华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金

(QDII)

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)
基金主代码	018523
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 6 月 28 日
报告期末基金份额总额	346,705,053.46 份
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标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控

	制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。 由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。	
业绩比较基准	经汇率调整后的恒生互联网科技业指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期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。 若本基金通过港股通机制投资于港股，可能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。本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
境外资产托管人中文名称	花旗银行	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)A	华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)C
下属分级基金的交易代码	018523	018524

报告期末下属分级基金的份额总额	86,692,626.86 份	260,012,426.60 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)	
	华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)A	华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)C
1.本期已实现收益	-4,566,775.91	-13,389,148.42
2.本期利润	-2,045,587.56	-8,664,264.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0241	-0.0346
4.期末基金资产净值	64,805,187.14	190,545,726.36
5.期末基金份额净值	0.7475	0.7328

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、华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)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	-2.48%	1.73%	-2.25%	1.75%	-0.23%	-0.02%
过去六个月	-16.84%	1.86%	-16.59%	1.87%	-0.25%	-0.01%
过去一年	-43.38%	1.78%	-42.73%	1.79%	-0.65%	-0.01%
过去三年	-20.69%	2.02%	-13.59%	2.07%	-7.10%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-25.25%	2.00%	-18.77%	2.06%	-6.48%	-0.06%

2、华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)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	-2.54%	1.73%	-2.25%	1.75%	-0.29%	-0.02%
过去六个月	-16.94%	1.86%	-16.59%	1.87%	-0.35%	-0.01%
过去一年	-43.52%	1.78%	-42.73%	1.79%	-0.79%	-0.01%
过去三年	-22.20%	2.03%	-13.59%	2.07%	-8.61%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-26.72%	2.01%	-18.77%	2.06%	-7.95%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2023 年 6 月 28 日至 2026 年 9 月 30 日）

1．华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)A：



2．华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)C：



注：1、本基金运作业绩比较基准收益率=经汇率调整后的恒生互联网科技业指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

2、本基金合同于 2023 年 6 月 28 日生效，自基金成立日起 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		
毛甜	本基金的基金经理	2023-06-28	-	16	武汉大学金融工程学士、硕士。2010-2012 年曾任国信证券经济研究所金融工程部助理分析师；2012-2017 年任职光大富尊投资有限公司，历任研究员、投资经理。2017 年 7 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，现担任基金经理。

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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外顾问。

4.3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《华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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%。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2026 年三季度，中国宏观经济平稳修复，但依然"供强需弱"、内部分化明显，三季度港股大盘先扬后抑，逆势收涨，在全球科技股回调背景下表现相对强势，7 月南向资金加速回流带动市场明显反弹，科技成长板块领涨，8 月美国通胀数据反复推高市场对美联储重启加息的定价，叠加地缘扰动影响，市场震荡回落，9 月美联储重启加息，海外流动性收紧，市场延续调整，港股互联网板块三季度

亦先扬后抑，基本面预期及资金面迎来边际改善，但整体仍承压，跑输港股大盘。截至本报告期末，恒生指数上涨 7.57%，恒生互联网科技业指数下跌 1.27%。在操作上，为实现对业绩基准的紧密跟踪，本着勤勉尽责的态度，本基金严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，以控制基金相对于目标指数的跟踪偏离为投资目标，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-2.48%，同期业绩比较基准收益率为-2.25%；本基金 C 类份额净值增长率为-2.54%，同期业绩比较基准收益率为-2.25%。

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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	241,411,893.43	92.70
	其中：普通股	241,411,893.43	92.70
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,012,352.60	1.16
	其中：债券	3,012,352.60	1.16
	资产支持证券	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,172,938.00	5.44
8	其他资产	1,827,988.48	0.70
9	合计	260,425,172.51	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97,846,251.82元人民币，占期末基金资产净值比例38.32%。

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 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	241,411,893.43	94.54

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	80,228,765.87	31.42
C 消费者常用品	1,336,147.90	0.52
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息科技	61,608,998.26	24.13

I 电信服务	98,237,981.40	38.47
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	241,411,893.43	94.54

注：以上分类采用财汇资讯提供的国际通用行业分类标准。

5.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资类股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

5.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴集团控股有限公司	09988	香港联合交易所	中国香港	413,300.00	37,820,079.51	14.81
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	00700	香港联合交易所	中国香港	102,200.00	37,811,855.85	14.81
3	NETEASE INC	网易股份有限公司	09999	香港联合交易所	中国香港	161,100.00	26,634,935.58	10.43
4	XIAOMI CORP-CLASS B	小米集团	01810	香港联合交易所	中国香港	1,102,000.00	23,876,505.92	9.35
5	MEITUAN-CLASS B	美团	03690	香港联合交易所	中国香港	386,600.00	23,794,732.83	9.32
6	JD.COM INC - CL A	京东集团股份有限公司	09618	香港联合交易所	中国香港	207,900.00	18,613,953.53	7.29
7	BAIDU INC-CLASS A	百度集团股份有限公司	09888	香港联合交易所	中国香港	213,850.00	15,750,573.44	6.17
8	KUAISHOU TECHNOLOGY	快手科技	01024	香港联合交易所	中国香港	406,200.00	10,788,474.91	4.22
9	HORIZON	地平线	09660	香港联合	中国香港	1,563,000	5,608,349	2.20

	ROBOTICS INC			交易所		.00	.73	
10	MINIMAX GROUP INC	MINIMAX GROUP INC.	00100	香港联合交易所	中国香港	25,380.00	5,451,032.24	2.13

5.4.2 积极投资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益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资类股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
A+至 A-	3,012,352.60	1.18

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪、惠誉提供的债券信用评级信息。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019835	26 国债 09	3,000,000.00	3,012,352.60	1.18

注：1、债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

2、数量列示债券面值。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	1,231.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,826,757.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,827,988.48

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2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类股票。

5.10.6 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	华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)A	华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起基金(QDII)C
本报告期期初基金份额总额	81,477,714.99	221,430,617.13
报告期期间基金总申购份额	15,198,302.49	249,179,165.17
减：报告期期间基金总赎回份额	9,983,390.62	210,597,355.70
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	86,692,626.86	260,012,426.60

§ 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	49,923,212.97	14.40%	10,000,000.00	2.88%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	49,923,212.97	14.40%	10,000,000.00	2.88%	3 年

注：1、持有份额总数部分包含利息结转的份额。

2、占基金总份额比例为持有基金份额与各类基金份额合计数的比例。

§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

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。

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、中国证监会准予华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)注册的文件；

2、《华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》；

3、《华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)托管协议》；

4、《华泰紫金恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)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恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)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、中国证监会规定的其他备查文件。

10.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

10.3 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