广发中证港股通非银行金融主题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：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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	广发中证港股通非银 ETF
场内简称	港股非银
基金主代码	513750
交易代码	513750
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 10 日
报告期末基金份额总额	7,486,338,000.00 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最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的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小于 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，即按照标的指数的成

	份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。 具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证港股通非银行金融主题指数收益率（使用估值汇率折算）
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。 本基金投资于港股通标的股票，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（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

注：本基金的扩位证券简称为“港股通非银 ETF 广发”。

§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	-309,900,827.35
2.本期利润	736,599,077.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0835
4.期末基金资产净值	11,107,719,883.05
5.期末基金份额净值	1.4837

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	4.89%	1.22%	3.41%	1.24%	1.48%	-0.02%
过去六个月	-3.37%	1.37%	-5.82%	1.38%	2.45%	-0.01%
过去一年	-10.02%	1.52%	-12.46%	1.53%	2.44%	-0.01%
自基金合	48.37%	1.76%	42.75%	1.81%	5.62%	-0.05%

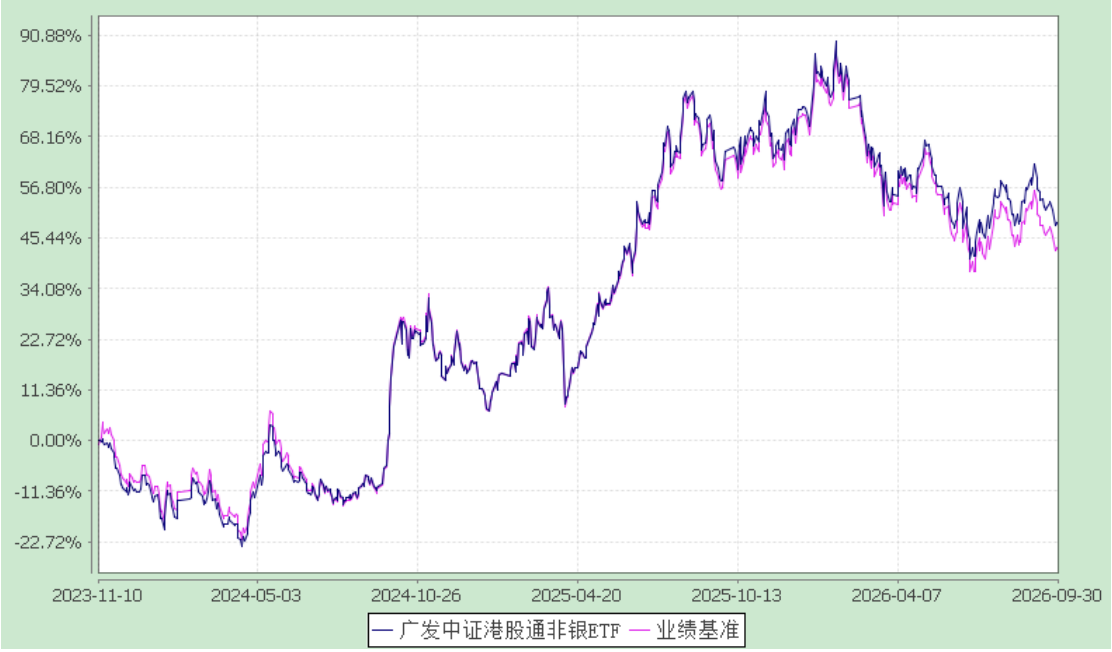
同生效起至今						

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

广发中证港股通非银行金融主题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

(2023 年 11 月 10 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		
罗国庆	本基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证	2023-11-10	2026-08-22	16.8 年	罗国庆先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理

	券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药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；广发国证新能源车电池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；广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板成长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；广发中证国新央企股东回报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；广发中证港股通非银行金融主题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；广发恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基				有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、指数投资部副总经理、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)、广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 7 月 31 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 9 月 13 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理(自 2020 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）基金经理(自 2020 年 8 月 26 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 7

	金经理；广发上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数业务总部副总经理				月 25 日)、广发中证沪港深科技龙头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(自 2021 年 8 月 25 日至 2023 年 7 月 25 日)、广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 1 月 20 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 27 日至 2024 年 3 月 30 日)、广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2021 年 8 月 9 日至 2024 年 8 月 8 日)、广发中证 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(自 2019 年 5 月 27 日至 2024 年 10 月 27 日)、广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2024 年 11 月 11 日至 2026 年 6 月 10 日)、广发中证港股通非银行金融主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 11 月 10 日至 2026 年 8 月 22 日)。
曹世宇	本基金的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发上证 50 交易型开放式指数证券	2024-02-27	-	12.3 年	曹世宇先生，中国籍，应用统计硕士，CFA，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后在广发基金管理有限公司金融工程部、规划发展部任研究员，在资产配置部任研究员兼投资经理，在宏观策略部任研究员兼投资经理，在指数投资部任投资

	投资基金的基金经理；广发中证云计算与大数据主题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；广发国证信息技术创新主题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；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证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；广发中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证 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；广发国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板人工智能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；广发上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				经理、广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2024 年 3 月 30 日至 2024 年 10 月 27 日)、广发上证科创板 200 指数型证券投资基金基金经理(自 2025 年 9 月 23 日至 2025 年 10 月 22 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 12 月 13 日至 2026 年 8 月 22 日)、广发中证全指金融地产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(自 2023 年 12 月 13 日至 2026 年 8 月 22 日)。
冉宇航	本基金的基金经理；广发金融地产精选股票型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发	2026-08-22	-	12.3 年	冉宇航先生，中国籍，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国国际金融股份有限公司研究部分析师，中信证券股份有限公司研

	起式联接基金的基金经理；广发中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				究部分析师，广发基金管理有限公司研究发展部研究员。

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，按照“时

间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司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 29 次，其中 27 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 2 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的是中证港股通非银行金融主题指数，该指数从港股通证券范围中选取符合非银行金融主题的不超过 50 家公司证券作为指数样本，以反映港股通非银行金融主题上市公司的整体表现。作为 ETF 基金，本基金继续秉承指数化被动投资策略，按照根据指数结构复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

2026 年三季度，市场风格从极致走向均衡，AI 相关股票和非 AI 股票之间的分化出现收敛，在此背景下估值较低的传统价值板块跑赢市场。此外，韩国等海外市场在三季度也出现了大幅回调，部分资金回流港股，对港股市场亦形成利好。港股通非银指数权重主要集中在港股保险板块，三季度保险板块温和修复，一方面是险企中报利润在权益投资驱动下普遍高增，寿险业务负债端质量持续改善、新业务价值保持正增长，财险业务综合成本率亦有所优化，另一方面 7 月后市场风格趋于均衡，保险由于估值低、具备股息价值，因此也受到高切低资金的青睐。往后展望，保险板块基本面改善的长逻辑并未出现恶化，我们依旧看好指数未来的表现。

基金投资运作方面，报告期内，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者

日常申购、赎回及成份股调整等工作，运作过程中未发生任何风险事件。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 4.89%，同期业绩比较基准收益率为 3.41%。

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	10,886,123,654.43	94.54
	其中：股票	10,886,123,654.43	94.54
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	408,743,824.11	3.55
8	其他资产	220,014,430.86	1.91
9	合计	11,514,881,909.40	100.00

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含

可退替代款估值增值。

（2）权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 10,886,123,654.43 元，占基金资产净值比例 98.01%。

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	10,853,349,968.58	97.71
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	32,773,685.85	0.30
合计	10,886,123,654.43	98.01

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.3 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	01299	友邦保险	26,044,800	1,645,502,963.10	14.81
2	00388	香港交易所	4,893,900	1,629,156,191.22	14.67
3	02318	中国平安	33,293,000	1,507,562,139.92	13.57
4	02628	中国人寿	46,048,000	1,111,542,099.38	10.01
5	02328	中国财险	42,706,000	605,251,391.43	5.45

6	01339	中国人民保险集团	123,972,000	597,016,448.18	5.37
7	01336	新华保险	13,435,100	519,213,793.56	4.67
8	02601	中国太保	20,864,000	503,989,507.12	4.54
9	00966	中国太平	29,231,400	494,830,378.61	4.45
10	06030	中信证券	15,155,500	317,438,737.16	2.86

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

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

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，新华人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构的处罚。中国人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

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 本报告期内，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	312,974.89
2	应收证券清算款	171,605,282.95
3	应收股利	48,065,927.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,245.79
8	其他	-
9	合计	220,014,430.86

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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	9,566,338,000.00
报告期期间基金总申购份额	749,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	2,829,000,000.00
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	7,486,338,000.00

§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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准广发中证港股通非银行金融主题交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

（二）《广发中证港股通非银行金融主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《广发中证港股通非银行金融主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

9.3 查阅方式

1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日