华泰柏瑞上证 180 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	华泰柏瑞上证 180ETF
场内简称	180 指数（扩位证券简称：上证 180ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	530300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 12 月 30 日
报告期末基金份额总额	33,643,000.00 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 180 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	中国农业银行股份有限公司

§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	1,560,942.62
2.本期利润	-2,434,051.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0686
4.期末基金资产净值	40,390,854.96
5.期末基金份额净值	1.2006

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。

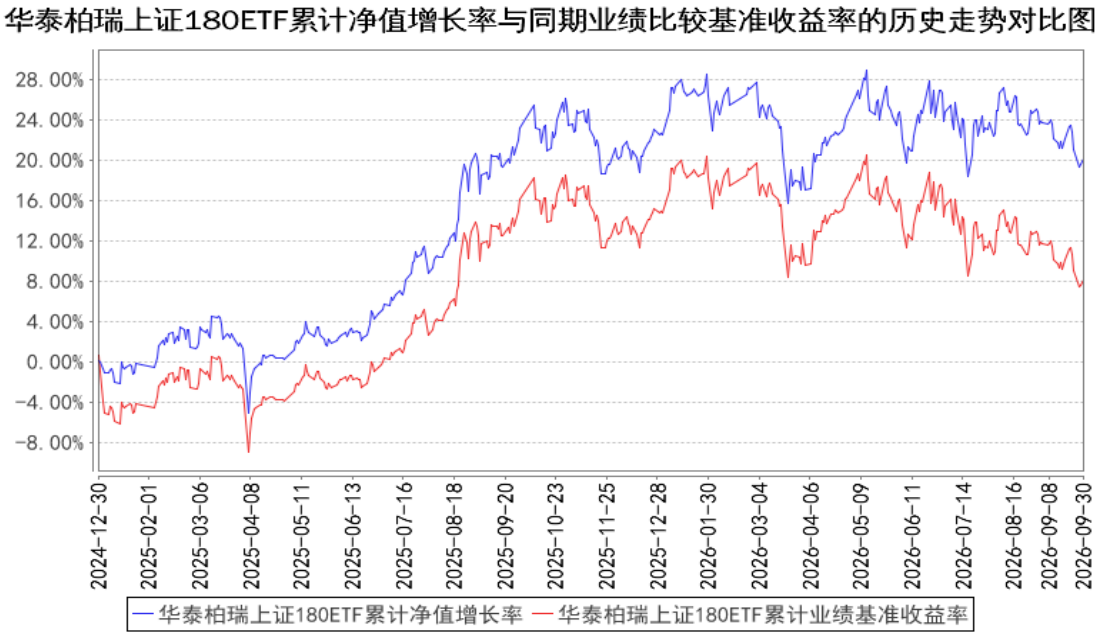
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-5.36%	1.07%	-7.99%	1.10%	2.63%	-0.03%
过去六个月	2.57%	1.10%	-1.39%	1.13%	3.96%	-0.03%
过去一年	-2.54%	1.03%	-6.86%	1.05%	4.32%	-0.02%
自基金合同生效起至今	20.06%	0.96%	8.11%	1.00%	11.95%	-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



注：图示日期为 2024 年 12 月 30 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		
柳叶青	本基金的基金经理	2026 年 2 月 25 日	-	7 年	理学硕士。2018 年 12 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。2026 年 2 月起任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、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、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、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 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、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。2026 年 7 月起任华泰柏瑞创业板新能源交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证全指红利质量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

回顾 2026 年三季度，A 股市场高位回落，上证指数、沪深 300 和创业板指分别下跌 6.16%、12.49%和 27.80%，上证 180 指数下跌 7.99%，表现相对抗跌。市场在前期持续上涨、获利压力累积后出现阶段性调整，前期涨幅较大的成长方向波动相对较大，防御属性较强的公用事业等板块表现相对稳定，市场风格阶段性偏向低估值、高股息方向。上证 180 指数覆盖金融、消费、工业和科技等沪市代表性行业，成份股多为经营基础较为稳健的行业龙头，估值与分红具备优势，在调整阶段体现出较强的低波属性。

展望四季度，稳增长、扩内需政策有望继续发力，中长期资金入市持续推进，为大盘蓝筹提供较为友好的制度环境。经过三季度的调整，指数估值压力已有所释放，成份股的股息率和股东回报价值进一步凸显，配置价值有所提升；随着 10 月上市公司三季报陆续披露，龙头企业稳健的盈利能力和现金流优势有望得到进一步验证。整体来看，上证 180 指数成份龙头兼具经营稳定性、低估值和高股息属性。若国内需求及盈利预期边际改善，该指数在震荡环境中的中期配置价值有望显现。

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 1.2006 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.36%，业绩比较基准收益率为-7.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

已于 6 月 22 日将《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于五千万元情况的报告》上报上海证监局。

§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	38,973,841.50	96.27
	其中：股票	38,973,841.50	96.27
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	1,478,259.80	3.65
8	其他资产	30,245.79	0.07
9	合计	40,482,347.09	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	3,474,109.00	8.60
C	制造业	18,414,825.62	45.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,642,028.00	4.07
E	建筑业	1,106,627.00	2.74
F	批发和零售业	20,045.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	2,145,582.00	5.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,997,473.31	7.42
J	金融业	6,867,168.64	17.00
K	房地产业	387,382.93	0.96
L	租赁和商务服务业	345,604.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	1,572,996.00	3.89
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	38,973,841.50	96.49

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	603259	药明康德	9,400	1,572,996.00	3.89
2	600519	贵州茅台	1,200	1,510,344.00	3.74
3	601899	紫金矿业	45,900	1,367,361.00	3.39
4	688256	寒武纪	927	935,352.27	2.32

5	601318	中国平安	16,400	873,956.00	2.16
6	600900	长江电力	28,700	819,098.00	2.03
7	600276	恒瑞医药	16,996	802,211.20	1.99
8	600036	招商银行	19,000	783,940.00	1.94
9	600150	中国船舶	16,966	663,370.60	1.64
10	603986	兆易创新	1,800	637,020.00	1.58

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，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	30,245.79
8	其他	-
9	合计	30,245.79

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

注：截至本报告期末，本基金未持有积极投资的股票。

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	37,643,000.00
报告期期间基金总申购份额	2,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	6,000,000.00
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	33,643,000.00

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260701-20260930;	10,003,100.00	4,648,900.00	4,263,700.00	10,388,300.00	30.88
联接基金	1	20260701-20260930;	8,744,800.00	1,270,000.00	2,415,000.00	7,599,800.00	22.59

产品特有风险
本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

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