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
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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

基金简称	华泰柏瑞中证港股通科技 ETF
场内简称	港科技 50（扩位证券简称：港股通科技 ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	513150
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 25 日
报告期末基金份额总额	101,559,805.00 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 0.35%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 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。 2、存托凭证投资策略 本基金将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，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、债券的投资策略 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。
业绩比较基准	中证港股通科技指数收益率（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。本基金可投资港股通标的股票，除需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，还需承担汇率风险以及香港市场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	中国银行股份有限公司

§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 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	-1,013,547.57
2.本期利润	-275,091.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0026
4.期末基金资产净值	92,593,146.03
5.期末基金份额净值	0.9117

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。

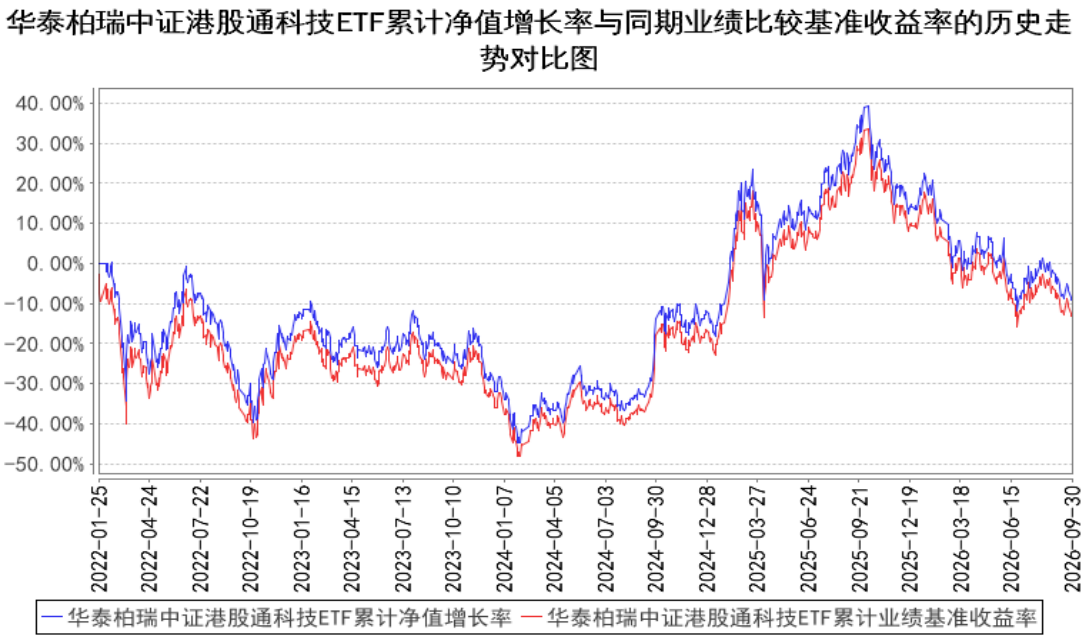
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-0.93%	1.55%	-0.93%	1.58%	0.00%	-0.03%
过去六个月	-7.50%	1.65%	-7.66%	1.69%	0.16%	-0.04%
过去一年	-34.40%	1.66%	-34.53%	1.70%	0.13%	-0.04%
过去三年	18.63%	1.97%	20.16%	2.02%	-1.53%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-8.83%	2.18%	-12.67%	2.27%	3.84%	-0.09%

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



注：图示日期为 2022 年 1 月 25 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		
尤家妤	本基金的基金经理	2025 年 6 月 26 日	-	5 年	香港大学理学硕士。2021 年 1 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。2025 年 6 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、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、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、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理。2025 年 10 月起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。2025 年 12 月起任华泰柏瑞中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证畜牧养殖产业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电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 8 月起任华泰柏瑞中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金。2026 年 9 月起任华泰柏瑞中证电池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遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度市场风险偏好显著回落，呈现一定的“高切低”特征，其中银行、煤炭、农林牧渔、石油石化、医药等低估值防御方向表现明显较好，中信一级行业涨跌幅分别为 16.82%、15.49%、14.64%、12.11%、10.14%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000、创业板指和科创 50 的涨跌幅分别为-12.49%、-17.67%、-17.15%、-27.80%和-30.70%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数（5.92%）大幅跑赢沪深 300 成长指数（-20.28%），中证 500 价值（-1.11%）亦大幅跑赢中证 500 成长（-21.02%）。

同期港股市场，恒生综合行业亦呈现结构分化，医疗保健业、能源业、原材料业分别上涨 26.60%、13.98%、13.70%，信息科技业、工业则分别下跌 4.34%、10.17%。恒生指数、恒生国企和恒生科技在三季度的涨跌幅分别为 7.57%、8.76%和-4.88%。

三季度，港股市场整体走强但科技板块内部分化较大，港股通科技指数（人民币中间价）季度收跌 0.93%，显著跑赢恒生科技。细分赛道中，医药生物（创新药为主）、互联网电商、消费电子及计算机设备等成份起到主要正面贡献，半导体、数字媒体、通信设备、乘用车等则构成主要拖累。复盘来看，三季度港股通科技行情的主线是创新药行情与 AI 硬件退潮的轮动：其一，创新药产业链迎来业绩与出海授权交易的双重兑现，医药生物成份贡献了最主要的正收益，验证了二季报中“创新药龙头低估反转”主线的判断；其二，全球 AI 硬件“卖事实”、半导体板块

深度调整，中资晶圆代工与算力芯片链随 A 股算力硬件板块同步下跌，成为最大拖累项；其三，互联网平台随中报盈利企稳与南向资金回流实现估值修复，电商、本地生活成份普遍录得正收益，消费电子龙头受益于新品周期与 AI 终端叙事亦有亮眼表现，但数字媒体成份明显回调；汽车成份内部分化加剧，头部整车稳健而部分新势力调整。资金面上，南向资金延续净流入、构成港股三季度走强的最大增量来源，但外资受美元高利率常态化约束增量有限，叠加 9 月解禁高峰压力，科技板块流动性维持紧平衡。

展望后市，港股通科技指数“车、药、网”的均衡构成在本轮极致轮动中展现出独特韧性，相对恒生科技的超额表现亦印证了这一配置价值。资金端，南向资金有望延续净流入，四季度解禁高峰回落后供给压力边际缓和，但美联储高利率常态化下外资弹性仍受制约，流动性或维持紧平衡；盈利端，互联网大厂 AI 资本开支能否转化为盈利兑现仍是核心变量，平台经济盈利已现企稳迹象，若广告与云业务改善持续，互联网成份的估值修复有望延续；产业端，创新药出海授权景气有望延续，而半导体与 AI 硬件链经过三季度深度回调后，估值与预期已消化至低位，“景气回归”主线的配置价值重新显现。总体而言，港股通科技指数当前估值仍处历史低位、安全边际较厚，“低估反转”与“景气回归”两条主线有望先后接力，重点跟踪大厂 AI 资本开支的盈利兑现度、创新药出海节奏、南向资金流向及美元流动性变化。

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 0.9117 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.93%，业绩比较基准收益率为-0.93%。

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	90,327,830.65	97.37
	其中：股票	90,327,830.65	97.37
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	2,399,387.96	2.59
8	其他资产	42,880.18	0.05
9	合计	92,770,098.79	100.00

注：1.上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

2.通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 90,327,830.65 元，占基金资产净值的比例为 97.55%。

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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	1,820,262.44	1.97
25 可选消费	29,328,013.99	31.67
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	15,911,037.90	17.18
40 金融	-	-
45 信息技术	29,205,067.38	31.54
50 通信服务	14,063,448.94	15.19
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	90,327,830.65	97.55

注：1.以上分类采用中证行业分类标准。

2.上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	00700	腾讯控股	24,600	9,101,483.89	9.83
2	03690	美团-W	144,630	8,901,790.51	9.61
3	01810	小米集团-W	402,800	8,727,274.58	9.43
4	09988	阿里巴巴-W	93,600	8,565,108.74	9.25
5	00981	中芯国际	122,500	6,377,738.69	6.89
6	01211	比亚迪股份	94,053	6,103,715.41	6.59
7	00992	联想集团	184,000	5,455,568.13	5.89
8	02269	药明生物	105,500	5,076,073.53	5.48
9	01801	信达生物	43,500	3,661,311.52	3.95
10	00175	吉利汽车	165,000	2,060,851.82	2.23

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	45769	诺辉健康	18,500	158.81	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

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	0.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	12,634.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,245.79
8	其他	-
9	合计	42,880.18

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	45769	诺辉健康	158.81	0.00	退市

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	117,059,805.00
报告期期间基金总申购份额	1,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	17,000,000.00
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	101,559,805.00

§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 10 月 27 日