | 0.27 |
| 9 | 合计 | 1,021,379,613.69 | 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：本基金本报告期末未持有股票。

### 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：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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：本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 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。

## 5.5 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：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。

## 5.7 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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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：本基金本报告期末未持有权证。

## 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 | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII） | 指数型 | 交易型开放式 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 962,445,800.81 | 94.69 |

## 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：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 100,993.51 |

| | | |
|---|---|---|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,682,844.39 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,783,837.90 |

### 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。

### 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，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 | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 A | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 C | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 I |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 326,579,796.87 | 383,430,746.92 | 80,268,249.33 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 87,958,055.62 | 182,548,223.45 | 11,530,110.28 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 58,421,466.56 | 208,951,838.72 | 40,338,742.16 |
| 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 | 356,116,385.93 | 357,027,131.65 | 51,459,617.45 |

## §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 | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 A | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 C | 华泰柏瑞中证港股通高股息投资 ETF 发起式联接 I |
|---|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,001,350.00 | - | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 10,001,350.00 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - | - | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - | - | - |

### 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 | 赎回 | 2026-07-27 | 10,001,350.00 | -13,584,833.71 | - |
| 合计 | | | 10,001,350.00 | -13,584,833.71 | |

## §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 | - | - | 10,001,350.00 | 1.31 | 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 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | 10,001,350.00 | 1.31 | - |

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

## §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

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

## 10.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

## 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

**华泰柏瑞基金管理有限公司**

**2026 年 10 月 27 日**