汇添富国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	汇添富国证价值100ETF
场内简称	价值ETF汇添富
基金主代码	159042
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026年05月27日
报告期末基金份额总额(份)	81,801,105.00
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即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，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；

	（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。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上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略及存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	国证价值100指数收益率
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。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数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	中国建设银行股份有限公司

§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)
1.本期已实现收益	2,941,744.19
2.本期利润	17,182,491.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.1367
4.期末基金资产净值	80,450,721.68
5.期末基金份额净值	0.9835

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。

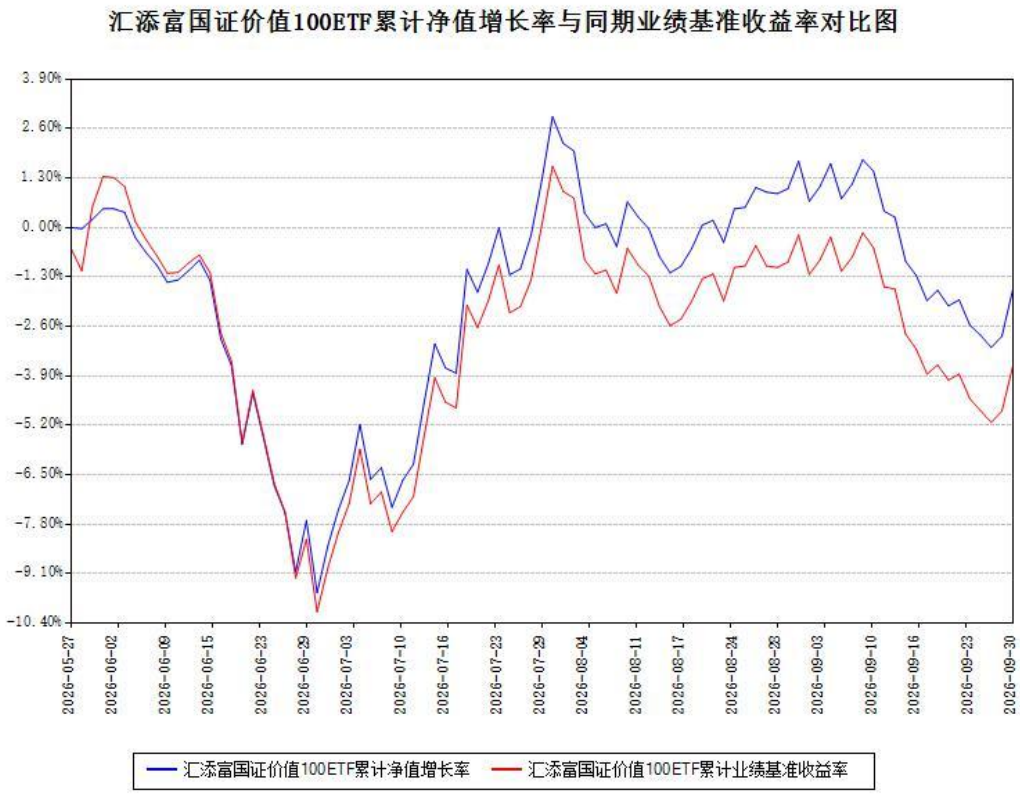
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	8.79%	0.88%	7.16%	0.88%	1.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.65%	0.92%	-3.66%	0.95%	2.01%	-0.03%

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《基金合同》生效之日为 2026 年 05 月 27 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期

中。

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		
何丽竹	本基金的基金经理	2026年05月27日	-	6	国籍：中国。学历：复旦大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2021年7月起加入汇添富基金管理股份有限公司。2025年3月18日至今任汇添富中证芯片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。2025年3月18日至2026年6月29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。2025年3月21日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式

					指数证券投资基金的基金经理。2025年4月21日至今任汇添富中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年4月30日至今任汇添富中证800自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年5月13日至2025年7月28日任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025年5月16日至2026年6月29日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年5月16日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年7月15日至今任汇添富中证机器人交易型开

					放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025年7月17日至今任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年7月28日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年7月29日至今任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025年8月5日至今任汇添富中证800自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025年8月18日至今任汇添富中证电信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。2025年8月18日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025年8月18日至今任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年8月25日至今任汇添富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。2025年8月29日至今任汇添富中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026年2月9日至今任汇添富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。2026年4月20日

					至今任汇添富国证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026年4月28日至今任汇添富中证金融科技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。2026年5月27日至今任汇添富国证价值100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026年9月29日至今任汇添富国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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

2026年三季度，A股市场震荡下跌，且市场风格有所切换，海外通胀与加息则成为压制全球高估值资产的核心变量。

从市场表现来看,A股整体震荡下跌,上证指数三季度下跌6.16%,沪深300下跌12.49%。风格方面，市场在三季度经历了一次较为典型的高低切换与估值消化。上半年表现强势、交易相对拥挤的科技成长板块出现深度调整，而受益于能源价格上行与防御属性的资源、红利方向逆势走强，价值风格显著超越成长风格，国证成长和国证价值三季度分别下跌19.05%、上涨3.90%,分化达到22.95%。市场整体成交先热后冷,全市场单日成交额由7月初的约 3.68万亿元逐步回落至9月底的1.5万亿元左右水平。

国内经济方面，二季度国内GDP同比增长4.3%，较一季度的5.0%有所回落；8月规模以上工业增加值同比增长5.2%，生产端保持韧性，但需求端分化明显：社会消费品零售总额当月同比增长0.4%，固定资产投资1-8月累计同比下跌7.2%，居民消费与地产链的内生修复仍显不足。与此同时，出口金额同比增速维持在较高水平，外需与高技术制造构成经济修复的主要边际动力。价格端出现积极变化，PPI当月同比由年初的负值逐步回升，7、8 月分别录得+3.5%与+3.8%，8月CPI同比增长0.8%。

海外方面，通胀与地缘政治成为主导变量。美联储于9月上调利率25个基点，并释放后续仍可能收紧的信号，全球无风险利率中枢明显抬升。且中东局势变化持续扰动能源供给情况，全球成长板块有一定承压。

国证价值100指数，由100只兼具"低估值、高股息、高自由现金流"特征的优质价值股构成。指数采用三维价值因子综合打分选样，优选低市盈率、高股息率和高自由现金流率的上市企业。这种多因子框架，使指数综合考虑业务稳健、现金流充沛、具备长期竞争力的优质价值股。指数采用季度调样，实现纪律化的定期再平衡，使指数始终贴合价值选股逻辑。在行业分布上，国证价值100指数主要覆盖顺周期与高股息行业，兼具稳健性与弹性。

报告期内，本基金坚持被动投资理念，采用完全复制策略，实现了对标的指数的良好跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为8.79%，同期业绩比较基准收益率为7.16%。

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	79,992,381.46	99.13
	其中：股票	79,992,381.46	99.13
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	670,107.06	0.83
8	其他资产	33,606.90	0.04
9	合计	80,696,095.42	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	2,680,573.00	3.33
C	制造业	45,300,375.56	56.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,560,402.00	3.18
E	建筑业	3,473,199.00	4.32
F	批发和零售业	1,355,158.00	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	3,307,503.00	4.11
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,618,958.00	4.50
J	金融业	16,231,870.70	20.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	165,581.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	350,130.00	0.44
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	946,521.00	1.18
S	综合	-	-
	合计	79,990,271.26	99.43

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

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	493.20	0.00
C	制造业	1,617.00	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	-	-
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	2,110.20	0.00

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	000651	格力电器	166,477	6,372,739.56	7.92
2	000921	海信家电	232,100	6,215,638.00	7.73
3	601166	兴业银行	311,500	5,622,575.00	6.99
4	600104	上汽集团	365,200	3,973,376.00	4.94
5	601600	中国铝业	390,800	3,489,844.00	4.34
6	002508	老板电器	203,200	3,476,752.00	4.32
7	600741	华域汽车	189,800	2,919,124.0	3.63

				0	
8	601117	中国化学	317,700	2,277,909.00	2.83
9	600938	中国海油	56,500	1,888,230.00	2.35
10	002532	天山铝业	154,200	1,878,156.00	2.33

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

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	601091	沈鼓集团	77	1,238.16	0.00
2	601123	马矿股份	40	493.20	0.00
3	603448	天博智能科技	7	378.84	0.00

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,兴业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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	33,606.90
8	其他	-
9	合计	33,606.90

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601091	沈鼓集团	1,238.16	0.00	新股流通受限
2	601123	马矿股份	493.20	0.00	新股流通受限
3	603448	天博智能科技	378.84	0.00	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	184,801,105.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	106,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	81,801,105.00

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国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富国证价值 100 交易型开放式指数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、报告期内汇添富国证价值 100 交易型开放式指数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