
华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证
券投资基金
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 19 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创业板科技 ETF
场内简称	创业板科技 ETF
基金主代码	159773
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 23 日
报告期末基金份额总额	83,503,120.00 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。
投资策略	1、股票的投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；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；6、存托凭证的投资策略；
业绩比较基准	创业板科技指数收益率。
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	招商银行股份有限公司

§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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-1,431,618.43
2. 本期利润	-243,707.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0029
4. 期末基金资产净值	55,303,817.88
5. 期末基金份额净值	0.6623

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。

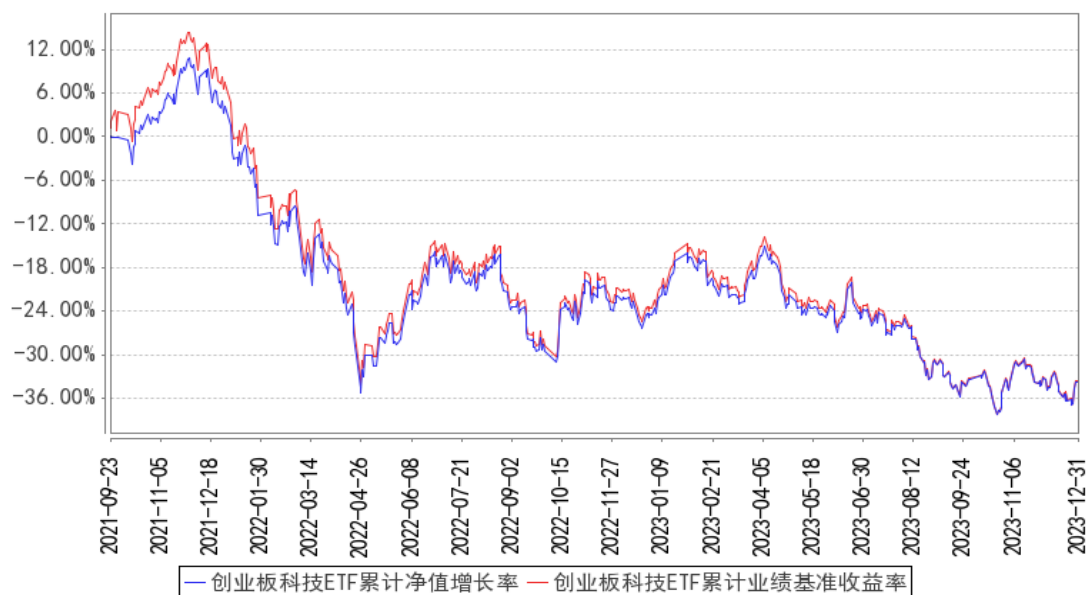
3.2 基金净值表现

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	-0.57%	1.32%	-0.47%	1.36%	-0.10%	-0.04%
过去六个月	-13.05%	1.23%	-13.49%	1.26%	0.44%	-0.03%
过去一年	-12.37%	1.18%	-13.08%	1.21%	0.71%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-33.77%	1.42%	-33.54%	1.47%	-0.23%	-0.05%

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

创业板科技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：图示日期为 2021 年 9 月 23 日至 2023 年 12 月 31 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		
谭弘翔	指数投资部副总监、本基金的基金经理	2021年9月23日	-	7年	美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融工程专业硕士。曾任上海证券交易所产品创新中心基金业务部经理。2020年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部副总监。2021年3月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年4月起任华泰柏瑞中证科技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。2021年6月起任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的基金经理。2021年9月起任华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年11月起任华泰柏瑞中证沪港深品牌消费50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月起任华泰柏瑞中证稀土产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。2022 年 1 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的基金经理。2022 年 7 月起任华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 8 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务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合规守信情况的说明

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，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内的公平交易模块，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 10 次，都为指数投资组合因跟踪指

数需要而发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年四季度市场以结构性机会为主，其中综合、煤炭、电子、农林牧渔的表现相对较好，涨跌幅分别为 5.69%、4.47%、3.95%和 1.76%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-7.00%、-4.60%、-3.15%和-5.62%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-7.89%和-9.67%，中证 500 价值（-4.55%）略微跑输中证 500 成长（-4.33%）。

四季度，A 股科技板块总体震荡走低，创业板科技指数累计下跌 0.47%，受益于医药企稳与消费电子复苏，表现相较沪深主要宽基指数更具韧性，权重行业中，医药、电子涨幅居前，新能源、计算机、通信跌幅居前。

四季度，科技板块走势整体跟随大市，但产业层面主题性亮点频出，其中不乏趋势性利好。10 月，国内波浪式复苏与美债利率飙升成为压制风险偏好的主要因素，资金一方面向更具基本面支撑的方向求索，TMT 中更靠向上游、景气反转逐渐验证的电子得到广泛关注，另一方面延续挖掘华为自主可控突破受益的细分方向，如硬件端的 5.5G、软件端的鸿蒙等，同时美股礼来、诺和诺德屡创新高，映射 A 股创新药行情并推动医药板块企稳。11 月，Optimus 步测超预期带动机器人板块有所表现，Pika 爆火也推动短剧等 AI 应用端活跃。12 月，Gemini 发布令市场重新聚焦 AI 中游模型，月底消费电子因 AVP 上市预期逆势走强，游戏则受监管收紧预期的冲击回落。

与整体偏向积极的产业层面不同，四季度资金层面总体消极，使市场逻辑大于基本面逻辑，带来较大抛压。即使 10 月市场快速释放风险之后、11 月美联储首次调整政策立场，降息预期提前一度令科技股反弹，但北交所行情虹吸了部分原本在科创板、创业板提供流动性的资金，进而削弱了半导体、新能源等沪深科技板块的弹性。此外，市场亏钱效应引发赎回潮，亦导致机构持仓占比较高的风光锂、CPO 等阴跌。

展望后市，创业板科技指数估值仍处于上市以来的极低分位（3.61%），存在较大的修复空间。目前，1）2024 年国内经济有望进一步正常化，对应企业盈利随库存上行而逐渐修复，2）财政呈现出更为积极的特征，稳增长政策仍有望加码，3）美联储降息方向大致确定，人民币汇率压力缓和，今年制约市场的几个关键变量都已出现好转。尤其注意到，中央经济工作会议已将科技创新设置为 2024 年一号任务，预期出台的配套性产业政策将进一步夯实科技主线，在基本面释放和资本催熟的双重作用下，A 股科技板块有望扭转过去两年的颓势，去向上争取超越大盘基准的表现。

细分行业而言，TMT 在前期调整消化后，交易拥挤度有所缓解，当前配置性价比再次回到高位，在产业趋势不变的情况下或延续上行。医药板块经过两年有余的大幅调整之后，当前估值、

机构持仓、情绪等均处于历史低位区间，在消费升级、创新创收的长期逻辑下，近期板块已有企稳趋势。此外，新能源板块的供需拐点亦逐渐明确，一方面全球需求大概率在 GDA 的顶层引导下进一步加速，另一方面供给侧出清现象亦有增多，当前行业集中度已经开始提升，格局提前进入优化阶段，产能增长有望大幅放缓；当下板块估值已处于历史极低水平，若后续产能出清推动产业链利润分配回归合理，板块反转动力或进一步夯实。考虑到权重较高的医药、新能源等赛道的悲观预期已较充分释放，创业板科技指数下行空间可能有限。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.033%，期间日跟踪误差为 0.047%，较好地实现了本基金的投资目标。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

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 0.6623 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.57%，业绩比较基准收益率为-0.47%。

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	53,837,350.34	97.07
	其中：股票	53,837,350.34	97.07
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	1,618,690.48	2.92
8	其他资产	7,171.16	0.01
9	合计	55,463,211.98	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	-	-
C	制造业	41,592,892.63	75.21
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	10,516,611.31	19.02
J	金融业	1,505,952.00	2.72
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	162,750.00	0.29
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	53,778,205.94	97.24

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

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	50,689.32	0.09
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	3,533.11	0.01
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	3,167.28	0.01

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	1,754.69	0.00
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	59,144.40	0.11

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	300760	迈瑞医疗	18,986	5,517,331.60	9.98
2	300750	宁德时代	32,680	5,335,336.80	9.65
3	300274	阳光电源	48,100	4,213,079.00	7.62
4	300122	智飞生物	54,050	3,302,995.50	5.97
5	300308	中际旭创	27,500	3,105,025.00	5.61
6	300014	亿纬锂能	60,200	2,540,440.00	4.59
7	300142	沃森生物	78,000	1,833,780.00	3.32
8	300033	同花顺	9,600	1,505,952.00	2.72
9	300418	昆仑万维	38,400	1,436,160.00	2.60
10	300496	中科创达	16,700	1,337,002.00	2.42

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	301487	盟固利	319	13,066.24	0.02
2	301348	蓝箭电子	104	4,635.28	0.01
3	301510	固高科技	114	3,991.14	0.01
4	301381	赛维时代	119	3,533.11	0.01
5	301488	豪恩汽电	49	3,385.41	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规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	260.97
2	应收证券清算款	6,910.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,171.16

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	301487	盟固利	13,066.24	0.02	新股锁定期内
2	301348	蓝箭电子	4,635.28	0.01	新股锁定期内
3	301510	固高科技	3,991.14	0.01	新股锁定期内
4	301381	赛维时代	3,533.11	0.01	新股锁定期内
5	301488	豪恩汽电	3,385.41	0.01	新股锁定期内

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	81,103,120.00
报告期期间基金总申购份额	10,400,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	8,000,000.00
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	83,503,120.00

§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：本基金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

2024 年 1 月 22 日