

鹏华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 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 04 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华科创板半导体材料设备主题 ETF
场内简称	KC 半导体(扩位简称:科创半导体设备 ETF 鹏华)
基金主代码	589020
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 27 日
报告期末基金份额总额	398,219,000.00 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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，力求降低跟踪偏离度和跟踪误差。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。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。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p>

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪偏离度和跟踪误差。

#### （2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率间的高度正相关和跟踪偏离度、跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

##### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

##### 2) 不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪偏离度和跟踪误差。

#### 2、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

#### 3、债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，力争增强本基金的收益。

#### 4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好

	<p>地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪偏离度、跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>6、融资及转融通投资策略</p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。</p>
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	<p>本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p> <p>本基金资产投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险、投资集中风险等。</p>
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司

注：无。

### § 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1月1日 - 2026年3月31日）
1. 本期已实现收益	36,544,201.49
2. 本期利润	-22,773,779.05

3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0589
4. 期末基金资产净值	508,827,991.41
5. 期末基金份额净值	1.2778

注：1. 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

2. 所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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

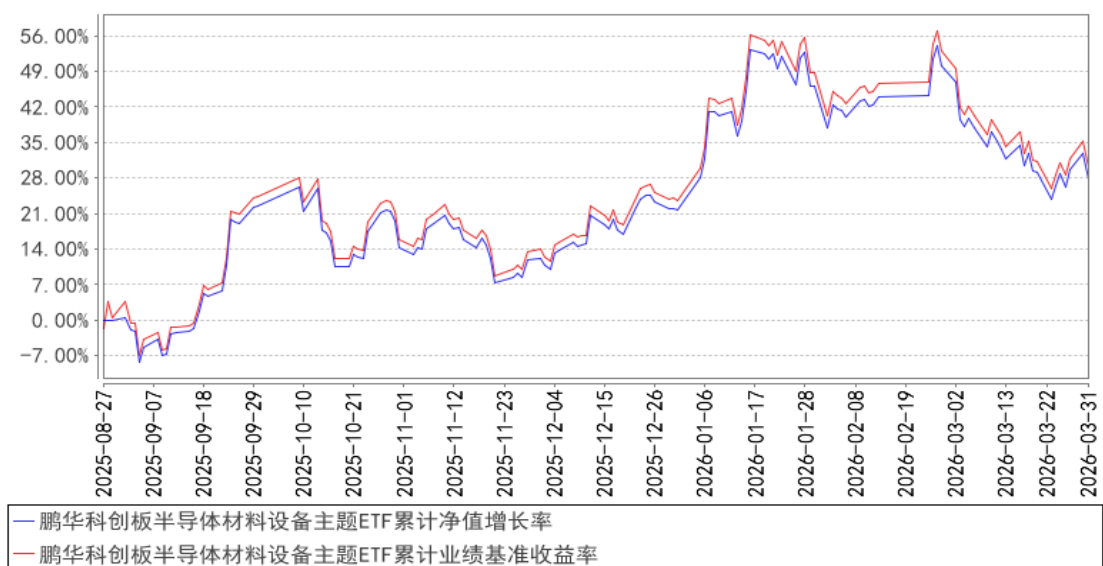
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.12%	2.76%	5.31%	2.78%	-0.19%	-0.02%
过去六个月	4.40%	2.49%	4.65%	2.52%	-0.25%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	27.78%	2.56%	30.07%	2.67%	-2.29%	-0.11%

注：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。

### 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

鹏华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、本基金基金合同于 2025 年 08 月 27 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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		
林嵩	本基金的基金经理	2025-08-27	-	11 年	林嵩先生, 国籍中国, 理学硕士, 11 年证券从业经验。2015 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部量化研究员、投资经理等, 现担任指数与量化投资部副总监/基金经理。2023 年 06 月至今担任鹏华国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2024 年 10 月至今担任鹏华国证疫苗与生物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 11 月至今担任鹏华北证 50 成份指数发起式证券投资基金基金经理, 2025 年 03 月至今担任鹏华上证科创板生物医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2025 年 03 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资

					基金基金经理，2025 年 03 月至今担任鹏华中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华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基金经理，2025 年 09 月至今担任鹏华上证科创板生物医药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 09 月至今担任鹏华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 09 月至今担任鹏华中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 12 月至今担任鹏华中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 03 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，林嵩先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 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

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向

交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的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超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，市场行情跌宕起伏，行情起始于春季躁动预期下的流动性宽松，而终于地缘冲突和宏观流动性环境收紧，再一次提醒我们，身处百年未有之大变局的环境下、资产价格的波动也将一再超出历史经验和过往认知。我们对战争的走势没有任何判断、对交战各方的话语也难辨真假，我们能够跟踪到的数据如海峡通行量、导弹和无人机发射量确实在边际好转，但依旧无法排除尾部风险：即实质性的地面战争和由此带来的能源设施实质性摧毁。因此我们只能把逻辑的起点放在 3~6 个月后，当战争平息之后，霍尔木兹海峡通航恢复需要时间、通航量的降低及运费的提升、原油库存的回补等，带来油价以及更广谱的能源价格的中枢抬升；更重要的是，能源、粮食的自主可控，和进一步的生产要素的冗余备份和供应链的安全可靠，都是可预期的战争带来的疤痕效应。而我国靠着长期持续推进能源多元化和最完备的制造业产业体系，尽管无法完全免疫能源成本的提升，但毫无疑问是最具韧性的经济体之一；对应的，无论是优势产业的出海还是资本市场的引进来，也将具备更强的竞争优势。

一季度，电子（中信）行业指数下跌 2.3%，跑赢沪深 300 指数 1.6%，在 30 个一级行业指数中位于第 17 位。细分子行业中，被动元器件、半导体设备、半导体材料是表现最好的子行业，分别跑赢行业指数 13.9%、11.5%、6.8%。科创半导体材料设备指数、中证半导体材料设备指数本运作期内分别上涨 5.3%、6.5%。

开年以来，人工智能产业的投资呈现两个明显的特征，算力侧的超额收益来源从算力芯片、光模块往上游移动，应用侧在春节后面临了超额收益的回撤。

算力侧，随着互联网公司最新季报披露指引的资本开支计划（无论是国内还是海外，大厂的资本开支今年都有 50% 以上的同比增长），市场已不再讨论“AI 泡沫论”，但超额收益的核心环节从直接受益于资本开支的环节如算力芯片往更上游的晶圆制造、半导体制造设备、存储器件、数据中心侧的电力设备等方向转移，反映的是产业链供需矛盾的变化，当前供给瓶颈的制约更多发生在相对更重资产的环节。对于国产环节来说，逻辑相对更简单一些，即在国产替代的长期趋势下、国产渗透率有望在 2030 年达到 70% 以上，无论是国产设备/材料、国产芯片，其中枢都是

逐渐抬升的。我们会更看好半导体制造设备和材料，核心的投资逻辑是晶圆厂资本开支以及国产替代。我们认为，供应链的自主可控要求下，设备和材料的国产化率不断提升是半导体设备及材料最具确定性的投资逻辑。市场的短期波动更多是围绕晶圆厂资本开支预期去展开。2025 年中国大陆自荷兰进口光刻机合计超过 97 亿美元，同比增长 5%，仅 12 月单月就进口了 33 台光刻机共 21.8 亿美元，明显超出预期。全年进口光刻机的平均单台价值超过 5000 万美元，同比涨幅达到 38%；考虑到国内进口的高端机台 ArF 浸没式光刻机单机价值量约为 7000~8000 万美元、配套非关键层的辅助光刻机价值量约为 2000~3000 万美元，以 25 年进口的光刻机价值推测，我们认为 26 年的扩产将会以先进制程（包含先进逻辑和先进存储）为主。短期的事件催化主要是两大存储原厂的 IPO 进程和新技术节点的迭代。

应用侧，我们在 3 个月前对于 AI 应用的判断与近期我们观察到的产业变化有一定的偏离。我们认为，AI 应用会是时间的朋友，因为模型能力的进步和推理成本的降低会随时间的推移而强化，这会为很多积极拥抱 AI 变革的公司带来产品体验的迭代；但，过去三个月，我们看到，新模型的发布不再降低成本，反而由于模型能力的提升和 Agent 智能体使用场景的增加、模型 API 的定价在提高，使得应用层的 AI 使用成本在显著增加。如，新发布的 gpt-5.4-pro 模型、glm-5 模型，同比口径下词元价格都有明显涨价。尽管单位智能的成本确实明显降低（因模型确实一直在变强、能做的事情/解锁的场景变多），但由于词元使用量也在显著增加（如最近很火的“养虾”OpenClaw 单任务消耗量是 ChatBot 问答场景的 10~100 倍），获得高智能的成本痛感也是强烈的。另一方面，我们也看到，海外对于模型厂商降维打击 SaaS/软件公司的讨论在增加，Anthropic 的新插件发布也带来了对应方向的软件公司的股价波动。目前，我们认为 SaaS 公司基于订阅费商业模式大概率会受到模型公司的冲击、使其毛利会有较大影响，客户使用粘性、迁移成本有可能被高估、使得软件的可替代性变强；而更好的产品、私有化数据、独特的壁垒（如网络效应、合规/监管牌照、嵌入交易链路等）则变得更加重要。对于国内软件公司来说，其商业模式更多是 2B、2G 而非海外的 SaaS 模式，受到的冲击相对更小，但同时模型能力的进步也降低了软件工程和编程的门槛。简单总结，随着模型能力的进步、模型使用成本不再指数级降低甚至还阶段性增加，软件公司的可及市场空间会受到原生模型公司的侵蚀。

本基金跟踪的标的指数为上证科创板半导体材料设备主题指数（950125）。在投资运作上，本基金秉承指数基金的投资策略，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 5.12%，同期业绩比较基准增长率为 5.31%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 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	505,579,689.95	99.28
	其中：股票	505,579,689.95	99.28
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	3,551,586.47	0.70
8	其他资产	90,410.70	0.02
9	合计	509,221,687.12	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含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	505,376,674.56	99.32
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	505,376,674.56	99.32

### 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	203,015.39	0.04
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	203,015.39	0.04

### 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：无。

## 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	688072	拓荆科技	147,017	54,396,290.00	10.69
2	688120	华海清科	309,927	53,927,298.00	10.60
3	688012	中微公司	164,430	50,378,063.40	9.90
4	688361	中科飞测	262,742	39,949,921.10	7.85
5	688019	安集科技	147,876	37,069,555.68	7.29
6	688126	沪硅产业	2,100,337	35,495,695.30	6.98
7	688037	芯源微	201,682	33,793,835.92	6.64
8	688200	华峰测控	118,644	31,179,643.20	6.13
9	688234	天岳先进	269,044	22,034,703.60	4.33
10	688409	富创精密	191,609	17,263,970.90	3.39

**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	688781	视涯科技-UW	4,073	120,968.10	0.02
2	603459	红板科技	2,838	50,232.60	0.01
3	603175	超颖电子	169	12,636.13	0.00
4	688816	易思维	127	6,891.02	0.00
5	603092	德力佳	97	6,149.80	0.00

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：无。

**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：无。

**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：无。

**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：无。

**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：无。

**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：无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪偏离度、跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

## 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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 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：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 5.11.2 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

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 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	90,410.70
8	其他	-
9	合计	90,410.70

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 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：无。

##### 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	688781	视涯科技-UW	120,968.10	0.02	新股流通受限
2	603459	红板科技	45,205.80	0.01	新股未上市
2	603459	红板科技	5,026.80	0.00	新股流通受限
3	603175	超颖电子	12,636.13	0.00	新股流通受限
4	688816	易思维	6,891.02	0.00	新股流通受限
5	603092	德力佳	6,149.80	0.00	新股流通受限

#### 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，投资组合报告中数字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	244,219,000.00
报告期期间基金总申购份额	592,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	438,000,000.00
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	398,219,000.00

## §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：无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 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：无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华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基金合同》；
- (二) 《鹏华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托管协议》；
- (三) 《鹏华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 1 季度报告》（原文）。

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

### 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 4 月 21 日