华泰紫金泰盈混合型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

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 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	华泰紫金泰盈混合
基金主代码	008404
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 21 日
报告期末基金份额总额	518,667,410.39 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为混合型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率×15%+中债综合指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
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	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C
下属分级基金的交易代码	008404	008405
报告期末下属分级基金的份额总额	152,824,926.59 份	365,842,483.80 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)	
	华泰紫金泰盈混合 A	华泰紫金泰盈混合 C
1.本期已实现收益	-808,525.79	-2,682,158.05
2.本期利润	-16,032,279.57	-34,356,415.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1045	-0.1055
4.期末基金资产净值	216,375,250.55	511,097,238.94
5.期末基金份额净值	1.4158	1.3970

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），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、华泰紫金泰盈混合 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	-6.66%	1.05%	-5.75%	0.75%	-0.91%	0.30%
过去六个月	-3.65%	1.08%	-0.63%	0.78%	-3.02%	0.30%
过去一年	-4.02%	1.02%	-3.80%	0.73%	-0.22%	0.29%
过去三年	13.27%	1.05%	18.81%	0.76%	-5.54%	0.29%
过去五年	-10.21%	1.10%	-1.04%	0.78%	-9.17%	0.32%
自基金合同生效起至今	41.58%	1.21%	6.50%	0.82%	35.08%	0.39%

2、华泰紫金泰盈混合 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	-6.71%	1.05%	-5.75%	0.75%	-0.96%	0.30%
过去六个月	-3.74%	1.08%	-0.63%	0.78%	-3.11%	0.30%
过去一年	-4.22%	1.02%	-3.80%	0.73%	-0.42%	0.29%
过去三年	12.60%	1.05%	18.81%	0.76%	-6.21%	0.29%
过去五年	-11.10%	1.10%	-1.04%	0.78%	-10.06%	0.32%
自基金合同生效起至今	39.70%	1.21%	6.50%	0.82%	33.20%	0.39%

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

华泰紫金泰盈混合型证券投资基金

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

(2020 年 1 月 21 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．华泰紫金泰盈混合 A：



2．华泰紫金泰盈混合 C：



注：1、本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率*15%+中债综合指数收益率*30%；

2、本基金合同于 2020 年 1 月 21 日生效，自基金成立起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
查晓磊	本基金的基金经理,公司权益投资总监、权益公募投资部总经理、权益专户投资部总经理	2023-06-19	-	15	具有基金从业资格，深圳市后备级领军人才，香港中文大学金融学博士，博时基金-南开大学应用经济博士后。 曾先后就职于博时基金、浙商基金，曾主管权益与 AI 量化投研团队，多次荣获《中国基金报》、《证券时报》评比奖项。2022 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现担任公司权益投资总监、权益公募投资部总经理、权益专户投资部总经理、基金经理兼投资经理。

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
查晓磊	公募基金	5.00	1,766,705,166.33	2023-06-19
	私募资产管理计划	5.00	105,278,671.58	2022-08-02
	其他组合	-	-	-
	合计	10.00	1,871,983,837.91	-

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》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金基金合同》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，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律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

本基金管理人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》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待,各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，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超过该证券当日成交量的 5%。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，市场运行格局较二季度发生了深刻转变，整体呈现出“极致叙事退潮、高低估值收敛、回归基本面定价”的特征。

7 月起，市场打破了此前三个月的单边分化格局。前期备受追捧的“AI 宏大叙事”遭遇大幅快速抛售，多数热门标的在短时间内出现深度回调；与此同时，此前持续承压的低估值板块获得资金显著回流，单月修复明显。 从因子视角复盘，二季度的极

端行情本质上更多由“动量与高 Beta”驱动，而非单纯的“成长因子”定价。随着 5-6 月价值因子经历近乎历史极值的回撤后，7-8 月价值因子快速修复并重回回撤起点附近。市场从“极致叙事与流动性扩张”回归到“更有效的基本面与估值定价”，持续数月的分化反而使大批优质公司处于极具吸引力的价格水平，市场生态进入更加健康的状态。进入 9 月，受外部不确定性因素升温影响，市场整体风险偏好显著回落，指数表现弱于预期。一方面，AI 投资步入平台震荡期，在缺乏基本面再加速催化的背景下，市场选择通过时间与空间“消化估值”；另一方面，传统经济压力持续试探底线，但局部政策已开始释放边际积极信号。在此环境下，传统底部资产表现明显优于产业宏大叙事类资产，市场延续了二季度末以来的估值收敛交易。

组合的操作方面：前期滞涨、估值处于历史底部的优质价值与顺周期标的，开始展现出韧性与弹性，在 7 月和 8 月持续为组合带来了较为显著的正向收益贡献，有效支撑了组合净值的稳健表现。组合在化工材料、机械设备制造以及先进制造电子等方向继续保持较高配置比例。细节方面，我们在化工与机械行业内部进行了小幅度的结构优化，提升持仓标的的质地与盈利确定性。进入 9 月，结合市场风险偏好回落与估值消化的特征，组合适度减持了部分前期涨幅较大或景气度面临震荡的科技与传统大周期公司，转而挖掘并增配了一批“小而美”的细分周期成长类公司，力求以更具吸引力的估值获取确定性的个股成长收益。同时，组合也沿着“估值保护+边际改善”的脉络，稳步加大了对传统底部方向的布局力度。

展望四季度，我们认为“估值收敛与基本面有效性回归”的过程可能仍未结束。在操作思路上，我们坚持估值保护与产业趋势并重。经过前期的长期分化与三季度的初步收敛，仍有大量基本面扎实、现金流稳健的传统底部及优质公司处于极具吸引力的估值区间。伴随着局部政策的边际发力，这类资产具备较高的安全边际与配置价值。对 AI 产业趋势，密切跟踪云厂商资本开支及底层应用数据的拐点，力争在控制回撤的前提下捕捉局部阿尔法收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-6.66%，同期业绩比较基准收益率为-5.75%；本基金 C 类份额净值增长率为-6.71%，同期业绩比较基准收益率为-5.75%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形；

2、本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 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	621,312,290.57	82.37
	其中：股票	621,312,290.57	82.37
2	固定收益投资	37,798,726.55	5.01
	其中：债券	37,798,726.55	5.01
	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	78,281,838.85	10.38
7	其他各项资产	16,856,793.35	2.23
8	合计	754,249,649.32	100.00

注：1、本基金报告期末通过港股通交易机制持有的港股期末公允价值为 181,363,521.11 元人民币，占期末基金资产净值比例 24.93%。

2、本基金报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

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	212,250.00	0.03
B	采矿业	29,646,258.46	4.08
C	制造业	339,379,068.30	46.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	255,140.78	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,234,961.00	2.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,027,999.92	1.65
J	金融业	43,193,091.00	5.94
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	439,948,769.46	60.48

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（%）
A 基础材料	20,683,274.33	2.84
B 消费者非必需品	41,547,802.70	5.71
C 消费者常用品	7,335,164.56	1.01
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	35,787,419.92	4.92

G 工业	39,787,595.87	5.47
H 信息科技	19,549,721.46	2.69
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	16,672,542.27	2.29
合计	181,363,521.11	24.93

注：以上分类采用财汇资讯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	03347	泰格医药	637,900.00	25,670,837.21	3.53
2	600141	兴发集团	910,961.00	24,477,522.07	3.36
3	600885	宏发股份	647,200.00	21,700,616.00	2.98
4	300866	安克创新	172,500.00	21,498,675.00	2.96
5	002595	豪迈科技	554,911.00	21,308,582.40	2.93
6	600801	华新建材	876,400.00	20,858,320.00	2.87
7	301039	中集车辆	2,876,500.00	20,768,330.00	2.85
8	00189	东岳集团	2,172,599.00	20,682,876.99	2.84
9	600901	江苏金租	2,969,800.00	20,610,412.00	2.83
10	600660	福耀玻璃	384,550.00	20,604,189.00	2.83

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	37,798,726.55	5.20
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	37,798,726.55	5.20

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	019792	25 国债 19	373,000.00	37,798,726.55	5.20

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	128,533.78
2	应收证券清算款	2,760,383.62
3	应收股利	126,042.62
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,785,671.84
6	其他应收款	56,161.49
7	其他	-
8	合计	16,856,793.35

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的情况。

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	华泰紫金泰盈混合A	华泰紫金泰盈混合C
本报告期期初基金份额总额	162,559,687.09	342,821,611.97
本报告期基金总申购份额	17,259,913.66	176,035,335.95
减：本报告期基金总赎回份额	26,994,674.16	153,014,464.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	152,824,926.59	365,842,483.80

§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

单位：份

项目	华泰紫金泰盈混合A	华泰紫金泰盈混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	8,988,909.65	-
本报告期买入/申购总份额	-	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,988,909.65	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.88	-

注：期末持有的基金份额占基金总份额比例为期末持有份额占基金同类份额的比例。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内管理人运用固有资金投资本基金份额未发生变动。

§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

本基金本报告期内无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

无

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予华泰紫金泰盈混合型证券投资基金注册的文件；

2、《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金基金合同》；

3、《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金托管协议》；

4、《华泰紫金泰盈混合型证券投资基金招募说明书》；

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、关于申请募集注册华泰紫金泰盈混合型证券投资基金之法律意见书；

8、基金产品资料概要；

9、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

10、中国证监会要求的其他文件。

9.2存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

9.3查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话：4008895597；公司网址：https://www.htscamc.com。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二六年十月二十七日