广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）

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	广发恒生中型股指数（LOF）
场内简称	恒生中型
基金主代码	501303
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 21 日
报告期末基金份额总额	36,996,698.09 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股

	票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。在正常市场情况下，本基金力争控制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%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	人民币计价的恒生综合中型股指数收益率×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本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	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		
下属分级基金的基金简称	广发恒生中型股指数（LOF）A	广发恒生中型股指数 C	广发恒生中型股指数（LOF）E
下属分级基金场内简称	恒生中型	-	-
下属分级基金的交易代码	501303	004996	018238
报告期末下属分级基金的份额总额	28,708,102.51 份	4,202,688.98 份	4,085,906.60 份

注：本基金的扩位证券简称为“恒生中型股 LOF”。

§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)		
	广发恒生中型股指数（LOF）A	广发恒生中型股指数 C	广发恒生中型股指数（LOF）E
1.本期已实现收益	745,648.16	99,086.57	94,043.07
2.本期利润	-564,108.14	-88,967.13	-81,368.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0189	-0.0204	-0.0215
4.期末基金资产净值	27,003,848.58	3,772,593.16	3,762,728.81
5.期末基金份额净值	0.9406	0.8977	0.9209

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

1、广发恒生中型股指数（LOF）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	-2.14%	1.17%	-2.61%	1.21%	0.47%	-0.04%
过去六个月	-6.76%	1.19%	-7.56%	1.23%	0.80%	-0.04%

过去一年	-19.41%	1.19%	-20.58%	1.23%	1.17%	-0.04%
过去三年	21.84%	1.23%	17.16%	1.35%	4.68%	-0.12%
过去五年	-7.22%	1.31%	-13.06%	1.42%	5.84%	-0.11%
过去七年	10.87%	1.36%	2.33%	1.45%	8.54%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-5.94%	1.32%	-12.77%	1.40%	6.83%	-0.08%

2、广发恒生中型股指数 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	-2.30%	1.17%	-2.61%	1.21%	0.31%	-0.04%
过去六个月	-7.04%	1.19%	-7.56%	1.23%	0.52%	-0.04%
过去一年	-19.90%	1.19%	-20.58%	1.23%	0.68%	-0.04%
过去三年	19.65%	1.23%	17.16%	1.35%	2.49%	-0.12%
过去五年	-9.96%	1.31%	-13.06%	1.42%	3.10%	-0.11%
过去七年	6.34%	1.36%	2.33%	1.45%	4.01%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-10.23%	1.32%	-12.77%	1.40%	2.54%	-0.08%

3、广发恒生中型股指数（LOF）E：

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	-2.20%	1.17%	-2.61%	1.21%	0.41%	-0.04%
过去六个月	-6.89%	1.19%	-7.56%	1.23%	0.67%	-0.04%
过去一年	-19.82%	1.19%	-20.58%	1.23%	0.76%	-0.04%
过去三年	20.35%	1.23%	17.16%	1.35%	3.19%	-0.12%
自基金合同生效起至今	9.00%	1.20%	4.74%	1.31%	4.26%	-0.11%

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

广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）
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
(2017 年 9 月 21 日至 2026 年 9 月 30 日)

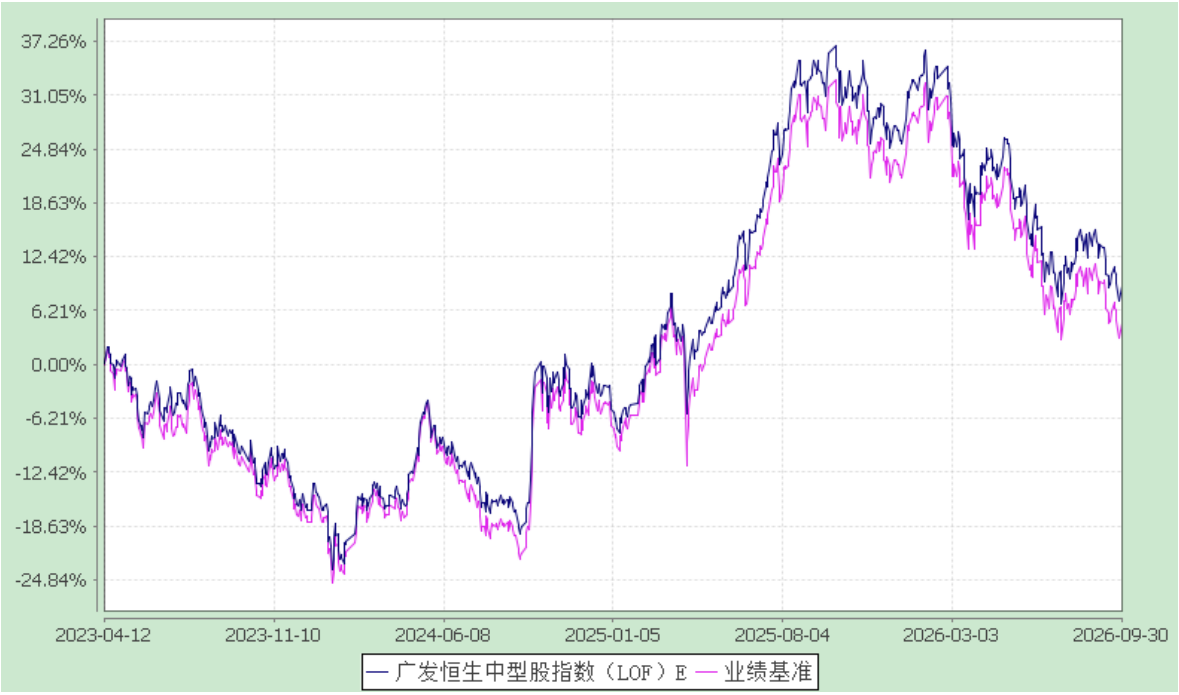
1、广发恒生中型股指数（LOF）A：



2、广发恒生中型股指数 C：



3、广发恒生中型股指数（LOF）E：



§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		
姚曦	本基金的基金经理；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理；广发上海金交易型	2021-11-17	-	11.2 年	姚曦先生，中国籍，商科硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发期货有限公司发展研究中心研究员、广发基金管理有限公司指数投资部研究员、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 21 日)、广发中小企业 300 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 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发中小企业 300 交易型开

	开放式证券投资基金的基金经理；广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证稀有金属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；广发中证工程机械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；广发中证全指食品交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指食品交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金的基金经理				放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发中证光伏龙头 30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 10 月 19 日至 2026 年 6 月 10 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 2 月 22 日至 2026 年 6 月 10 日)、广发中证全指可选消费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 2 月 22 日至 2026 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 15 日至 2026 年 8 月 22 日)。

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

本基金跟踪的标的指数为恒生综合中型股指数。该指数涵盖了恒生综合指数成份股市值占比位于 80%-95%区间的成份股，多为优质的行业龙头，同时也涵盖了沪深两市互联互通的港股通 300 成份股。

2026 年三季度，恒生综合中型股指数呈现"低位震荡"的走势。报告期内，全球地缘风险升温——美伊冲突全面升级、霍尔木兹海峡封锁、油价持续攀升——导致国际资金风险偏好显著下降，新兴市场资金外流压力加大。南向资金虽维持净流入态势，但增量无法对冲外资流出。全球流动性担忧及油价高企对港股的压制仍在持续。港股小型股和中型股因流动性相对较差，承受的卖压更为显著。

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股构成及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。报告期内，本基金交易和申购赎回运作正常，未发生风险事件。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-2.14%，C 类基金份额净值增长率为-2.30%，E 类基金份额净值增长率为-2.20%，同期业绩比较基准收益率为-2.61%。

4.6 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，本基金于 2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日出现了基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§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	31,528,230.63	89.94
	其中：股票	31,528,230.63	89.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	504,328.49	1.44
	其中：债券	504,328.49	1.44
	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	2,713,083.99	7.74
8	其他资产	310,645.81	0.89
9	合计	35,056,288.92	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 31,528,230.63 元，占基金资产净值比例 91.28%。

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	968,521.81	2.80
原材料	3,247,756.53	9.40
工业	4,697,127.99	13.60
非日常生活消费品	3,743,479.05	10.84
日常消费品	1,378,623.85	3.99
医疗保健	4,480,509.88	12.97
金融	4,279,994.89	12.39
信息技术	4,402,370.41	12.75
通讯业务	1,583,983.61	4.59
公用事业	1,520,730.64	4.40
房地产	1,225,131.97	3.55
合计	31,528,230.63	91.28

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	02359	药明康德	5,060	934,743.84	2.71

2	06869	长飞光纤光缆	4,500	649,351.81	1.88
3	01548	金斯瑞生物科技	16,000	616,139.54	1.78
4	03993	洛阳钼业	42,000	545,852.11	1.58
5	00300	美的集团	6,700	527,979.81	1.53
6	02338	潍柴动力	21,000	517,730.27	1.50
7	00522	ASMPT	3,600	494,449.92	1.43
8	02099	中国黄金国际	2,600	491,909.00	1.42
9	00019	太古股份公司 A	4,000	352,982.30	1.02
9	00087	太古股份公司 B	10,000	131,338.26	0.38
10	01339	中国人民保险集团	95,000	457,494.94	1.32

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	504,328.49	1.46
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	504,328.49	1.46

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	019827.SH	26 国债 01	5,000	504,328.49	1.46

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	105.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	156,366.77
4	应收利息	-

5	应收申购款	6,525.10
6	其他应收款	147,648.17
7	其他	-
8	合计	310,645.81

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

项目	广发恒生中型股指数（LOF）A	广发恒生中型股指数C	广发恒生中型股指数（LOF）E
报告期期初基金份额总额	30,797,101.51	4,406,881.40	3,770,007.48
报告期期间基金总申购份额	1,003,930.88	-	1,100,919.05
减：报告期期间基金总赎回份额	3,092,929.88	204,192.42	785,019.93
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	28,708,102.51	4,202,688.98	4,085,906.60

§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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2026年8月7日至2026年9月30日，本基金如涉及信息披露费、银行间账户维护费、审计费、持有人大会费等固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）募集的文件

2.《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）托管协议》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、营业执照

7.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