华夏中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏中证沪深港黄金产业股票 ETF
场内简称	黄金股 ETF 华夏
基金主代码	159562
交易代码	159562
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 1 月 11 日
报告期末基金份额总额	2,638,130,504.00 份
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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，衍生品投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证沪深港黄金产业股票指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 基金资产投资于港股，会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，包括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	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	-93,527,372.25
2.本期利润	644,385,759.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.2673
4.期末基金资产净值	5,380,349,820.64
5.期末基金份额净值	2.0395

注：①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。

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。

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

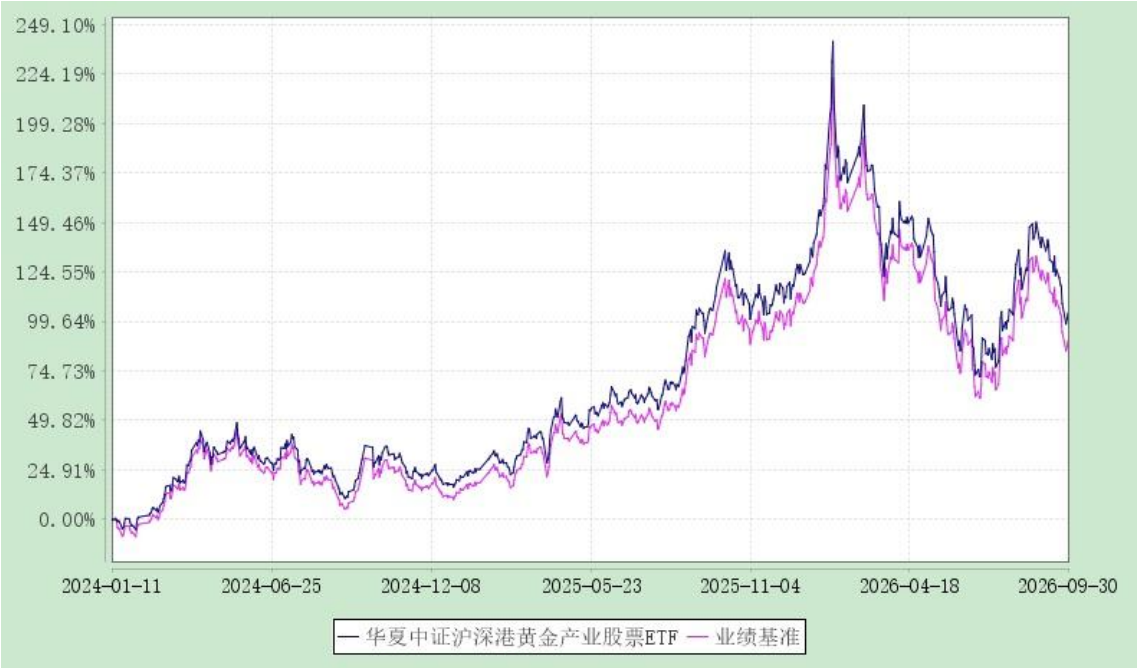
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18.52%	2.96%	17.86%	2.97%	0.66%	-0.01%
过去六个月	-16.40%	2.90%	-17.77%	2.91%	1.37%	-0.01%
过去一年	-5.91%	2.96%	-6.70%	2.98%	0.79%	-0.02%
自基金合同生效起至今	103.95%	2.35%	89.93%	2.38%	14.02%	-0.03%

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

华夏中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2024 年 1 月 11 日至 2026 年 9 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		
华龙	本基金的基金经理	2024-01-11	-	10 年	硕士。2016 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏粤港澳大湾区创新 100 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（2022 年 8 月 22 日至 2023 年 5 月 4 日期间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022 年 8 月 22 日至 2023 年 12 月 27 日期间)、华夏中证全指运输交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2023 年 1 月 13 日至 2024 年 11 月 7 日期间)、华夏中证全指运输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（2023 年 9 月 27 日至 2024 年 11 月 7

					日期间)、华夏中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2023 年 11 月 23 日至 2025 年 10 月 13 日期间)、华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2024 年 2 月 1 日至 2025 年 10 月 13 日期间)、华夏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基金经理（2024 年 4 月 30 日至 2025 年 10 月 13 日期间)、华夏创业板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（2024 年 5 月 14 日至 2025 年 10 月 13 日期间)、华夏创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2024 年 1 月 23 日至 2026 年 1 月 16 日期间)、华夏创业板 200 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 3 月 5 日至 2026 年 1 月 16 日期间)等。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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 32 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证沪深港黄金产业股票指数，中证沪深港黄金产业股票指数从内地与香港市场中，选取 50 只市值较大且业务涉及黄金采掘、冶炼、销售的上市公司证券作为指数样本，以反映内地与香港市场中黄金产业上市公司证券的整体表现。本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

宏观层面，三季度国内宏观延续了“外需强，内需弱”的格局，出口高增对工业生产形成强支撑，固定资产投资累计同比转负是拖累内需的核心因素，消费端数据持续低迷，内需修复乏力。数据方面，7-8 月制造业 PMI 连续位于枯荣线下方，反映制造业景气度偏弱，CPI 相对温和，受全球能源价格上涨影响 PPI 处于相对高位。美国方面，美联储 9 月加息 25bp，符合市场预期，同时会后点阵图显示年内或再加息一次。

市场层面，权益市场整体呈现震荡下行走势：7 月以来，美伊局势再度紧张，原油价格大幅飙升导致市场对未来通胀担忧，权益市场开启回调走势。分板块而言，银行、煤炭、农林牧渔、石油石化等防御板块表现相对靠前，电子、通信、建材、电力设备新能源等前期强势板块表现相对靠后。港股方面，或因前期超跌及全球资金再平衡需求，港股整体表现强于 A 股。

基金投资运作方面，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。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、长江证券股份有限公司等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 2.0395 元，本报告期份额净值增长率为 18.52%，同期经估值汇率调整的业绩比较基准增长率 17.86%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.66%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金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	5,351,897,073.79	99.22
	其中：股票	5,351,897,073.79	99.22

2	基金投资	-	-
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	39,959,715.15	0.74
8	其他各项资产	1,908,752.84	0.04
9	合计	5,393,765,541.78	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 1,539,249,843.78 元，占基金资产净值比例为 28.61%。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,820,864,042.74	52.43
C	制造业	809,961,030.63	15.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	549,873.82	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	181,268,507.82	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,812,643,455.01	70.86

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	1,305,983,999.06	24.27
非必需消费品	233,265,844.72	4.34
保健	-	-
必需消费品	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
通讯服务	-	-
信息技术	-	-
合计	1,539,249,843.78	28.61

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	19,625,800	584,652,582.00	10.87
1	02899	紫金矿业	7,128,000	197,270,684.58	3.67
2	600988	赤峰黄金	12,828,400	507,491,504.00	9.43
2	06693	赤峰黄金	1,458,800	45,482,195.65	0.85
3	600547	山东黄金	13,931,916	380,341,306.80	7.07

3	01787	山东黄金	7,676,250	128,230,629.38	2.38
4	600489	中金黄金	22,418,978	490,975,618.20	9.13
5	000975	山金国际	12,820,527	291,795,194.52	5.42
6	02099	中国黄金国际	1,252,100	236,892,021.11	4.40
7	01818	招金矿业	13,330,500	206,549,178.97	3.84
8	002155	湖南黄金	8,428,832	195,548,902.40	3.63
9	02259	紫金黄金国际	1,444,600	175,842,426.84	3.27
10	03939	万国黄金集团	13,604,500	158,125,196.01	2.94

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,395,742.53
2	应收证券清算款	440,392.71
3	应收股利	72,617.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,908,752.84

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	2,190,130,504.00
报告期期间基金总申购份额	933,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	485,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,638,130,504.00

§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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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

<table>
<tr><td rowspan="2">投资者类别</td><td colspan="5">报告期内持有基金份额变化情况</td><td colspan="2">报告期末持有基金情况</td></tr>
<tr><td>序号</td><td>持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间</td><td>期初份额</td><td>申购份额</td><td>赎回份额</td><td>持有份额</td><td>份额占比</td></tr>
<tr><td>华夏中证沪深港黄金产业股票ETF发起式联接</td><td>1</td><td>2026-07-01 至 2026-09-30</td><td>1,176,380,102.00</td><td>342,888,020.00</td><td>182,057,337.00</td><td>1,337,210,785.00</td><td>50.69%</td></tr>
<tr><td colspan="8">产品特有风险</td></tr>
<tr><td colspan="8">本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。
在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</td></tr>
</table>

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2026 年 8 月 27 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及

沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人、首批公募 REITs 指数基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

2、基金合同；

3、托管协议；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日