华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）
2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

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27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 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 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）
基金主代码	019524
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 10 月 19 日
报告期末基金份额总额	878,583,380.35 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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、跟踪误差进一步扩大。 1、资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。此外，为更好地实

	现投资目标，本基金可投资于其他境外市场投资工具和境内市场投资工具。 本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。 2、目标 ETF 投资策略 本基金为华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 的联接基金。华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 是采用完全复制法实现对纳斯达克 100 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。 3、成份股、备选成份股投资策略 根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股紧密跟踪标的指数。 4、存托凭证投资策略 5、衍生品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）股票期权投资策略；（3）国债期货投资策略 6、债券投资策略 7、资产支持证券投资策略 8、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率（使用估值汇率折算）×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 的联接基金，主要投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与纳斯达克 100 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金主要通过投资于目标 ETF 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，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。		
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司		
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	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）A	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）C	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）I
下属分级基金的交易代码	019524	019525	022664
报告期末下属分级基金的份额总额	481,521,001.94 份	360,361,768.02 份	36,700,610.39 份
境外资产托管人	英文名称：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited		
	中文名称：香港上海汇丰银行有限公司		

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金主代码	513110
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 1 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 3 月 20 日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券的投资策略；3、衍生品投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为纳斯达克 100 指数收益率（使用估值汇率折算）。

风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。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。

§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）		
	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）A	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）C	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）I
1.本期已实现收益	1,940,577.21	1,158,912.13	124,350.77
2.本期利润	-5,363,791.76	-5,576,261.97	-340,861.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0112	-0.0152	-0.0095
4.期末基金资产净值	812,217,453.13	602,606,125.03	61,819,924.91
5.期末基金份额净值	1.6868	1.6722	1.6844

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

华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（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	-0.67%	1.14%	-0.62%	1.15%	-0.05%	-0.01%

过去六个月	23.30%	1.30%	23.39%	1.31%	-0.09%	-0.01%
过去一年	14.84%	1.21%	16.02%	1.23%	-1.18%	-0.02%
自基金合同生效起至今	68.68%	1.22%	85.86%	1.25%	-17.18%	-0.03%

华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）C

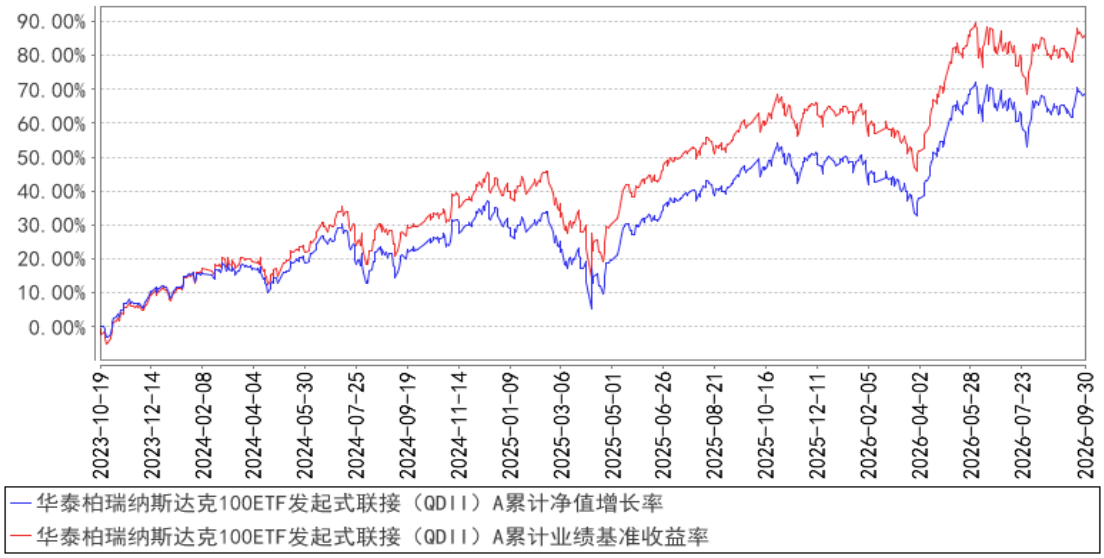
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.73%	1.14%	-0.62%	1.15%	-0.11%	-0.01%
过去六个月	23.15%	1.30%	23.39%	1.31%	-0.24%	-0.01%
过去一年	14.54%	1.21%	16.02%	1.23%	-1.48%	-0.02%
自基金合同生效起至今	67.22%	1.22%	85.86%	1.25%	-18.64%	-0.03%

华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）I

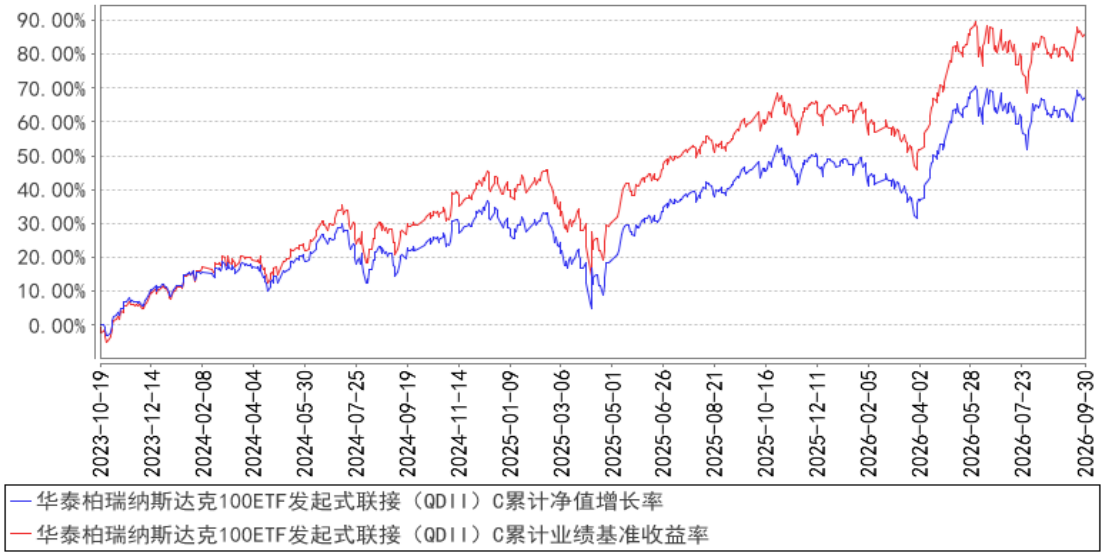
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.70%	1.14%	-0.62%	1.15%	-0.08%	-0.01%
过去六个月	23.24%	1.30%	23.39%	1.31%	-0.15%	-0.01%
过去一年	14.68%	1.21%	16.02%	1.23%	-1.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.61%	1.33%	35.08%	1.34%	-5.47%	-0.01%

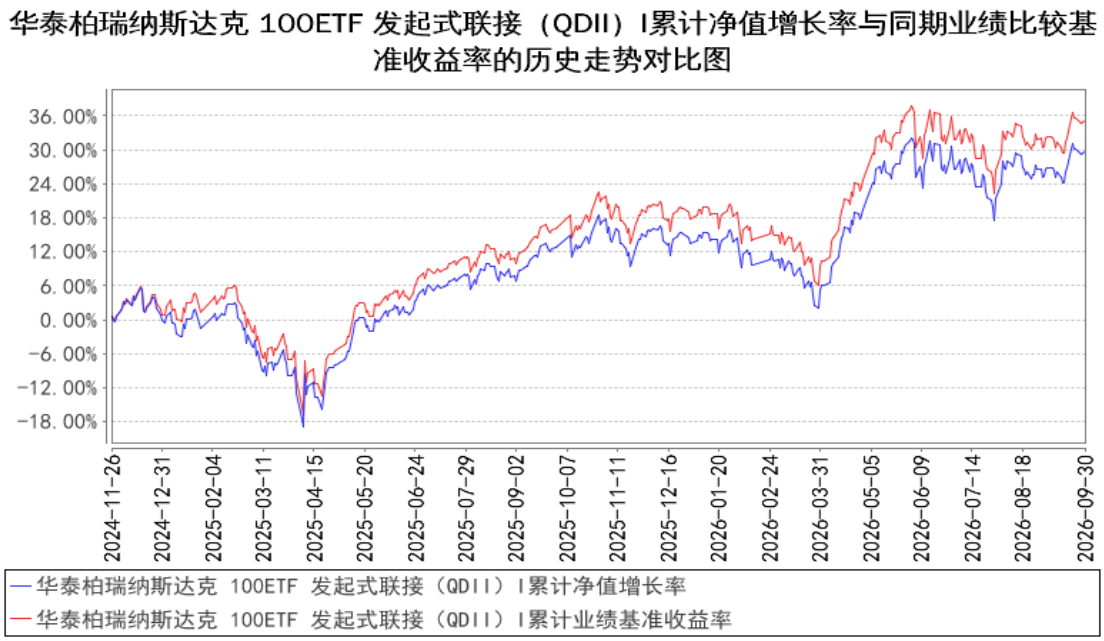
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞纳斯达克100ETF发起式联接（QDII）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞纳斯达克100ETF发起式联接（QDII）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：A 类图示日期为 2023 年 10 月 19 日至 2026 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2023 年 10 月 19 日至 2026 年 9 月 30 日。I 类图示日期为 2024 年 11 月 26 日至 2026 年 9 月 30 日。

§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		
李沐阳	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 10 月 19 日	-	9 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 4 月任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 2 月任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏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。2022 年 4 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任

					华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月至 2025 年 10 月任华泰柏瑞中证全指电力公用事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。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞中证 2000 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。2024 年 1 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 2 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 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 4 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 5 月至 2026 年 5 月任华泰柏瑞恒生消费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 5 月起任华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月起任华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备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。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

截至本报告期末华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）A 的基金份额净值为 1.6868 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.67%，同期业绩比较基准收益率为-0.62%，截至本报告期末华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）C 的基金份额净值为 1.6722 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.73%，同期业绩比较基准收益率为-0.62%，截至本报告期末华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）I 的基金份额净值为 1.6844 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.70%，同期业绩比较基准收益率为-0.62%。

2026 年第三季度，纳斯达克 100 指数在“AI 叙事继续、美联储重启加息、美伊冲突推高油价”

的三重拉扯中，走出剧烈震荡行情。季初半导体与存储高估值板块下跌较多，影响纳斯达克 100 指数表现；随后部分科技龙头盈利韧性带动指数回拉，但 9 月美联储加息 25bp、10 年美债收益率逼近 2002 年以来高位、布伦特原油重回 100 美元上方，又让成长股反复承压，全季呈现“AI 基本面强、分母端估值紧、地缘扰动放大波动”的特征。

展望第四季度，纳斯达克 100 指数表现受“AI 资本开支转盈利”与“美伊冲突会否进一步升级”的博弈影响。积极因素在于云厂、半导体、推理端应用仍处高景气，三季报若确认 AI 从训练走向收入与现金流，龙头高 ROE 属性有望消化部分高估值；若美伊谈判破裂、霍尔木兹或曼德海峡受限致油价再冲 110—120 美元，通胀粘性与美联储继续加息预期将抬升贴现率，纳指 100 指数可能会产生较大回撤。整体看纳斯达克 100 指数仍是布局全球科技进攻的有力工具之一，但需严控“AI 泡沫质疑+强美元/高利率+地缘升级”三重压制下的高波动风险。

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，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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	-	-
	其中：普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	1,347,396,879.92	90.96
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	127,423,865.76	8.60
8	其他资产	6,483,246.04	0.44
9	合计	1,481,303,991.72	100.00

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

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

5.4.1 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

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.7 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

注：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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	期货品种_指数	NQ2612	-	-

注：期货投资采用无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）

1	华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	1,347,396,879.92	91.25

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	4,852,791.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,630,454.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,483,246.04

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）A	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）C	华泰柏瑞纳斯达克 100ETF 发起式联接（QDII）I
报告期期初基金份额总额	480,590,370.60	379,310,452.19	35,245,542.54
报告期期间基金总申购份额	29,320,166.04	14,252,149.89	5,013,136.80
减:报告期期间基金总赎回份额	28,389,534.70	33,200,834.06	3,558,068.95
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	481,521,001.94	360,361,768.02	36,700,610.39

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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	10,000,450.00	1.14	10,000,450.00	1.14	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	10,000,450.00	1.14	10,000,450.00	1.14	-

§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

注：本报告期内未有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

注：无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

10.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

托管人住所

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026年10月27日