华泰紫金中证全指软件指数型发起式证券投资基金

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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	华泰紫金中证全指软件指数型发起
基金主代码	021614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 27 日
报告期末基金份额总额	86,142,370.78 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。	
业绩比较基准	中证全指软件指数收益率×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。	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金中证全指软件指数型发起 A	华泰紫金中证全指软件指数型发起 C
下属分级基金的交易代码	021614	021615
报告期末下属分级基金的份额总额	35,867,194.95 份	50,275,175.83 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)	
	华泰紫金中证全指软件指数型发起 A	华泰紫金中证全指软件指数型发起 C
1.本期已实现收益	-645,384.31	-895,808.75
2.本期利润	-2,323,123.14	-3,317,910.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0642	-0.0680
4.期末基金资产净值	42,108,286.35	58,721,200.55

5.期末基金份额净值	1.1740	1.1680

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

华泰紫金中证全指软件指数型发起 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	-5.12%	1.87%	-5.82%	1.85%	0.70%	0.02%
过去六个月	-15.40%	2.01%	-16.93%	1.99%	1.53%	0.02%
过去一年	-31.66%	1.95%	-32.58%	1.95%	0.92%	0.00%
自基金合同生效起至今	17.40%	2.22%	10.92%	2.26%	6.48%	-0.04%

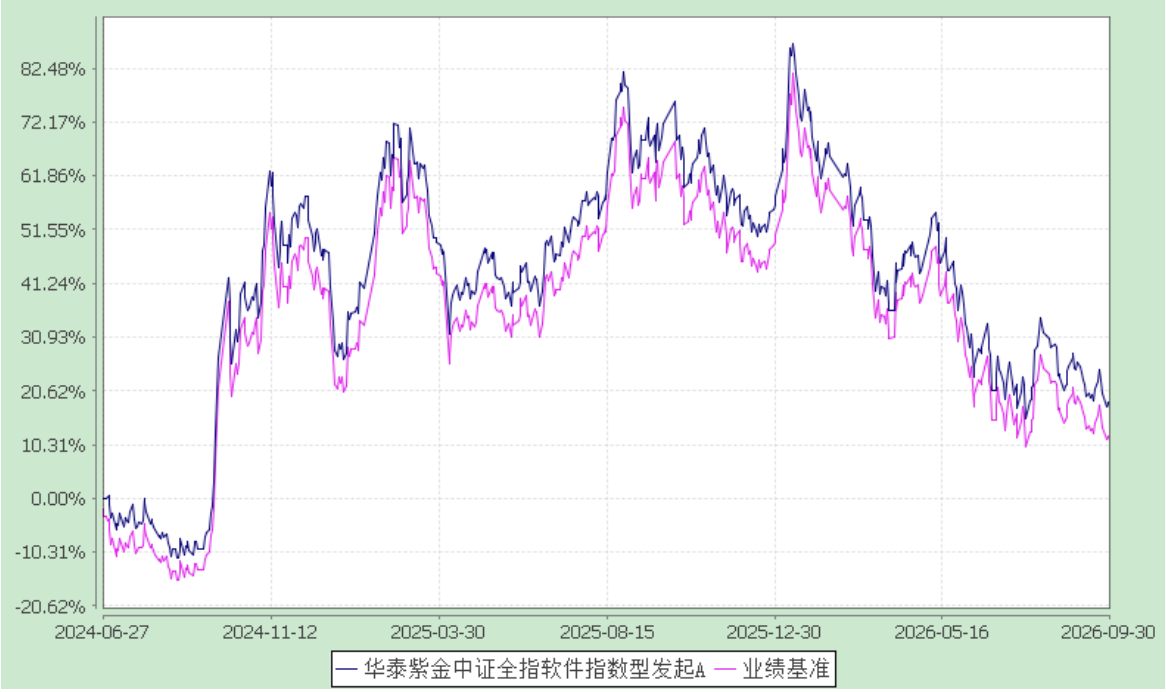
华泰紫金中证全指软件指数型发起 C

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	-5.18%	1.87%	-5.82%	1.85%	0.64%	0.02%
过去六个月	-15.51%	2.01%	-16.93%	1.99%	1.42%	0.02%
过去一年	-31.84%	1.95%	-32.58%	1.95%	0.74%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.80%	2.22%	10.92%	2.26%	5.88%	-0.04%

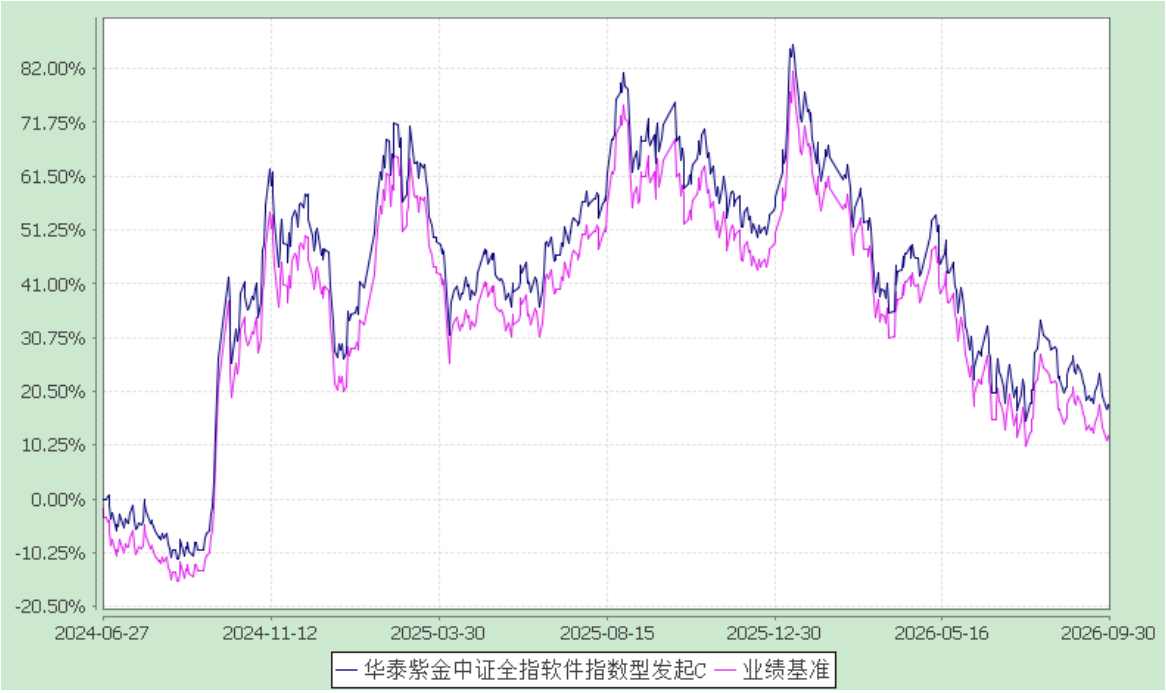
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金中证全指软件指数型发起式证券投资基金
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
(2024 年 6 月 27 日至 2026 年 9 月 30 日)

华泰紫金中证全指软件指数型发起 A



华泰紫金中证全指软件指数型发起 C



注：1、本基金业绩比较基准收益率=中证全指软件指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。

2、本基金合同于 2024 年 6 月 27 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	2024-06-27	-	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、中国证监会和《华泰紫金中证全指软件指数型发起式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，中国宏观经济平稳修复，但依然"供强需弱"、内部分化明显，受海外 AI 叙事转弱、美联储加息预期、地缘冲突等多重因素影响，叠加科技抱团瓦解的冲击，权益市场三季度深度调整，科技成长板块回撤最深，风格剧烈切换，资金转向防御。三季度，中国软件行业整体仍然呈现收入端稳健，利润端承压的态势，板块走势延续了年内的弱势格局，但相对“硬”科技板块抗跌，此外，虽然 A 股软件板块仍然受到“AI 颠覆论”压制，但海外已开始转向“AI 兑现论”。截止本报告期末，计算机（申万）指数下跌 8.13%，中证全指软件指数下跌 6.18%。

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。

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-5.12%，同期业绩比较基准收益率为-5.82%；本基金 C 类份额净值增长率为-5.18%，同期业绩比较基准收益率为-5.82%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金的基金合同生效未满三年，暂不适用。

§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	95,121,628.43	93.70
	其中：股票	95,121,628.43	93.70
2	固定收益投资	1,520,056.03	1.50
	其中：债券	1,520,056.03	1.50
	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	4,433,544.74	4.37
7	其他资产	444,303.35	0.44

8	合计	101,519,532.55	100.00

注：1、本基金报告期末未持有港股通股票。

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

5.2.1.1积极投资按行业分类的股票投资组合

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	14,697.46	0.01
C	制造业	332,502.96	0.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,058.64	0.04
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	388,259.06	0.39

5.2.1.2指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	-	-
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	81,774,859.69	81.10
J	金融业	12,958,509.68	12.85
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	94,733,369.37	93.95

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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股票投资明细

5.3.1 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	002230	科大讯飞	254,200.00	9,461,324.00	9.38

2	300033	同花顺	39,260.00	7,736,575.60	7.67
3	688111	金山办公	29,995.00	6,562,906.00	6.51
4	300454	深信服	35,700.00	4,905,894.00	4.87
5	601360	三六零	476,400.00	4,263,780.00	4.23
6	300803	指南针	72,536.00	3,846,584.08	3.81
7	600570	恒生电子	192,400.00	3,732,560.00	3.70
8	002261	拓维信息	155,600.00	3,690,832.00	3.66
9	300339	润和软件	103,800.00	3,508,440.00	3.48
10	300496	中科创达	51,800.00	2,740,220.00	2.72

5.3.2 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	301666	大普微	244.00	80,798.16	0.08
2	688781	视涯科技	1,629.00	60,028.65	0.06
3	001248	华润新能	4,396.00	41,058.64	0.04
4	301660	粤芯半导体	2,711.00	32,559.11	0.03
5	301569	联亚药业	3,261.00	22,827.00	0.02

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	1,520,056.03	1.51
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	1,520,056.03	1.51

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	15,000.00	1,520,056.03	1.51

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	21,953.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	422,350.24
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	444,303.35

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

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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	301666	大普微	80,798.16	0.08	新股锁定
2	688781	视涯科技	60,028.65	0.06	新股锁定
3	001248	华润新能	41,058.64	0.04	新股锁定
4	301660	粤芯半导体	19,540.27	0.02	新股锁定
4	301660	粤芯半导体	13,018.84	0.01	新股锁定
5	301569	联亚药业	20,538.00	0.02	新股锁定
5	301569	联亚药业	2,289.00	0.00	新股锁定

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	华泰紫金中证全指软件指数型发起A	华泰紫金中证全指软件指数型发起C
报告期期初基金份额总额	36,275,466.35	47,300,804.19
报告期期间基金总申购份额	7,722,139.01	31,431,483.63
减：报告期期间基金总赎回份额	8,130,410.41	28,457,111.99
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	35,867,194.95	50,275,175.83

§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	华泰紫金中证全指软件指数型发起 A	华泰紫金中证全指软件指数型发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,009,347.57	-
报告期期间期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,009,347.57	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	27.91	-

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 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	10,009,347.57	11.62%	10,000,000.00	11.61%	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	10,009,347.57	11.62%	10,000,000.00	11.61%	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、中国证监会准予本基金募集注册的文件；

2、《华泰紫金中证全指软件指数型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《华泰紫金中证全指软件指数型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《华泰紫金中证全指软件指数型发起式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中证全指软件指数型发起式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