

华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十四日

§ 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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华安上证科创板芯片 ETF |
| 场内简称 | 芯片科创（扩位简称：科创芯片 ETF 基金） |
| 基金主代码 | 588290 |
| 交易代码 | 588290 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 9 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,226,397,000.00 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最小化。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取组合复制法，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地调整。 |

| | |
|--------|--|
| | <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股进行替代。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金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，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</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，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 上证科创板芯片指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 华泰证券股份有限公司 |

§ 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 |
|-----------------|----------------------------------|
| | (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日) |
| 1. 本期已实现收益 | -67,307,309.16 |
| 2. 本期利润 | -177,562,199.59 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1547 |

| | |
|-------------|----------------------|
| 4. 期末基金资产净值 | 1, 315, 883, 681. 93 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 0730 |

注：1、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、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 本报告期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 | -11.88% | 1.62% | -11.90% | 1.64% | 0.02% | -0.02% |
| 过去六个月 | -17.29% | 2.02% | -17.21% | 2.03% | -0.08% | -0.01% |
| 过去一年 | 7.30% | 1.87% | 9.39% | 2.07% | -2.09% | -0.20% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 7.30% | 1.87% | 6.48% | 2.07% | 0.82% | -0.20% |

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

华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022 年 9 月 30 日至 2023 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 | | |
| 刘璇子 | 本基金的基金经理 | 2022-09-30 | - | 9年 | 硕士研究生，9年基金行业从业经验。2014年7月应届毕业生加入华安基金，曾任指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2020年11月起，担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理（2023年2月起，转型为华安上证50交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金）。2021年1月起，同时担任华安创业板50指数型证券投资基金的基金经理。2021年7月起，同时担任华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起,同时担任华安 CES 半导体芯片行业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2022 年 7 月,同时担任华安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起,同时担任华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安中证内地新能源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。2022 年 4 月起,同时担任华安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。2022 年 7 月起,同时担任华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起,同时担任华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月起,同时担任华安中证上海环交所碳中和指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起,同时担任华安中证基建指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起,同时担任华安上证科创板芯片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。</p> |
|--|--|--|--|--|

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义

进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的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% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，科创芯片指数延续震荡调整趋势，区间跌幅 11.9%。上半年行业仍处于下行周期，除了设备等环节外其他领域业绩表现一般，带动股价调整，贸易管制措施的博弈下国产替代机会凸显。华为 Mate60 Pro 的发布带动华为产业链表现，我国半导体产业国产进程有望加速。由于宏观经济放缓、消费需求疲软，半导体行业仍在库存消化过程中，但节奏上已临近周期底部，存储价格上调已逐渐反映行业筑底预期。

本基金跟踪的科创芯片指数，从科创板上市公司中选取业务涉及半导体材料和设备、芯片设计、芯片制造、芯片封装和测试相关的证券作为指数样本，以反映科创板代表性芯片产业上市公司证券的整体表现。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，并利用量化工具进行精细化管理，从而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.0730 元，本报告期份额净值增长率为 -11.88%，同期业绩比较基准增长率为 -11.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我们看好芯片板块第四季度的投资机会。行业周期拐点基本确立，顺周期板块率先有所表现。随着人工智能、AR/VR、物联网崛起以及下游消费电子、汽车电子的强劲需求，全球半导体需求有望得到复苏。另一方面，对华科技投资的限制趋于系统化，国产替代和自主可控依然是国产芯片发展的主要支撑，国内芯片产业在成熟制程基础上，围绕卡脖子环节也有望寻求突破与进展。此外，AI 产业链经过一段时间调整后，配置价值提升，相关行业的机会也值得关注。

本基金跟踪的科创芯片指数囊括了科创板上市的 50 只芯片产业龙头企业，是科创板硬核科技的代表，聚焦芯片产业高精尖环节，具有“小而美”的特点，科创属性强，是投资国内芯片产业链龙头公司的优质工具，当前配置价值突出。

作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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 | 1,307,806,949.39 | 99.31 |
| | 其中：股票 | 1,307,806,949.39 | 99.31 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,995,669.69 | 0.68 |
| 7 | 其他各项资产 | 96,008.58 | 0.01 |
| 8 | 合计 | 1,316,898,627.66 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2 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 | 1,084,929,007.15 | 82.45 |
| 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 | 222,877,942.24 | 16.94 |
| 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 | 1,307,806,949.39 | 99.39 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告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 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 | 688012 | 中微公司 | 931,866 | 140,292,426.30 | 10.66 |
| 2 | 688981 | 中芯国际 | 2,447,918 | 125,211,005.70 | 9.52 |
| 3 | 688008 | 澜起科技 | 1,984,107 | 98,610,117.90 | 7.49 |
| 4 | 688396 | 华润微 | 1,317,114 | 71,242,696.26 | 5.41 |
| 5 | 688126 | 沪硅产业 | 3,406,818 | 67,352,791.86 | 5.12 |
| 6 | 688256 | 寒武纪 | 519,749 | 64,422,888.55 | 4.90 |
| 7 | 688099 | 晶晨股份 | 726,733 | 45,820,515.65 | 3.48 |
| 8 | 688002 | 睿创微纳 | 892,631 | 42,578,498.70 | 3.24 |
| 9 | 688521 | 芯原股份 | 622,903 | 37,343,034.85 | 2.84 |
| 10 | 688037 | 芯源微 | 274,440 | 36,357,811.20 | 2.76 |

5.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

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

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

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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 52,614.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 9,610.00 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 33,784.38 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 96,008.58 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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 期末指数投资前十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 | 688012 | 中微公司 | 13,925,875.00 | 1.06 | 转融通证券 出借 |
| 2 | 688981 | 中芯国际 | 13,621,245.00 | 1.04 | 转融通证券 出借 |
| 3 | 688008 | 澜起科技 | 9,447,970.00 | 0.72 | 转融通证券 出借 |
| 4 | 688396 | 华润微 | 6,864,021.00 | 0.52 | 转融通证券 出借 |
| 5 | 688126 | 沪硅产业 | 6,510,261.00 | 0.49 | 转融通证券 出借 |
| 6 | 688256 | 寒武纪 | 6,309,055.00 | 0.48 | 转融通证券 出借 |
| 7 | 688099 | 晶晨股份 | 4,438,720.00 | 0.34 | 转融通证券 出借 |
| 8 | 688002 | 睿创微纳 | 4,044,960.00 | 0.31 | 转融通证券 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|---------|
| | | | | | 出借 |
| 9 | 688521 | 芯原股份 | 3,656,950.00 | 0.28 | 转融通证券出借 |
| 10 | 688037 | 芯源微 | 3,590,208.00 | 0.27 | 转融通证券出借 |

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|------------------|
| 本报告期初基金份额总额 | 961,397,000.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 767,500,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 502,500,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 1,226,397,000.00 |

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 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

无。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.huaan.com.cn>。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇二三年十月二十四日