

华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式 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：申万宏源证券有限公司

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。

基金托管人申万宏源证券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	华泰柏瑞中证智能汽车主题 ETF
场内简称	智能驾驶(扩位证券简称：智能驾驶 ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	516520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 日
报告期末基金份额总额	863,765,466.00 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。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、股票的投资策略 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，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。 但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

	2、存托凭证的投资策略 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 3、债券投资策略 本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。 4、股指期货的投资策略 本基金投资股指期货时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 5、资产支持证券的投资策略 资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。 6、融资及转融通证券出借业务 本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。 本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证智能汽车主题指数收益率。
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	申万宏源证券有限公司

§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	-52,647,115.49
2. 本期利润	48,464,242.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0548
4. 期末基金资产净值	1,047,461,411.92
5. 期末基金份额净值	1.2127

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。

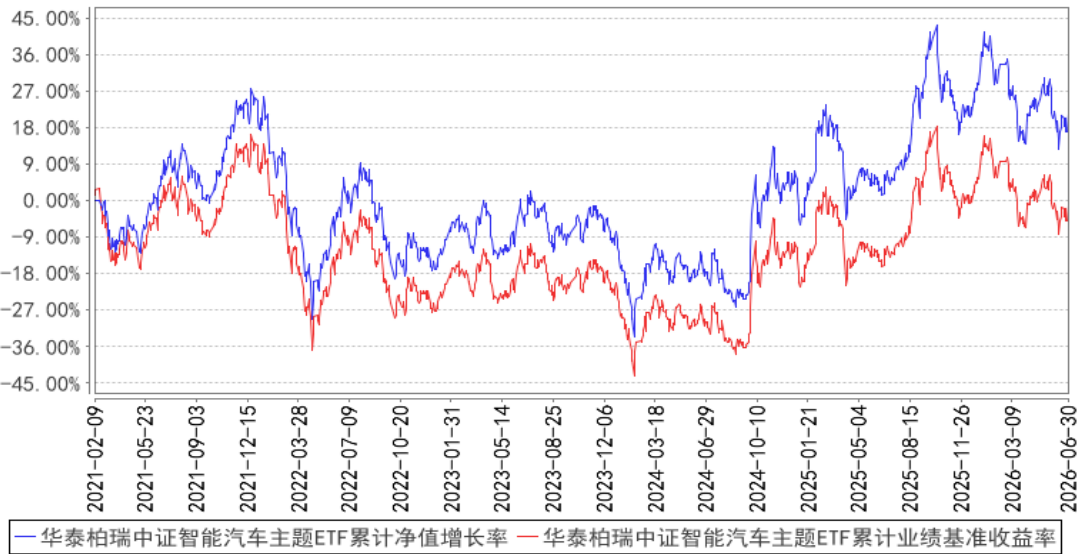
3.2 基金净值表现

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	5.44%	1.78%	4.68%	1.80%	0.76%	-0.02%
过去六个月	-5.66%	1.74%	-6.44%	1.75%	0.78%	-0.01%
过去一年	13.03%	1.61%	11.03%	1.62%	2.00%	-0.01%
过去三年	25.77%	1.87%	17.04%	1.90%	8.73%	-0.03%
过去五年	10.41%	1.83%	-4.86%	1.87%	15.27%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	21.27%	1.82%	-1.36%	1.86%	22.63%	-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

华泰柏瑞中证智能汽车主题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：图示日期为 2021 年 2 月 9 日至 2026 年 6 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		
谭弘翔	指数投资部总监、本基金的基金经理	2021 年 3 月 10 日	—	10 年	美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融工程专业硕士。曾任上海证券交易所产品创新中心基金业务部经理。2020 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部总监。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 6 月至 2026 年 2 月任华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任

				华泰柏瑞中证稀土产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。2022 年 1 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月至 2025 年 7 月任华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月至 2024 年 6 月任华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 8 月至 2025 年 7 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月至 2024 年 6 月任华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月至 2025 年 7 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月起任华泰柏瑞上证科创板 100 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 6 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞创业板科技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。2024 年 9 月起任华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起任华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2025 年 2 月至 2026 年 2 月任华泰柏瑞创业板 50 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综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2025 年 5 月至 2026 年 5 月任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证港股通科技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 8 月起任华泰柏瑞中证通用航空主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	---

					2025 年 10 月起任华泰柏瑞中证全指航空航天交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月起任华泰柏瑞中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

二季度，中证智能汽车主题指数上涨 4.68%，但落后于沪深 300 指数等大盘宽基指数。主要原因在于指数成份股中包括多只半导体行业股票，在二季度伴随 AI 算力板块的拉升而取得较大涨幅，但大部分整车和汽车零部件企业受制于 4、5 月份宏观经济数据的下滑、我国乘用车销量的同比萎缩、汽车行业“内卷”并未实质性缓解、净利润率探底压制产业链整体盈利水平等因

素，表现更接近顺周期板块，相互叠加之后指数表现虽然略好于大多数顺周期板块，但难以突破上限。

从三季度开始，一是 AI 算力板块的“抱团”开始松动，市场资金开始关注其他低位成长赛道，尤其是 AI 下游应用领域，近期“物理 AI”、“世界模型”也逐步成为 AI 下半场的主流叙事，而智能驾驶无疑是 AI 与现实世界相互融合最为直接的落地场景之一，也是产业基础最成熟，潜在商业化应用节奏最快的方向之一；二是道路交通安全法修订草案已纳入《国务院 2026 年度立法工作计划》，且顺位较为靠前，有望在今年年内落地，为 L3 及以上级别自动驾驶提供法律基础，为高阶自动驾驶的推广应用铺平道路；三是随着美伊冲突对我国经济基本面冲击的余波逐渐消散，因供给侧扰动而造成的上游原材料、能源价格上涨实现有效回落，我国在“反内卷”和扩内需层面的政策储备也有望陆续出台，缓解汽车产业链整体的盈利压力，有望打开智能驾驶板块上升空间。

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 1.2127 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.44%，业绩比较基准收益率为 4.68%。

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	1,034,303,825.00	97.94
	其中：股票	1,034,303,825.00	97.94
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	15,771,571.09	1.49

8	其他资产	5,989,917.95	0.57
9	合计	1,056,065,314.04	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	755,686,219.99	72.14
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	274,911,885.93	26.25
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	1,030,598,105.92	98.39

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	36,149.82	0.00
C	制造业	3,207,293.53	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	454,616.37	0.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—

G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
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	6,075.90	0.00
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	3,705,719.08	0.35

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	688521	芯原股份	233,498	86,660,447.72	8.27
2	300223	北京君正	334,900	83,356,610.00	7.96
3	002475	立讯精密	755,840	53,211,136.00	5.08
4	603501	豪威集团	534,463	50,693,815.55	4.84
5	002230	科大讯飞	1,131,200	46,198,208.00	4.41
6	002594	比亚迪	548,400	43,707,480.00	4.17
7	601127	赛力斯	673,800	41,270,250.00	3.94
8	601689	拓普集团	729,798	41,175,203.16	3.93
9	000625	长安汽车	5,706,900	40,918,473.00	3.91
10	002456	欧菲光	3,876,300	36,669,798.00	3.50

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	1,032	793,494.48	0.08
2	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
3	001248	华润新能源	44,967	454,616.37	0.04
4	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.03
5	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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	2,444,170.36
2	应收证券清算款	3,485,254.96
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	5,989,917.95

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

注：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。

5.11.5.2 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	793,494.48	0.08	新股锁定期内
2	301666	大普微	565,262.60	0.05	新股锁定期内
3	001248	华润新能源	318,232.47	0.03	新股锁定期内
3	001248	华润新能源	136,383.90	0.01	新股未上市

4	688781	视涯科技	267,083.60	0.03	新股锁定期内
5	688808	联讯仪器	258,245.79	0.02	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

注：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	871,765,466.00
报告期期间基金总申购份额	786,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	794,000,000.00
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	863,765,466.00

§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 层及托管人住所

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