# 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）
# 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII） |
| 基金主代码 | 019454 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 9 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 79,967,301.81 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。<br>1、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、成份股、备选成份股投资策略；4、存托凭证投资策略；5、衍生品投资策略；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 | 中证韩交所中韩半导体指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5% | | |
| 风险收益特征 | 本基金为华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体 ETF 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中证韩交所中韩半导体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 | 中国建设银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）A | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）C | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）I |
| 下属分级基金的交易代码 | 019454 | 019455 | 022681 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 29,822,408.84 份 | 48,303,769.31 份 | 1,841,123.66 份 |
| 境外资产托管人 | 英文名称：JPMorgan Chase Bank, National Association | | |
| | 中文名称：摩根大通银行有限公司 | | |

## 2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII） |
| 基金主代码 | 513310 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 11 月 2 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2022 年 12 月 22 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 | 中国建设银行股份有限公司 |

## 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 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。 |
| 投资策略 | 1、股票（含存托凭证）投资策略<br>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）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（含存托凭证）及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。<br>一般情形下，本基金将根据标的指数成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建投资组合，但由于交易成本、交易制度、个别成份股（含存托凭证）停牌、流动性不足或者投资受限等原因导致基金无法完成按照指数成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建投资组合时，基金管理人将对投资组合进行优化，采取包括成份股（含存托凭证）替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股（含存托凭证）进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。<br>在正常情况下，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 4%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。<br>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。<br>2、债券的投资策略<br>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。<br>3、衍生品投资策略<br>为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。<br>4、资产支持证券的投资策略<br>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。<br>5、融资及转融通证券出借业务<br>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 | 中证韩交所中韩半导体指数收益率 |
| 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。<br>本基金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） | | |
|---|---|---|---|
| | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）A | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）C | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）I |
| 1.本期已实现收益 | 10,483,061.03 | 16,470,334.32 | 322,619.48 |
| 2.本期利润 | -31,992,486.14 | -54,083,828.33 | -986,964.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -1.1337 | -1.2101 | -0.9613 |
| 4.期末基金资产净值 | 107,362,359.58 | 172,610,505.30 | 6,617,458.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 3.6001 | 3.5734 | 3.5943 |

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

华泰柏瑞中韩半导体 ETF 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 | -22.45% | 3.73% | -22.95% | 3.73% | 0.50% | 0.00% |
| 过去六个月 | 59.96% | 3.77% | 60.51% | 3.86% | -0.55% | -0.09% |
| 过去一年 | 92.44% | 3.32% | 93.41% | 3.43% | -0.97% | -0.11% |
| 过去三年 | 260.26% | 2.31% | 284.96% | 2.41% | -24.70% | -0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 260.01% | 2.30% | 287.41% | 2.40% | -27.40% | -0.10% |

华泰柏瑞中韩半导体 ETF 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 | -22.50% | 3.73% | -22.95% | 3.73% | 0.45% | 0.00% |
| 过去六个月 | 59.76% | 3.77% | 60.51% | 3.86% | -0.75% | -0.09% |
| 过去一年 | 91.94% | 3.32% | 93.41% | 3.43% | -1.47% | -0.11% |
| 过去三年 | 257.59% | 2.31% | 284.96% | 2.41% | -27.37% | -0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 257.34% | 2.30% | 287.41% | 2.40% | -30.07% | -0.10% |

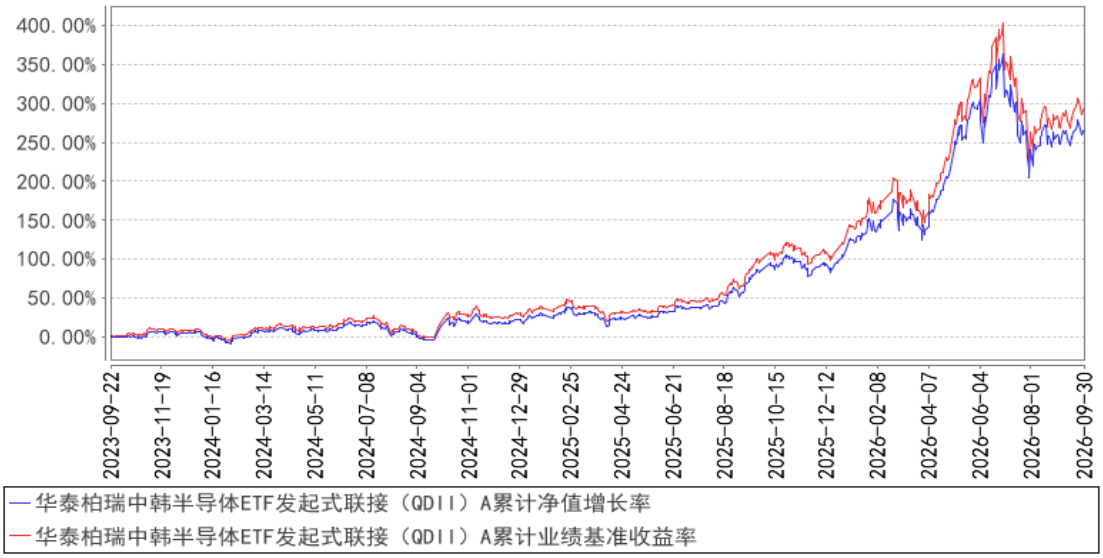
华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）I

| 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 | -22.46% | 3.73% | -22.95% | 3.73% | 0.49% | 0.00% |
| 过去六个月 | 59.89% | 3.77% | 60.51% | 3.86% | -0.62% | -0.09% |
| 过去一年 | 92.25% | 3.32% | 93.41% | 3.43% | -1.16% | -0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 206.65% | 2.65% | 210.18% | 2.74% | -3.53% | -0.09% |

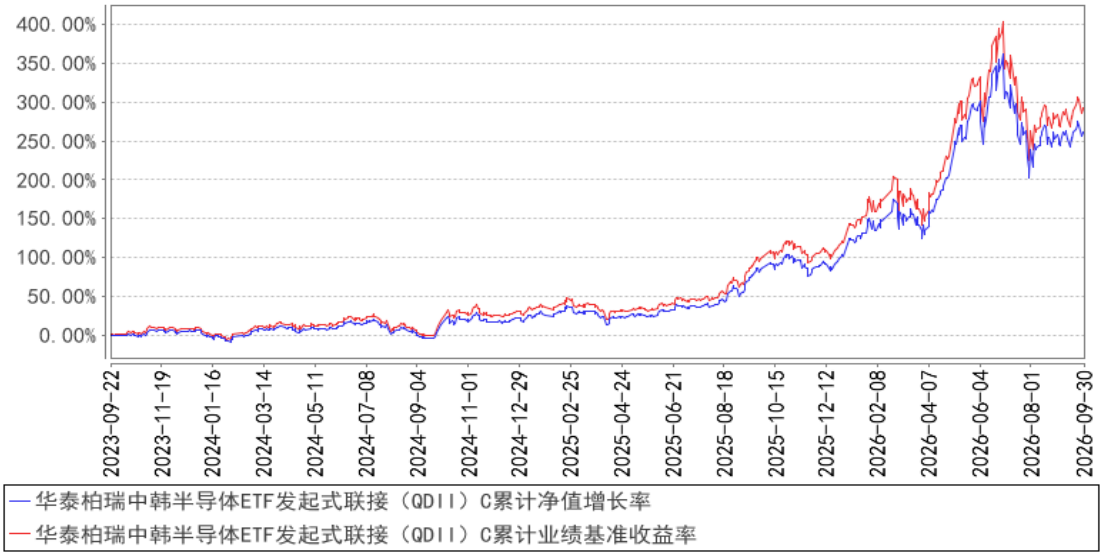
注：I 类份额业绩计算期间为 2024 年 11 月 26 日至 2026 年 9 月 30 日。

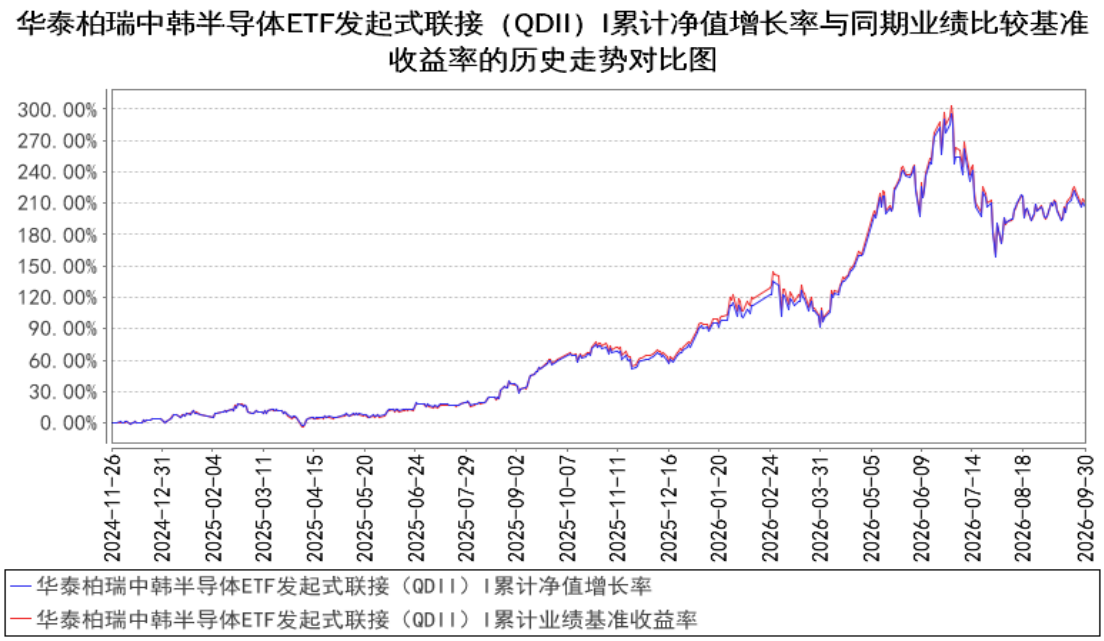
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**华泰柏瑞中韩半导体ETF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**




**华泰柏瑞中韩半导体ETF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 9 月 22 日至 2026 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2023 年 9 月 22 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 9 月 22 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中韩半导体 ETF 发起式联接(QDII)A 的基金份额净值为 3.6001 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.45%，同期业绩比较基准收益率为-22.95%，截至本报告期末华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）C 的基金份额净值为 3.5734 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.50%，同期业绩比较基准收益率为-22.95%，截至本报告期末华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）I 的基金份额净值为 3.5943 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.46%，同期业绩比较基准收益率为-22.95%。

2026 年第三季度，中韩半导体指数在“HBM 存储超级周期兑现”与“美伊冲突升级、美联储

转鹰、韩国杠杆资金踩踏”的夹击中，走出深 V 回撤行情。7 月美以伊冲突升级、霍尔木兹风险推高美债收益率，韩国存储双雄遭杠杆平仓，KOSPI 三个月回撤近 20%、全球 AI 上游杠杆交易瓦解；8 月油价回落、加息预期阶段性出清，DRAM 与 HBM 涨价兑现；9 月美联储再加息、中东局势反复，市场从“看利润规模”转向“看 2027—2028 年周期持续性”，呈现“产业景气极强、筹码与利率极脆”的特征。

展望第四季度，中韩半导体 ETF 表现或取决于“HBM/DRAM 涨价持续性”与“美伊冲突会否进一步升级”的博弈。积极因素在于 AI 服务器长约锁产能、HBM4 放量、中韩“韩国存储+A 股设备/封测”互补链仍处上行段，三季报韩国科技巨头创纪录利润验证基本面；若美伊谈判破裂、霍尔木兹或曼德海峡受限致油价再冲 100 美元上方，通胀粘性将强化美联储紧缩、韩元与全球风险偏好承压，高 Beta 存储权重易再遭外资流出与杠杆去化。整体看中韩半导体是 AI 硬件周期的高弹性跨境工具，但需严控“存储周期见顶论+强美元/高利率+中东升级”三段式回撤风险。

### 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（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 | 266,119,400.10 | 92.51 |
| 3 | 固定收益投资 | 201,731.40 | 0.07 |
| | 其中：债券 | 201,731.40 | 0.07 |
| | 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 | 20,990,663.87 | 7.30 |
| 8 | 其他资产 | 341,513.33 | 0.12 |
| 9 | 合计 | 287,653,308.70 | 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

| 债券信用等级 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 未评级 | 201,731.40 | 0.07 |

注：未评级的债券包括国债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

## 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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 019827 | 26 国债 01 | 2,000 | 201,731.40 | 0.07 |

## 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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 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 | 华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体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 | 266,119,400.10 | 92.86 |

## 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 | 23,389.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 318,124.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 341,513.33 |

### 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 | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）A | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）C | 华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接（QDII）I |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 30,632,195.63 | 51,268,277.65 | 979,173.04 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,798,051.80 | 9,618,787.82 | 1,112,234.55 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 4,607,838.59 | 12,583,296.16 | 250,283.93 |
| 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 | 29,822,408.84 | 48,303,769.31 | 1,841,123.66 |

# §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 | 10,000,416.67 | 12.51 | 10,000,416.67 | 12.51 | 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 | 10,000,416.67 | 12.51 | 10,000,416.67 | 12.51 | - |

# §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**