

中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 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 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 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	中信保诚恒生港股通科技指数
基金主代码	026726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 05 月 26 日
报告期末基金份额总额	591,061,539.53 份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数型基金。在正常市场情况下，力争保持基金净值收益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%，年跟踪误差不超过 4%。1、股票投资策略。2、债券投资策略。3、资产支持证券投资策略。4、可转换债券、可交换债券投资策略。5、衍生品投资策略。6、融资、转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	恒生港股通科技主题指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
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。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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

	本基金投资港股通标的股票，将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。	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
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	中信保诚恒生港股通科技指数 A	中信保诚恒生港股通科技指数 C
下属分级基金的交易代码	026726	026727
报告期末下属分级基金的份额总额	512,979,811.09 份	78,081,728.44 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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	中信保诚恒生港股通科技指数 A	中信保诚恒生港股通科技指数 C
1. 本期已实现收益	-7,233,929.28	-1,158,717.81
2. 本期利润	-17,492,352.79	-1,737,790.40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0310	-0.0188
4. 期末基金资产净值	471,907,480.39	71,780,739.82
5. 期末基金份额净值	0.9199	0.9193

注：1、上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

中信保诚恒生港股通科技指数 A

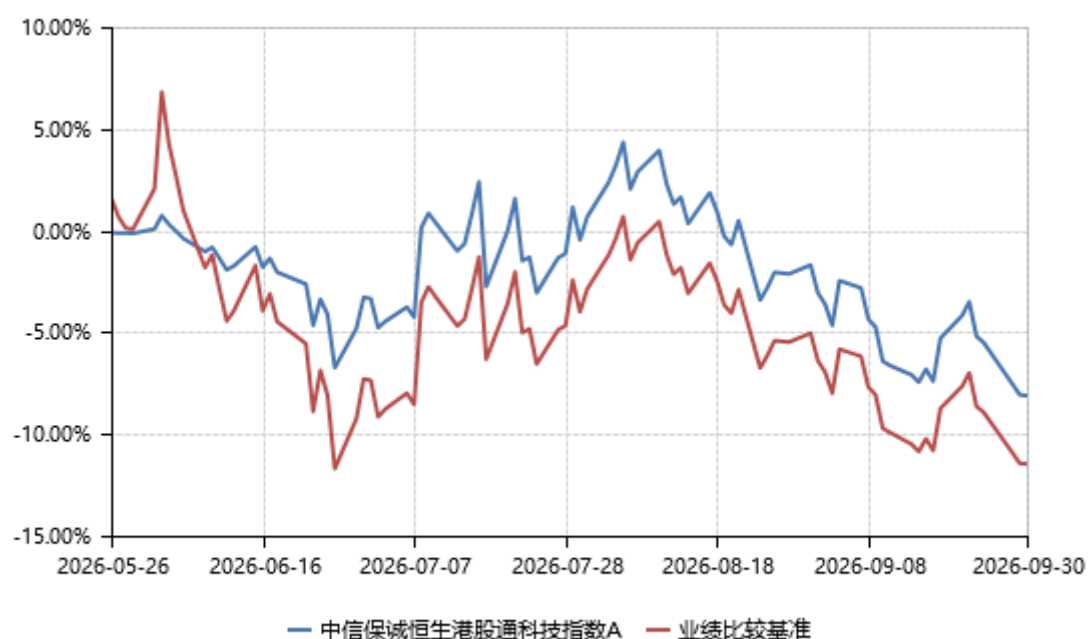
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.99%	1.59%	-4.51%	1.67%	-0.48%	-0.08%
自基金合同生效起 至今	-8.01%	1.45%	-11.37%	1.81%	3.36%	-0.36%

中信保诚恒生港股通科技指数 C

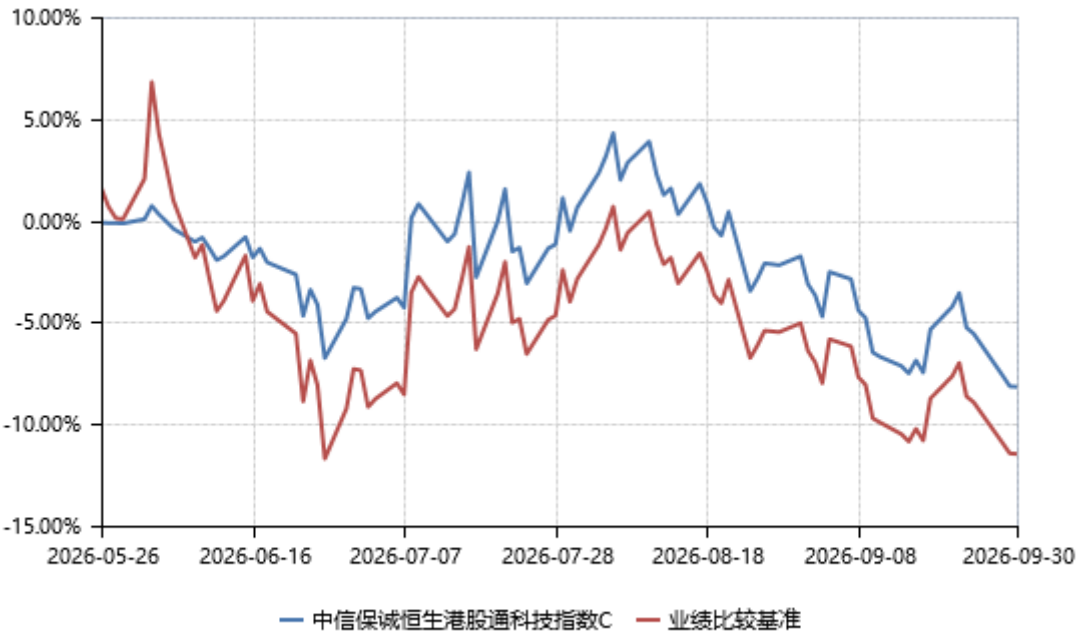
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.03%	1.59%	-4.51%	1.67%	-0.52%	-0.08%
自基金合同生效起 至今	-8.07%	1.45%	-11.37%	1.81%	3.30%	-0.36%

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

中信保诚恒生港股通科技指数 A



中信保诚恒生港股通科技指数 C



注：1、本基金建仓期自 2026 年 05 月 26 日至 2026 年 11 月 26 日，截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

2、本基金合同生效日为 2026 年 05 月 26 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

§ 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		
黄稚	量化投资部助理总监、基金经理	2026 年 05 月 26 日	-	15	黄稚女士，理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司，担任资产管理部产品经理；于平安证券有限责任公司，担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、基金经理助理。现任量化投资部助理总监，中信保诚中证 500 指数型证券投资基金

					(LOF)、中信保诚中证建设工程指数型证券投资基金(LOF)、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金(LOF)、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金(LOF)、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金(LOF)、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金(LOF)、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金(LOF)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金(LOF)、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金的基金经理。
吴昊	研究部总监、基金经理	2026 年 05 月 26 日	—	19	吴昊先生，经济学硕士，CFA。曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司，从事研究工作。2010 年 11 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总监。现任研究部总监，中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚

					优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚全球商品主题证券投资基金 (LOF)、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金、中信保诚汇鑫债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，基金管理人不存在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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司公平交易及异常交易管理相关规定，公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同同时同向交易同一证券，满足条件时自动执行交易系统内的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行检查和统计分析。本报告期，公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有投资组合的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行合理管控，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析。报告期内，本投资组合与公司旗下管理的其它投资组合之间未出现参与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 5%的交易。

本报告期内，未发现投资组合之间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

回顾 2026 年三季度，海外方面，中东局势扰动持续，原油价格再度大幅上涨。美伊就霍尔木兹海峡的重开进行磋商，但地缘风险仍然存在。美联储 9 月加息落地，加息预期有所强化，美债收益率持续上行。国内方面，经济基本面延续外需强内需弱的分化特征，货币政策维持适度宽松。7、8 月出口韧性仍较强，而固定资产投资累计同比降幅扩大，社会消费品零售总额增速有所放缓，内需仍待提振。

港股市场方面，三季度港股先扬后抑、科技板块呈现结构性分化。7 月港股市场普遍上涨，政策与资金改善带来低估值板块修复。8、9 月美国长债收益率持续攀升，港股震荡走弱。受到海外流动性、中报业绩、资金结构切换等多重因素影响，港股科技板块估值承压、表现弱于大盘。报告期内，恒生指数上涨 7.57%，恒生港股通科技主题指数下跌 3.67%。

本基金跟踪的标的指数为恒生港股通科技主题指数。报告期内，本基金坚持既定的指数化投资策略，原则上按照标的指数中成分股组成及其权重构建股票投资组合，实现对标的指数的有效跟踪。本基金认真应对跟踪指数的成分股调整以及投资者日常申购、赎回需求，根据市场情况合理安排权益仓位和头寸，有效管理跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚恒生港股通科技指数 A 份额净值增长率为-4.99%，同期业绩比较基准收益率为-4.51%；中信保诚恒生港股通科技指数 C 份额净值增长率为-5.03%，同期业绩比较基准收益率为-4.51%。

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，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元或者基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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	508,775,979.38	92.97
	其中：股票	508,775,979.38	92.97
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,032,940.27	1.47
	其中：债券	8,032,940.27	1.47
	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	29,701,655.79	5.43
8	其他资产	741,112.50	0.14
9	合计	547,251,687.94	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 508,775,979.38 元，占资产净值比例为 93.58%。

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

本基金本报告期末未持有指数投资股票。

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

本基金本报告期末未持有境内积极投资股票。

5.2.3 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（%）
工业	6,899,681.66	1.27
非必需消费品	127,111,957.89	23.38
信息技术	226,374,212.07	41.64
电信业务	148,390,127.76	27.29
合计	508,775,979.38	93.58

注：以上分类采用全球行业分类系统(GICS)提供的国际通用分类标准。

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 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	00700	腾讯控股	212,100	78,472,550.14	14.43
2	09988	阿里巴巴－W	843,400	77,177,486.22	14.20
3	01810	小米集团－W	2,635,000	57,091,282.31	10.50
4	03690	美团－W	811,300	49,934,471.67	9.18
5	09999	网易	257,000	42,490,244.84	7.82
6	00992	联想集团	1,420,000	42,102,754.06	7.74
7	00981	中芯国际	740,000	38,526,748.02	7.09
8	01024	快手－W	577,900	15,348,743.60	2.82
9	01347	华虹宏力	152,000	13,752,575.14	2.53
10	06869	长飞光纤光缆	80,500	11,616,182.36	2.14

5.3.2 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	8,032,940.27	1.48
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	8,032,940.27	1.48

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	80,000	8,032,940.27	1.48

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可运用股指期货以提高投资效率,更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还可运用股指期货对冲流动性风险,以进行有效的现金管理。

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

本基金参与国债期货交易,应当根据风险管理的原则,以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查,或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

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	75,439.74
4	应收利息	-
5	应收申购款	665,672.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	741,112.50

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

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末持有的积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚恒生港股通 科技指数 A	中信保诚恒生港股 通科技指数 C
报告期期初基金份额总额	685,178,320.58	129,842,520.25
报告期期间基金总申购份额	5,702,604.52	4,173,408.24
减：报告期期间基金总赎回份额	177,901,114.01	55,934,200.05
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	512,979,811.09	78,081,728.44

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2026 年 10 月 26 日