信澳中证港股通综合指数增强型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：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 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信澳中证港股通综合指数增强
基金主代码	027383
基金运作方式	普通开放式
基金合同生效日	2026 年 6 月 16 日
报告期末基金份额总额	17,230,134.42 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策

	略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、转融通证券出借业务投资策略、融资投资策略。	
业绩比较基准	中证港股通综合指数（人民币）收益率×95%+活期存款基准利率×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数增强型基金，采用指数增强策略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。本基金投资港股通标的股票的，需承担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。	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
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	信澳中证港股通综合指数增强 A	信澳中证港股通综合指数增强 C
下属分级基金的交易代码	027383	027384
报告期末下属分级基金的份额总额	10,581,033.34 份	6,649,101.08 份

§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)	
	信澳中证港股通综合指数增强 A	信澳中证港股通综合指数增强 C

1.本期已实现收益	506,405.97	221,238.70
2.本期利润	747,344.93	179,618.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0381	0.0137
4.期末基金资产净值	10,801,220.64	6,783,374.02
5.期末基金份额净值	1.0208	1.0202

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），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 本报告期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

1、信澳中证港股通综合指数增强 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	2.06%	0.75%	4.64%	0.90%	-2.58%	-0.15%
自基金合同生效起至今	2.08%	0.69%	-2.62%	0.94%	4.70%	-0.25%

2、信澳中证港股通综合指数增强 C：

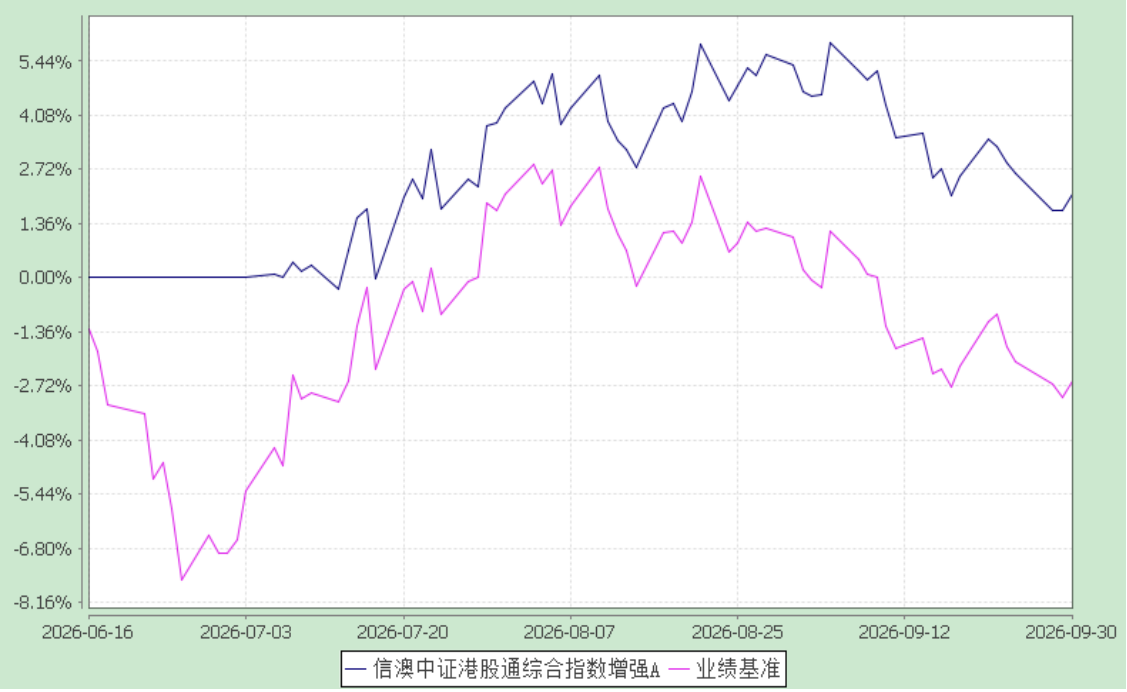
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.01%	0.74%	4.64%	0.90%	-2.63%	-0.16%
自基金合同生效起	2.02%	0.69%	-2.62%	0.94%	4.64%	-0.25%

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

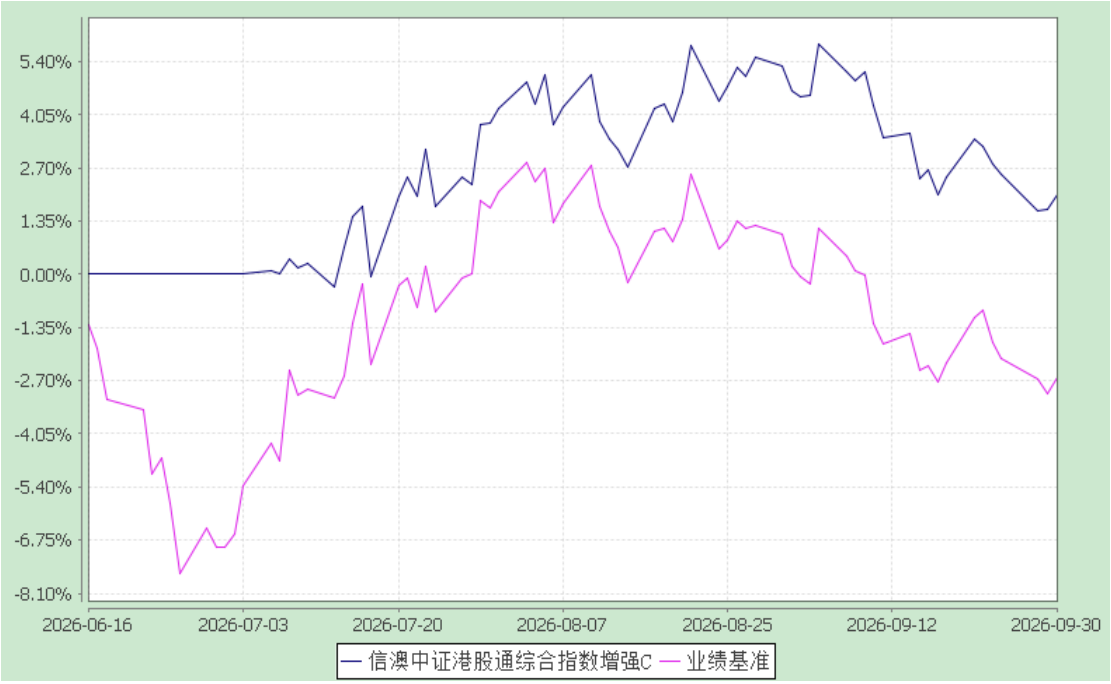
信澳中证港股通综合指数增强 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2026 年 6 月 16 日至 2026 年 9 月 30 日）



信澳中证港股通综合指数增强 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2026 年 6 月 16 日至 2026 年 9 月 30 日）



注：1、本基金合同于 2026 年 06 月 16 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

§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		
林景艺	本基金的基金经理	2026-06-16	-	16 年	北京大学管理学硕士、理学硕士。2010 年起于博时基金管理有限公司先后任量化分析师、基金经理助理、基金经理。2023 年 3 月加入信达澳亚基金管理有限公司任量化投资部总监。曾任信澳国企智选混合基金基金经理（2024 年 5 月 28 日起至 2026 年 1 月 28 日）。现任信澳宁隽智选混合

					基金基金经理（2023 年 12 月 20 日至今）、信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2023 年 12 月 28 日起至今）、信澳核心智选混合基金基金经理（2024 年 2 月 2 日起至今）、信澳红利智选混合基金基金经理（2024 年 3 月 20 日起至今）、信澳鑫怡债券基金基金经理（2025 年 3 月 18 日起至今）、信澳星瑞智选混合基金基金经理（2025 年 3 月 18 日起至今）、信澳信利 6 个月持有期债券基金基金经理（2025 年 9 月 19 日起至今）、信澳鑫丰债券基金基金经理（2025 年 12 月 30 日起至今）、信澳中证港股通综合指数增强基金基金经理（2026 年 6 月 16 日起至今）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，没有发生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

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价

差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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未出现超过该证券当日成交量的 5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年三季度，宏观层面，海外美联储时隔三年首次加息，日本央行加息，全球流动性边际收紧。国内经济延续"供强需弱、结构分化"的特征，货币政策例会强化“逆周期调节”并新增“六张网”金融支持，降息降准预期升温。 港股市场三季度呈现冲高回落走势，中证港股通综合指数（930933）三季度上涨 4.87%，显著跑赢 A 股。但是恒生科技三季度持续下跌，价值与成长分化巨大，大盘明显强于中小盘。行业上医疗保健、能源、原材料领涨，工业、信息科技领跌。资金面呈"内资护盘、外资观望"格局，三季度南向净买入超千亿港元，主攻软件服务与银行，但主动外资仍净流出、成交额逐月萎缩至 2000 亿港元附近。港股相对 A 股的强势主要源于其估值洼地属性、红利资产吸引力以及全球资金再配置的支撑，恒生指数 PE（TTM）约 11 倍、股息率超 3.5%， 2026 年分析师预期盈利增速上修，盈利驱动边际改善，估值仍处历史较低位置。

本基金是对标中证港股通综合指数的量化指数增强型基金，主要策略对标中证港股通综合指数的行业和风格，运用多因子模型从港股通可投股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中，量化打分逻辑从基本面价值出发，综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用，而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术，所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见，可解释、可分析、可验证。在量化方法下，在行业和

风格上我们对标中证港股通综合指数，80%以上持仓来自于成分股，维持稳定的高仓位和均衡的风格暴露，相对基准更加看重公司盈利质量、估值性价比和实际实现的业绩增长。三季度我们还处于建仓期，在初期以稳健建仓的方式部分规避了 6 月份港股市场的回撤，在市场企稳之后迅速完成建仓，所以三季度我们的净值相对中证港股通综合指数有显著的超额收益。从归因上看，超额收益主要来自于初期的仓位管理，以及模型中估值因子和基本面成长因子在三季度的突出贡献。展望四季度，港股经过前期盘整后或重新选择方向，一方面，险资获准投资港股通 ETF、人民币走强构成制度与流动性支撑，利好高股息红利金融、电讯、能源 H 股；另一方面，美联储加息预期持续压制成长估值，主动外资未回补制约反弹高度，故科技板块宜左侧布局而非追高，机构普遍预计以震荡盘整为主。未来我们也会保持策略定力，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业内的多因子选股，发挥量化投资在广度上的选股优势和在跟踪误差上的风控特色。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.0208 元，份额累计净值为 1.0208 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 2.06%，同期业绩比较基准收益率为 4.64%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0202 元，份额累计净值为 1.0202 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 2.01%，同期业绩比较基准收益率为 4.64%。

4.5 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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已按照法规规定向监管机构报送说明报告并提出解决方案，截至报告期末本基金资产净值仍未达到五千万元。

§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	15,908,511.59	89.99
	其中：股票	15,908,511.59	89.99
2	固定收益投资	1,014,158.71	5.74
	其中：债券	1,014,158.71	5.74
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	674,125.34	3.81
7	其他各项资产	81,978.43	0.46
8	合计	17,678,774.07	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币15,908,511.59元，占期末净值比例为90.47%。

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

5.2.1.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有指数投资的境内股票。

5.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

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	670,743.64	3.81
基础材料	1,020,678.57	5.80
工业	1,514,566.21	8.61
非日常生活消费品	2,257,558.34	12.84

日常消费品	726,815.63	4.13
医疗保健	909,015.27	5.17
金融	5,896,694.28	33.53
信息技术	888,706.76	5.05
电信业务	1,715,758.40	9.76
公用事业	86,618.87	0.49
房地产	221,355.62	1.26
合计	15,908,511.59	90.47

注：以上分类采用中证行业分类标准。

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 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	00005	汇丰控股	10,000	1,356,303.60	7.71
2	00700	腾讯控股	3,300	1,220,930.77	6.94
3	09988	阿里巴巴-W	10,600	969,980.26	5.52
4	00939	建设银行	96,000	809,249.70	4.60
5	01398	工商银行	69,000	456,670.86	2.60
6	00883	中国海洋石油	19,000	390,787.12	2.22
7	03988	中国银行	63,000	329,079.60	1.87
8	01299	友邦保险	4,400	277,990.73	1.58
9	02628	中国人寿	11,000	265,526.47	1.51
10	02888	渣打集团	1,200	251,757.42	1.43

5.3.2 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

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

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	1,014,158.71	5.77

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	其他	-	-
10	合计	1,014,158.71	5.77

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	10,100	1,014,158.71	5.77

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

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，中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设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处罚的情形。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约定备选股票库的情形。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,305.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	69,622.55
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,050.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	81,978.43

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

5.11.5.1 期末指数投资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的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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，分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳中证港股通综合指数增强A	信澳中证港股通综合指数增强C
本报告期期初基金份额总额	120,735,555.25	159,798,773.10
报告期期间基金总申购份额	642,993.44	1,280,723.42
减：报告期期间基金总赎回份额	110,797,515.35	154,430,395.44
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,581,033.34	6,649,101.08

§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

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

基金管理人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超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2026 年 07 月 03 日-2026 年 07 月 09 日	10,001,333.33	-	10,001,333.33	-	-
	2	2026 年 09 月 01 日-2026 年 09 月 30 日	3,632,479.55	-	-	3,632,479.55	21.08%
产品特有风险							
（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险； （2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险； （3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险； （4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险等。							

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、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《信澳中证港股通综合指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《信澳中证港股通综合指数增强型证券投资基金托管协议》；

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；

7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；

8、中国证监会要求的其他文件。

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/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日