华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金
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：中泰证券股份有限公司

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。

基金托管人中泰证券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	华泰柏瑞中证全指指数增强	
基金主代码	026690	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 14 日	
报告期末基金份额总额	92,529,820.36 份	
投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。	
投资策略	1、股票投资策略 2、债券投资策略 3、资产支持证券投资策略 4、衍生品投资策略 5、存托凭证投资策略 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略	
业绩比较基准	中证全指指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中泰证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	华泰柏瑞中证全指指数增强 C
下属分级基金的交易代码	026690	026691
报告期末下属分级基金的份额总额	53,570,201.24 份	38,959,619.12 份

§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）	
	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	华泰柏瑞中证全指指数增强 C
1.本期已实现收益	-5,305,907.24	-3,588,014.81
2.本期利润	-2,338,127.48	-1,519,686.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0403	-0.0379
4.期末基金资产净值	49,057,244.24	35,642,988.84
5.期末基金份额净值	0.9158	0.9149

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

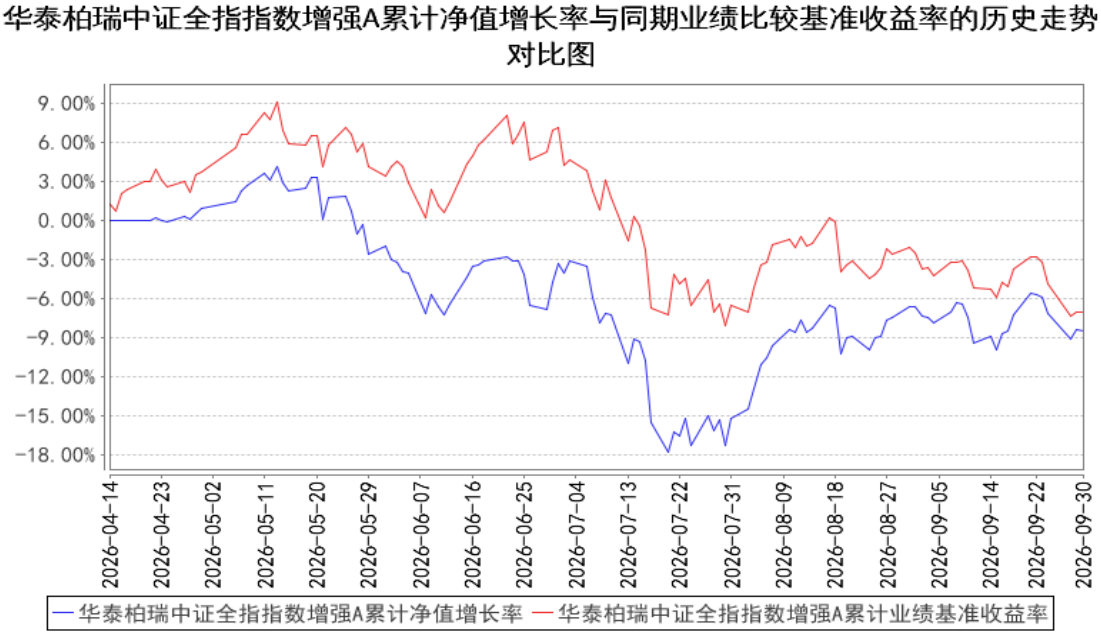
华泰柏瑞中证全指指数增强 A

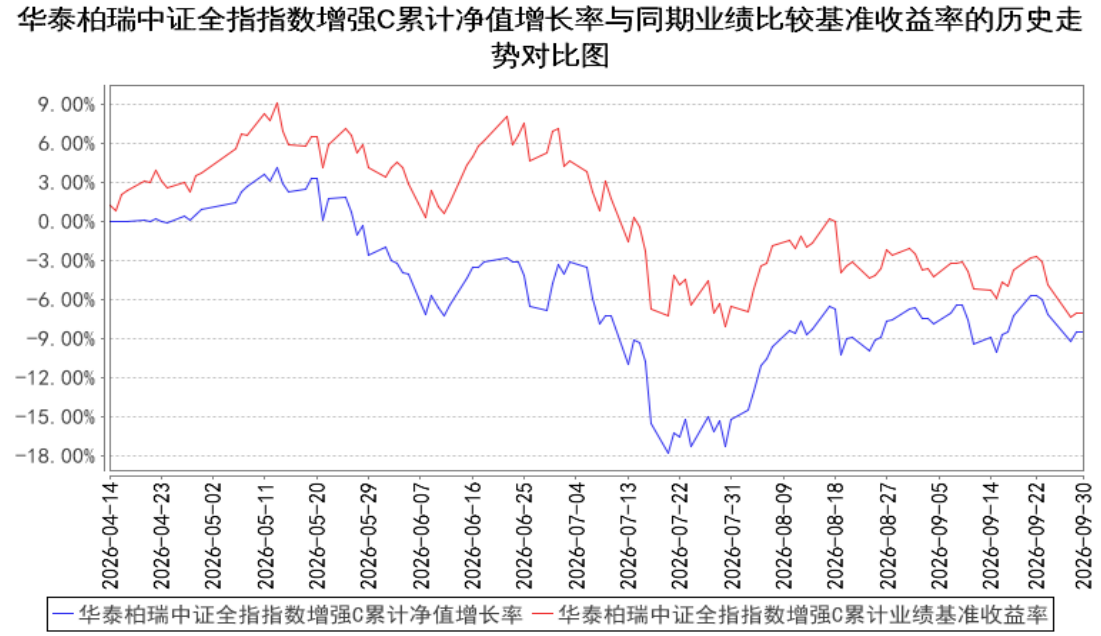
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-3.84%	1.63%	-13.11%	1.51%	9.27%	0.12%
自基金合同生效起至今	-8.42%	1.42%	-7.04%	1.40%	-1.38%	0.02%

华泰柏瑞中证全指指数增强 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	-3.90%	1.63%	-13.11%	1.51%	9.21%	0.12%
自基金合同生效起至今	-8.51%	1.42%	-7.04%	1.40%	-1.47%	0.02%

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：1、A 类图示日期为 2026 年 4 月 14 日至 2026 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2026 年 4 月 14 日至 2026 年 9 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§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		
孔令烨	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2026 年 4 月 14 日	-	11 年	英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份公司高级分析师。2017 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022 年 8 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月至 2026 年 9 月任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月至 2026 年 8 月任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月至 2026 年 9 月任华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 9 月起任华泰柏瑞恒荣债券型证券投资基金的基金经理。
雷文渊	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2026 年 4 月 14 日	-	8 年	复旦大学数学专业本科、金融专业硕士。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2022 年 8 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型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

2026 年三季度，A 股延续震荡调整趋势。季初，前期拥挤度较高的科技板块，出现了一波剧烈回调，继而影响多数指数跌至年内低点。八月，市场进入休整与企稳阶段，但成交动能依然偏弱。九月，受到海外加息预期影响，市场低位运行。季末，节前避险情绪上升，市场再度回调。整体看，本季度市场风格再平衡特征突出，以煤炭、石油石化等资源品，以及银行、公用事业等高股息类资产表现较为活跃，医药生物、农林牧渔等低位板块也有所修复，而上半年涨幅较大、估值弹性较高的科技成长方向出现明显回吐。

本报告期，代表大市值公司的沪深 300 下跌 12.49%；代表中小市值公司的中证 500、中证 1000 和中证 2000 指数同期跌幅分别为 17.67%、17.15%和 11.08%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数上涨 11.16%。横向比较来看，估值处于历史低位、分红较为稳定、资源品占比较高的高股息类上市公司，在本季度大幅跑赢大市值类和中小市值类上市公司，市场风格由上半年的成长进攻明显转向价值防御。

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，结合对市场的研判，采取比较

稳健的投资策略，严格控制风险暴露。

展望未来几个季度，A 股市场面临的内外部环境复杂多变，但积极因素正在逐步累积。2026 年下半年，美伊冲突战火重燃，持续威胁全球能源供应链。得益于能源安全体系构建，以及新能源转型的成果，国内经济韧性再一次得到验证。国内财政和货币政策有望持续发力，提振内需政策可能延续，人工智能等产业方向的引导可能加强。海外，美伊冲突和国际贸易摩擦给全球经济发展带来不确定性，但中长期我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力。2026 年是“十五五”规划开局之年，从能源到 AI 基础设施等领域的投资可能靠前发力，有望进一步增强市场对于中国经济的信心。在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的运行区间。

虽然贸易冲突、地缘政治等风险因素可能将长期存在，但我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力，相信新质生产力的长期优势。在不出现极端情况的前提下，我们对未来几个季度的 A 股股票市场持谨慎乐观的态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，当前市场呈现风格轮动加快、板块分化加剧的特征。在此环境下，兼具主题热度与基本面优秀的股票可能更容易受到资金的青睐，技术面因子亦可借助力争捕捉资金流向特征，努力获取超额收益。与此同时，基本面因子持续筛选出估值合理、业绩优异且具备良好成长性的标的，为模型提供了一定支撑。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，经济基本面向好。我们在坚持控制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证全指指数增强 A 的基金份额净值为 0.9158 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.84%，同期业绩比较基准收益率为-13.11%，截至本报告期末华泰柏瑞中证全指指数增强 C 的基金份额净值为 0.9149 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.90%，同期业绩比较基准收益率为-13.11%。

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	78,529,167.15	92.49
	其中：股票	78,529,167.15	92.49
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	6,369,172.84	7.50
8	其他资产	5,973.36	0.01
9	合计	84,904,313.35	100.00

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	496,404.00	0.59
B	采矿业	3,118,921.00	3.68
C	制造业	48,951,298.16	57.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,595,079.00	1.88
E	建筑业	1,195,837.00	1.41
F	批发和零售业	3,170,175.00	3.74
G	交通运输、仓储和邮政业	3,027,583.00	3.57
H	住宿和餐饮业	25,270.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,301,133.18	8.62
J	金融业	2,560,369.20	3.02
K	房地产业	1,544,534.00	1.82
L	租赁和商务服务业	904,800.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	1,391,850.00	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	1,241,926.00	1.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	395,315.00	0.47
Q	卫生和社会工作	430,844.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	657,289.00	0.78
S	综合	11,256.00	0.01

	合计	78,019,883.54	92.11

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	364,606.23	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,557.38	0.04
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	109,120.00	0.13
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	509,283.61	0.60

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	000678	襄阳轴承	32,600	420,214.00	0.50
2	300521	爱司凯	14,900	362,815.00	0.43
3	002003	伟星股份	31,800	359,658.00	0.42
4	300832	新产业	6,800	342,516.00	0.40
5	002430	杭氧股份	13,100	328,024.00	0.39
6	000558	天府文旅	92,300	324,896.00	0.38

7	600299	安迪苏	39,000	320,190.00	0.38
8	300168	万达信息	62,200	301,048.00	0.36
9	300536	农尚环境	36,700	296,169.00	0.35
10	300106	西部牧业	27,700	295,282.00	0.35

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	603007	顺景科技	28,600	127,842.00	0.15
2	002253	川大智胜	12,400	109,120.00	0.13
3	688759	必贝特	4,800	104,112.00	0.12
4	300159	新研股份	23,800	64,736.00	0.08
5	001248	华润新能源	3,807	35,557.38	0.04

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,973.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,973.36

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	001248	华润新能源	35,557.38	0.04	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

项目	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	华泰柏瑞中证全指指数增强 C
报告期期初基金份额总额	64,540,254.44	45,727,272.21
报告期期间基金总申购份额	2,589,609.31	1,692,108.27
减:报告期期间基金总赎回份额	13,559,662.51	8,459,761.36
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	53,570,201.24	38,959,619.12

§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