汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（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：中国工商银行股份有限公司

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、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	汇添富中证环境治理指数（LOF）
基金主代码	501030
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日
报告期末基金份额总额(份)	318,141,113.46
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪中证环境治理指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间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%。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略； 股票投资组合构建；固定收益资产投资策略；股指期货、权证、国债期货、股票期权等金融衍生工具投资策略；融资及转融通投资策略；存托凭证的投资策略。	
业绩比较基准	中证环境治理指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率(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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，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。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证环境治理指数（LOF）A	汇添富中证环境治理指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	环境治理	环境 C
下属分级基金的交易代码	501030	501031
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	199,459,160.77	118,681,952.69

注：汇添富中证环境治理指数（LOF）A 类份额扩位证券简称：环境治理 LOF；汇添富中证环境治理指数（LOF）C 类份额扩位证券简称：环境治理 LOFC。

§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)	
	汇添富中证环境治理指数（LOF）A	汇添富中证环境治理指数（LOF）C
1.本期已实现收益	96,034.03	-23,888.44
2.本期利润	-8,107,838.25	-4,575,105.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0403	-0.0365
4.期末基金资产净值	103,287,457.92	59,768,796.03
5.期末基金份额净值	0.5178	0.5036

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

汇添富中证环境治理指数（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	-7.34%	1.36%	-7.84%	1.40%	0.50%	-0.04%
过去六个月	-11.46%	1.31%	-12.07%	1.35%	0.61%	-0.04%
过去一年	-10.63%	1.27%	-10.67%	1.30%	0.04%	-0.03%
过去三年	7.25%	1.46%	6.81%	1.47%	0.44%	-0.01%
过去五年	-19.76%	1.37%	-20.39%	1.38%	0.63%	-0.01%
过去七年	-6.03%	1.38%	-10.86%	1.40%	4.83%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-48.22%	1.40%	-52.34%	1.42%	4.12%	-0.02%
汇添富中证环境治理指数（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	-7.43%	1.36%	-7.84%	1.40%	0.41%	-0.04%
过去六个月	-11.62%	1.31%	-12.07%	1.35%	0.45%	-0.04%
过去一年	-10.99%	1.27%	-10.67%	1.30%	-0.32%	-0.03%
过去三年	5.98%	1.46%	6.81%	1.47%	-0.83%	-0.01%
过去五年	-21.34%	1.37%	-20.39%	1.38%	-0.95%	-0.01%
过去七年	-8.60%	1.38%	-10.86%	1.40%	2.26%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-49.64%	1.40%	-52.34%	1.42%	2.70%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效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





注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016 年 12 月 29 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。

§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		
赖中立	本基金的基金经理	2025 年 10 月 24 日	-	19	国籍：中国。学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012 年 11 月 1 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理。2014 年 3 月 6 日至 2023 年 4 月 13 日任汇添富恒生指数型证券投资基金

					（QDII-LOF）的基金经理。2015 年 1 月 6 日至 2023 年 4 月 13 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 1 月 6 日至 2023 年 4 月 13 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2023 年 4 月 13 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。2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 11 月 24 日

					至 2023 年 4 月 13 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。2021 年 10 月 26 日至 2023 年 8 月 23 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。2021 年 10 月 26 日至今任汇添富中证光伏产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至今任汇添富中证科创创业 50 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 5 日至 2023 年 7 月 31 日任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 1 月

					31 日至 2025 年 9 月 17 日任汇添富稳乐回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 24 日至 2026 年 7 月 11 日任汇添富华证专精特新 100 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 24 日至今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。

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 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。

4.3 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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内 A 股市场表现疲软，期间上证指数下跌 6.16%，沪深 300 下跌 12.49%，创业板指数下跌 27.80%。

本报告期国内宏观延续总量偏弱、结构分化的运行格局，内需修复动能仍存阻滞，供给端高端制造、新质生产力相关产业维持韧性。外部环境不确定性抬升，全球通胀反复、主要

经济体货币政策预期波动叠加地缘扰动，推升全球长端利率，对外资风险偏好与成长资产估值形成约束。国内宏观政策坚持以我为主，货币政策维持适度宽松基调，流动性保持充裕，政策重心强化逆周期调节，侧重结构性工具发力，财政端注重存量政策落地与重点领域资金配套，总量层面未实施强刺激。经济内部新旧动能差异延续，传统内需板块调整进程偏长，AI 算力、高端装备等产业资本开支保持扩张，成为经济结构中主要的增长支撑。

A 股市场在三季度进入业绩验证窗口，整体呈震荡整固态势，前期高景气成长板块经历估值消化，市场风格由极致抱团向相对均衡再平衡。交易活跃度边际回落，资金博弈重心从远期景气预期转向订单兑现与盈利质量检验，板块内部加速去伪存真，缺乏落地业务的标的估值持续收缩。红利类资产、部分低位周期板块获得资金防御性配置，展现相对收益。机构持仓结构调整，长线资金配置更加注重现金流确定性，高低板块轮动特征增强。

行情定价同时受外部贴现率扰动与国内基本面预期共同约束，市场整体仍处于存量博弈环境。新质生产力主线中长期产业逻辑并未破坏，但短期估值扩张受限，板块波动放大；内需相关板块受制于盈利修复偏弱，估值修复缺乏持续性。整体而言，三季度是宏观预期、产业景气与估值水平重新匹配的阶段，市场定价框架进一步向基本面兑现回归，结构性机会仍集中在具备真实订单与技术壁垒的细分领域。报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行指数化投资，严控基金跟踪误差，以期为投资者带来与跟踪指数一致的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证环境治理指数（LOF）A 类份额净值增长率为-7.34%，同期业绩比较基准收益率为-7.84%。本报告期汇添富中证环境治理指数（LOF）C 类份额净值增长率为-7.43%，同期业绩比较基准收益率为-7.84%。

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	151,578,570.32	92.74
	其中：股票	151,578,570.32	92.74
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	11,764,316.84	7.20
8	其他资产	99,880.79	0.06
9	合计	163,442,767.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
C	制造业	52,584,748.07	32.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,113,904.84	12.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,561,024.00	2.18
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	2,723,344.00	1.67
M	科学研究和技术服务业	2,767,722.00	1.70

N	水利、环境和公共设施管理业	69,827,827.41	42.82
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	151,578,570.32	92.96

5.2.2 报告期末积极投资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积极投资的境内股票。

5.2.3 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	603588	高能环境	254,596	4,211,017.84	2.58
2	301127	武汉天源	253,233	3,798,495.00	2.33
3	300203	聚光科技	269,507	3,643,734.64	2.23
4	000753	漳州发展	654,600	3,561,024.00	2.18
5	000598	兴蓉环境	490,649	3,463,981.9	2.12

				4	
6	301175	中科环保	614,470	3,428,742.60	2.10
7	003039	顺控发展	273,500	3,416,015.00	2.09
8	000685	中山公用	319,800	3,412,266.00	2.09
9	002266	浙富控股	734,400	3,400,272.00	2.09
10	301500	飞南资源	139,040	3,364,768.00	2.06

5.3.2 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投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,594.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	81,285.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,880.79

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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	汇添富中证环境治理指数（LOF）A	汇添富中证环境治理指数（LOF）C
本报告期期初基金份额总额	202,638,619.06	88,531,159.37
本报告期基金总申购份额	14,148,964.96	75,114,166.48
减：本报告期基金总赎回份额	17,328,423.25	44,963,373.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	199,459,160.77	118,681,952.69

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

7.2 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中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（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