

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 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 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：国泰海通证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题 ETF
场内简称	科半导体(扩位证券简称：科创半导体设备 ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	588710
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 5 月 26 日
报告期末基金份额总额	1,350,295,000.00 份
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。
投资策略	1、股票（含存托凭证）的投资策略；2、债券投资策略；3、金融衍生工具投资策略； 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	上证科创板半导体材料设备主题指数收益率
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。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司

§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 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	871,524,360.87
2. 本期利润	2,186,934,722.89
3. 加权平均基金份额本期利润	2.5910
4. 期末基金资产净值	5,655,353,411.84
5. 期末基金份额净值	4.1882

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。

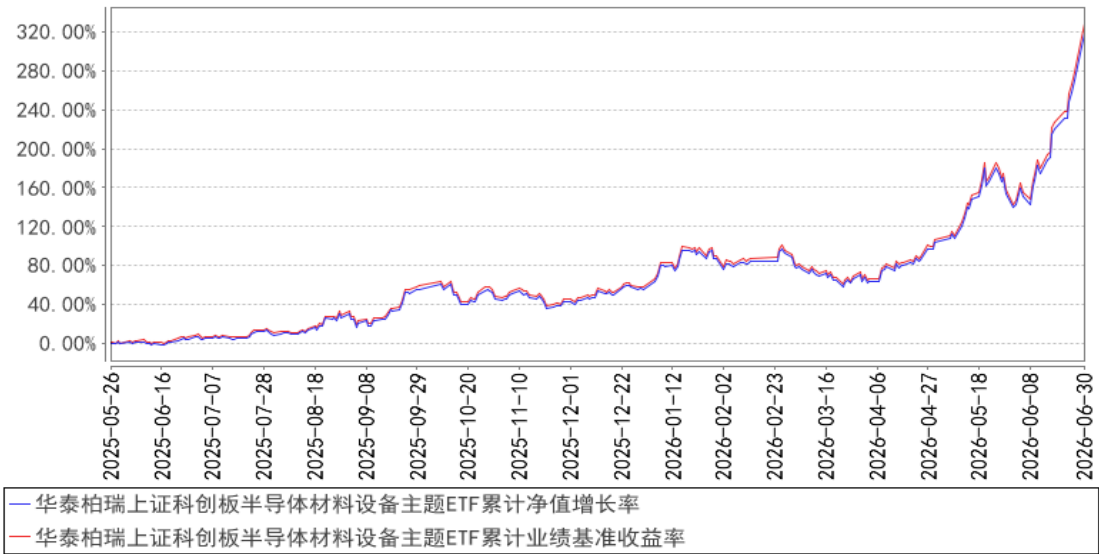
3.2 基金净值表现

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

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	156.11%	3.53%	157.52%	3.57%	-1.41%	-0.04%
过去六个月	169.51%	3.26%	171.20%	3.29%	-1.69%	-0.03%
过去一年	294.55%	2.83%	296.01%	2.85%	-1.46%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	318.82%	2.71%	327.99%	2.74%	-9.17%	-0.03%

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

华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题ETF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：1、图示日期为 2025 年 5 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

§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	2025 年 5 月 26 日	-	8 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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内的公平交易模块，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。

4.3.2 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 4 次，是指数或量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年第二季度，科创半导体设备指数在半导体前道设备国产化率加速提升与晶圆厂扩产节奏加快的驱动下创下历史新高。4 月受季初科技板块整体调整影响；5 月国内头部晶圆厂招标落地、关键制程设备验证通过消息频出，订单高增预期强化，龙头标的引领指数显著跑赢科创宽基；6 月初冲高后获利盘有所兑现，但受益于中报预告暗示营收确认加速与长鑫上市扩产利好影响，指数继续冲高。

展望第三季度，科创半导体设备 ETF 表现取决于“下游晶圆厂资本开支强度”与“国产替代政策落地节奏”。积极因素在于先进制程与成熟制程同步扩产带来设备招标大年、大基金三期持续注资及零部件国产化闭环推进，为中报及三季报提供可见的订单收入转化逻辑。风险来自美日荷出口管制边际变动扰动供应链预期、部分标的估值处历史高位易受市场风格切换压制、及晶圆厂

capex 节奏低于预期引发预期下修。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 4.1882 元，本报告期基金份额净值增长率为 156.11%，业绩比较基准收益率为 157.52%。

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，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	5,451,078,672.03	93.94
	其中：股票	5,451,078,672.03	93.94
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,619,028.39	0.03
	其中：债券	1,619,028.39	0.03
	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	349,659,813.74	6.03
8	其他资产	60,492.63	0.00
9	合计	5,802,418,006.79	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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

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	5,446,816,130.17	96.31
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	-	-
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	5,446,816,130.17	96.31

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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

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	4,262,541.86	0.08
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	-	-
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	4,262,541.86	0.08

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	688120	华海清科	1,822,792	587,267,126.56	10.38
2	688012	中微公司	1,204,261	564,196,278.50	9.98
3	688361	中科飞测	1,128,106	485,085,580.00	8.58
4	688072	拓荆科技	470,147	387,581,742.68	6.85
5	688200	华峰测控	663,967	347,826,783.70	6.15
6	688037	芯源微	756,142	331,984,145.10	5.87
7	688126	沪硅产业	7,872,546	314,035,859.94	5.55
8	688019	安集科技	856,786	290,844,575.56	5.14
9	688082	盛美上海	670,603	289,700,496.00	5.12
10	688409	富创精密	861,161	263,730,556.25	4.66

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

5.3.2 报告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	688802	沐曦股份	1,963	1,509,331.07	0.03
2	688818	电科蓝天	17,168	1,266,122.03	0.02
3	688820	盛合晶微	2,193	310,287.57	0.01
4	688790	昂瑞微	2,145	271,235.25	0.00
5	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	-	-
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）	1,619,028.39	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,619,028.39	0.03

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	118071	华峰转债	16,190	1,619,028.39	0.03

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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 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。

5.11.2 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

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	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	—
9	合计	60,492.63

5.11.4 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。

5.11.5 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 报告期末指数投资前十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	688072	拓荆科技	356,814,016.00	6.31	重大事项停牌
1	688072	拓荆科技	30,767,726.68	0.54	非公开发行流通受限
2	688200	华峰测控	6,949,192.00	0.12	新股锁定期内

5.11.5.2 报告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	688802	沐曦股份	1,509,331.07	0.03	新股锁定期内
2	688820	盛合晶微	310,287.57	0.01	新股锁定期内
3	688790	昂瑞微	271,235.25	0.00	新股锁定期内
4	688781	视涯科技	267,083.60	0.00	新股锁定期内
5	688818	电科蓝天	120,430.38	0.00	新股锁定期内

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	914,295,000.00
报告期期间基金总申购份额	3,502,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	3,066,000,000.00
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	1,350,295,000.00

§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

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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 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

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 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 7 月 21 日