汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金
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	汇添富沪港深大盘价值混合
基金主代码	005504
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 02 月 13 日
报告期末基金份额总额(份)	233,472,009.94
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以深入的基本面分析为立足点，精选价值被低估、具备长期稳定增长能力的大盘价值型股票，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘优质的大盘价值型股票。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、权证投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*65%+中债综合财富指数收益率*20%+沪深 300 指数收益率*15%

风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。		
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	汇添富沪港深大盘价值混合 A	汇添富沪港深大盘价值混合 C	汇添富沪港深大盘价值混合 D
下属分级基金的交易代码	005504	015118	015119
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	230,447,697.11	2,844,127.72	180,185.11

§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)		
	汇添富沪港深大盘价值混合 A	汇添富沪港深大盘价值混合 C	汇添富沪港深大盘价值混合 D
1.本期已实现收益	-1,589,124.43	-23,014.73	-1,268.55
2.本期利润	-28,087,609.09	-348,836.49	-22,983.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1211	-0.1209	-0.1273
4.期末基金资产净值	166,000,520.95	1,997,276.86	127,445.75
5.期末基金份额净值	0.7203	0.7022	0.7073

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

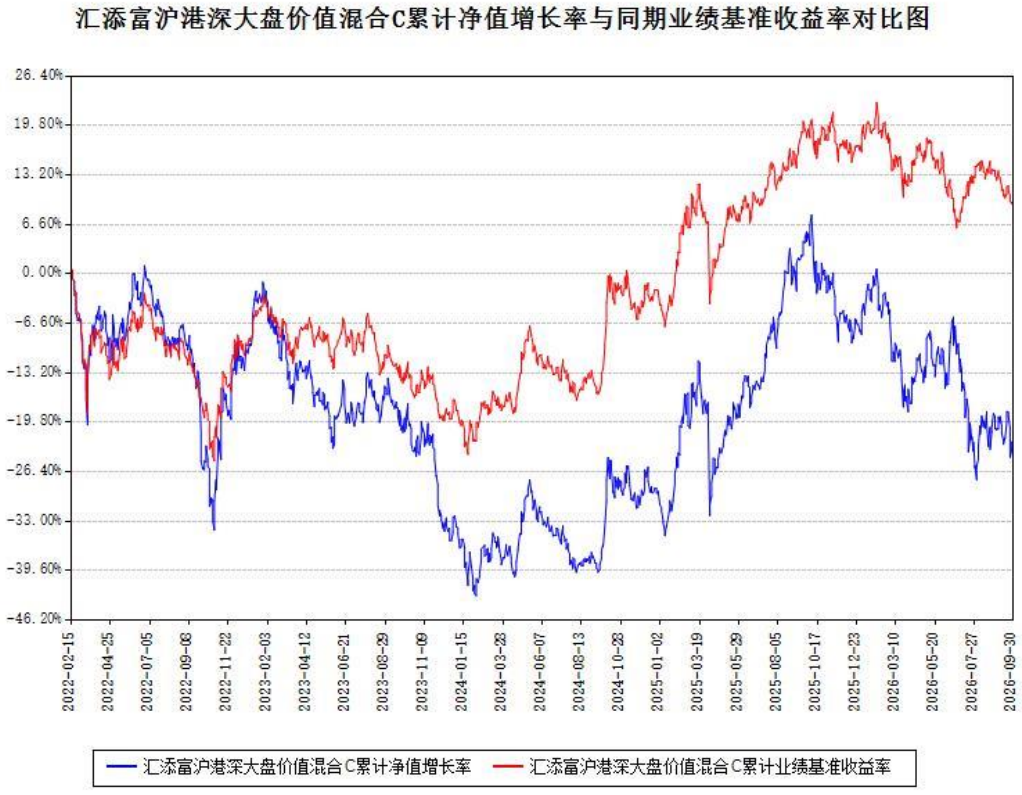
汇添富沪港深大盘价值混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

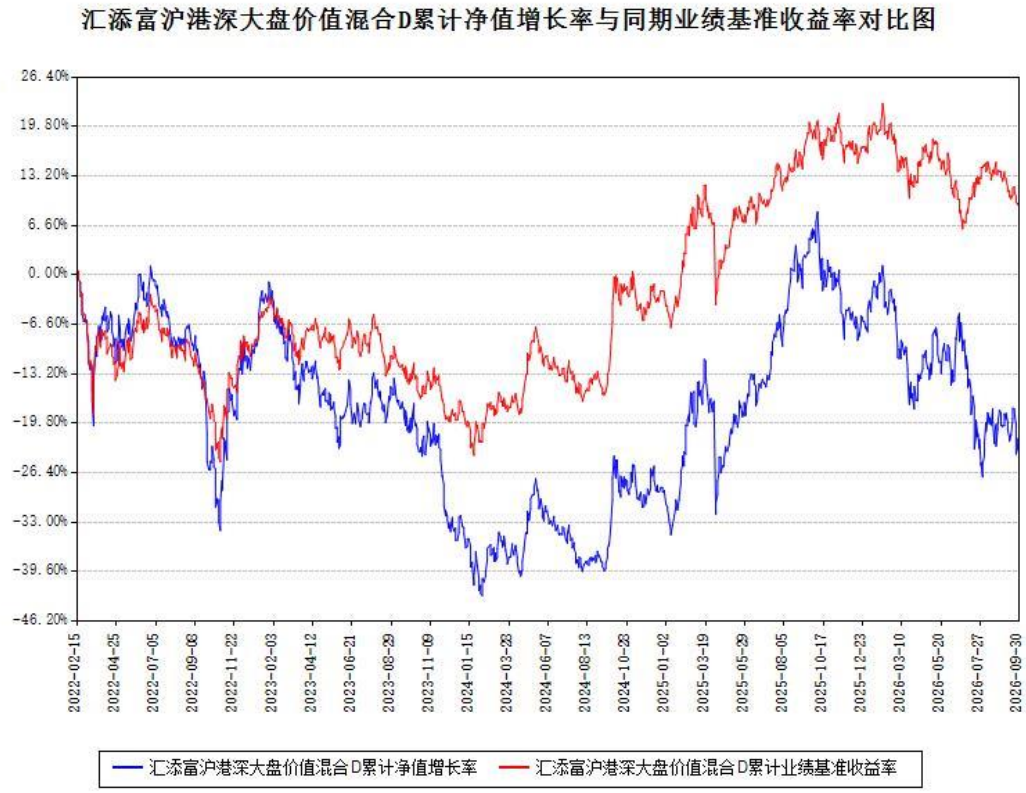
				④		
过去三个月	-14.30%	2.23%	2.34%	0.70%	-16.64%	1.53%
过去六个月	-4.57%	2.08%	-1.91%	0.78%	-2.66%	1.30%
过去一年	-27.59%	1.84%	-9.07%	0.84%	-18.52%	1.00%
过去三年	-2.40%	1.79%	26.19%	1.01%	-28.59%	0.78%
过去五年	-37.19%	1.76%	7.56%	1.09%	-44.75%	0.67%
过去七年	-20.13%	1.74%	4.62%	1.07%	-24.75%	0.67%
自基金合同生效起至今	-27.97%	1.64%	6.63%	1.04%	-34.60%	0.60%
汇添富沪港深大盘价值混合 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	-14.43%	2.23%	2.34%	0.70%	-16.77%	1.53%
过去六个月	-4.88%	2.08%	-1.91%	0.78%	-2.97%	1.30%
过去一年	-28.04%	1.84%	-9.07%	0.84%	-18.97%	1.00%
过去三年	-3.91%	1.79%	26.19%	1.01%	-30.10%	0.78%
自基金合同生效起至今	-22.37%	1.78%	9.59%	1.10%	-31.96%	0.68%
汇添富沪港深大盘价值混合 D						
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	-14.38%	2.23%	2.34%	0.70%	-16.72%	1.53%
过去六个月	-4.75%	2.08%	-1.91%	0.78%	-2.84%	1.30%
过去一年	-27.89%	1.84%	-9.07%	0.84%	-18.82%	1.00%
过去三年	-3.35%	1.80%	26.19%	1.01%	-29.54%	0.79%
自基金合同生效起至今	-21.80%	1.78%	9.59%	1.10%	-31.39%	0.68%

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


汇添富沪港深大盘价值混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图
46.00%
36.80%
27.60%
18.40%
9.20%
0.00%
-9.20%
-18.40%
-27.60%
-36.80%
-46.00%
-55.20%
2018-02-13
2018-06-28
2018-11-02
2019-03-14
2019-07-19
2019-11-27
2020-04-09
2020-08-18
2020-12-28
2021-05-12
2021-09-14
2022-01-26
2022-06-13
2022-10-21
2023-03-01
2023-07-11
2023-11-16
2024-03-27
2024-08-02
2024-12-12
2025-04-25
2025-09-02
2026-01-13
2026-05-29
2026-09-30
汇添富沪港深大盘价值混合A累计净值增长率
汇添富沪港深大盘价值混合A累计业绩基准收益率


汇添富沪港深大盘价值混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图
26.40%
19.80%
13.20%
6.60%
0.00%
-6.60%
-13.20%
-19.80%
-26.40%
-33.00%
-39.60%
-46.20%
2022-02-15
2022-04-25
2022-07-05
2022-09-08
2022-11-22
2023-02-03
2023-04-12
2023-06-21
2023-08-29
2023-11-09
2024-01-15
2024-03-28
2024-06-07
2024-08-13
2024-10-28
2025-01-02
2025-03-19
2025-05-29
2025-08-05
2025-10-17
2025-12-23
2026-03-10
2026-05-20
2026-07-27
2026-09-30
汇添富沪港深大盘价值混合C累计净值增长率
汇添富沪港深大盘价值混合C累计业绩基准收益率



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018 年 02 月 13 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。

本基金于 2022 年 02 月 14 日新增 C、D 类份额。

§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		
陈健玮	本基金的基金经理	2018 年 02 月 13 日	-	16	国籍：中国香港。学历：香港大学土木工程学士，中欧国际工商学院工商管理硕士（MBA）。从业资格：证券投资基金

					从业资格。 从业经历：曾任德勤·关黄陈方会计师行（香港）环球金融服务组审计师，国投瑞银基金管理有限公司国际业务部研究员、投资经理助理、投资经理，博时基金管理有限公司投资经理。2017 年 4 月加入汇添富资产管理（香港）有限公司。2018 年 2 月 13 日至今任汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 21 日至 2024 年 1 月 29 日任汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 28 日至 2024 年 12 月 6 日任汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金

					的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2024 年 4 月 17 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。

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

回顾 2026 年三季度，港股市场受国内外多重因素影响，整体波动加剧，走势呈现先反弹上行、后震荡回调的特征。三季度影响港股市场的核心因素包括海外流动性、地缘政治、人工智能产业进展等。海外流动性层面，美联储重启加息，在通胀预期升温叠加 AI 领域资金需求大幅抬升的背景下，美国长端国债收益率持续上行，对港股流动性环境造成影响。地缘政治方面，中东地缘冲突再起，美伊谈判破裂后地缘局势进一步升级，霍尔木兹海峡通行承压、曼德海峡航运亦受扰动。科技方面，人工智能产业发展提速，但三季度市场对 AI 的交易叙事发生转变，关注点转向 AI 投资的长期可持续性、AI 安全等议题。尽管海外不确定性持续扰动港股，央行行长潘功胜表态，国家外汇储备将继续提升在港资产配置比例，一定程度提振了港股投资者的信心。整体来看，三季度恒生指数录得上涨，但港股市场内部结构性分化极其显著，市场风格迎来再平衡。

本基金在三季度维持较为平稳的仓位水平，延续“行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整”的投资策略。基金运作过程中，重点关注企业长期基本面与估值的匹配度，核心配置具备核心竞争力、经营稳健的龙头企业，力求以合理或偏低的估值水平进行投资布局，并适度采取逆向投资策略。三季度港股市场延续快速风格轮动特征，市场资金从二季度集中

布局的人工智能相关板块，逐步转向能源、医疗保健、金融等板块，同时个股波动有所抬升。整体来看，港股近期的调整已较大程度定价风险偏好回落、市场流动性偏紧的各类预期。本报告期内，本组合根据市场行情适度优化调仓。一方面，增配低估值的优质标的，包括短期受海外资金面压制、但基本面扎实稳健的贵金属及有色金属板块；另一方面，收缩科技行业投资范围，聚焦盈利增长确定性高、行业竞争格局优良、核心技术具备领先壁垒的优质科技标的。在无风险收益率上行的市场环境下，组合进一步加大配置当期盈利确定性强、估值处于合理低位的个股，减持估值与市场预期偏高、业绩兑现高度依赖远期利润贡献的标的。此外，组合维持对创新药板块的较高关注，创新药和 AI 制药在临床进展和对外合作方面均维持良好趋势。中长期来看，人工智能产业仍处于高速迭代发展周期，应用场景持续拓宽，从编程逐步延伸至智能办公、个人智能体、科研辅助等多元领域，未来将持续催生全新商业模式、赋能科研创新发展。我国人工智能产业具备显著发展优势，我们长期看好行业发展前景。因此，组合在持续精选具备稳定高分红能力、盈利质量优异的价值型上市公司的同时，坚定看好人工智能、战略新兴产业及高端制造出海方向的长期发展潜力。后续将持续深耕个股筛选，重点布局盈利兑现能力强、估值合理或低估、具备长期投资价值的优质标的。当前，基金配置范围已覆盖资讯科技、互联网平台、通信服务、医疗保健、原材料、金融、工业、消费等多个核心行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富沪港深大盘价值混合 A 类份额净值增长率为-14.30%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。本报告期汇添富沪港深大盘价值混合 C 类份额净值增长率为-14.43%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。本报告期汇添富沪港深大盘价值混合 D 类份额净值增长率为-14.38%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

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	157,345,877.47	90.34
	其中：股票	157,345,877.47	90.34

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,112,764.36	1.79
	其中：债券	3,112,764.36	1.79
	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	12,344,820.81	7.09
8	其他资产	1,372,501.28	0.79
9	合计	174,175,963.92	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 150,121,772.97 元，占期末净值比例为 89.29%。

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	-	-
C	制造业	3,604.50	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	7,220,500.00	4.29
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	7,224,104.50	4.30

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（%）
10 能源	-	-
15 原材料	22,217,154.31	13.21
20 工业	13,133,448.30	7.81
25 可选消费	18,263,001.39	10.86
30 日常消费	1,527,429.63	0.91
35 医疗保健	24,377,196.56	14.50
40 金融	-	-
45 信息技术	44,776,689.45	26.63
50 电信服务	25,826,853.33	15.36
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	150,121,772.97	89.29

注:（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	00700	腾讯控股	36,000	13,319,244.72	7.92
2	09988	阿里巴巴－W	145,000	13,268,597.94	7.89
3	01888	建滔积层板	240,000	10,000,249.63	5.95
4	00148	建滔集团	177,000	8,470,673.96	5.04
5	06869	长飞光纤光缆	52,500	7,575,771.11	4.51
6	600036	招商银行	175,000	7,220,500.00	4.29
7	01024	快手－W	270,000	7,171,069.00	4.27
8	06693	赤峰黄金	230,000	7,170,897.31	4.27
9	02899	紫金矿业	250,000	6,918,865.20	4.12
10	03200	大族数控	80,000	6,633,869.76	3.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

1	国家债券	3,112,764.36	1.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	3,112,764.36	1.85

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019835	26 国债 09	31,000	3,112,764.36	1.85

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	17,599.98
2	应收证券清算款	1,257,330.36
3	应收股利	89,973.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,597.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,372,501.28

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪港深大盘价值混合 A	汇添富沪港深大盘价值混合 C	汇添富沪港深大盘价值混合 D
本报告期期初基金份额总额	232,853,741.09	2,569,249.36	187,038.96
本报告期基金总申购份额	4,575,072.20	723,661.78	9,969.40
减：本报告期基金总赎回份额	6,981,116.18	448,783.42	16,823.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	230,447,697.11	2,844,127.72	180,185.11

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沪港深大盘价值混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金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