

华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券
投资基金
2025 年年度报告

2025 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

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2026 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	53

8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
8.6 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	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	76
8.8 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贵金属投资明细	76
8.9 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	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	76
§ 9 基金份额持有人信息	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2 期末上市基金前十名持有人	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	79
§ 10 开放式基金份额变动	79
§ 11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	83
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	84
12.1 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	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 A 股 ETF
场内简称	A 股 ETF (扩位证券简称: A 股 ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	563330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 10 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,160,621.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 11 月 7 日

2.2 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。
投资策略	<p>1、股票(含存托凭证)的投资策略</p> <p>本基金主要采用抽样复制法跟踪标的指数。抽样复制依托量化投资平台, 利用长期稳定的风险模型, 以“跟踪误差最小化”为优化目标创建组合, 从而实现对标的指数的紧密跟踪。在正常市场情况下, 本基金力争做到日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%, 年化跟踪误差不超过 2%。如因标的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。</p> <p>本基金将根据投资目标, 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。</p> <p>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</p>
业绩比较基准	中证 A 股指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金, 其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金属于股票型基金中的指数型基金, 采用抽样复制策略, 跟踪中证 A 股指数, 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。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	张姗
		400-61-95555

电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-0001	400-61-95555
传真	021-38601799	0755-83195201
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日） - 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	19,144,204.60	-464,605.28	4,895,372.86
本期利润	19,242,869.49	10,702,186.28	682,103.66
加权平均基金份额本期利润	0.7072	0.0739	0.0025
本期加权平均净值利润率	19.59%	6.71%	0.26%
本期基金份额净值增长率	28.21%	11.47%	-2.78%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分	25,296,115.09	6,503,088.43	-8,338,676.66

配利润			
期末可供分配基金份额利润	0.8983	0.1686	-0.0278
期末基金资产净值	117,515,475.82	125,503,475.55	291,082,323.34
期末基金份额净值	4.1730	3.2547	0.9722
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	38.95%	8.37%	-2.78%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

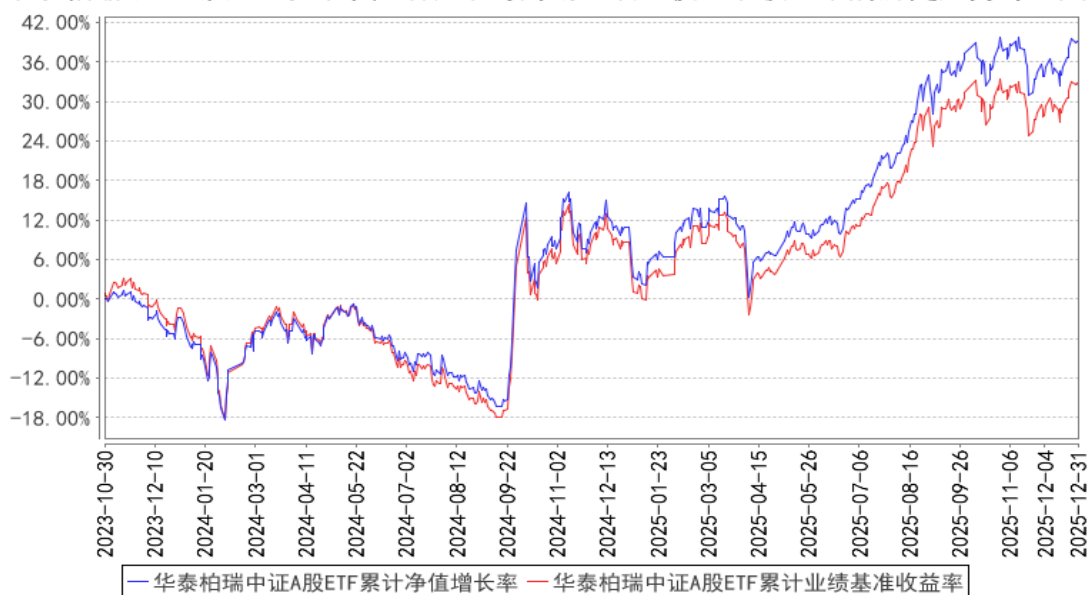
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.17%	1.00%	0.79%	1.01%	0.38%	-0.01%
过去六个月	21.24%	0.96%	19.50%	0.96%	1.74%	0.00%
过去一年	28.21%	1.11%	24.75%	1.13%	3.46%	-0.02%
自基金合同生效起至今	38.95%	1.32%	32.48%	1.35%	6.47%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

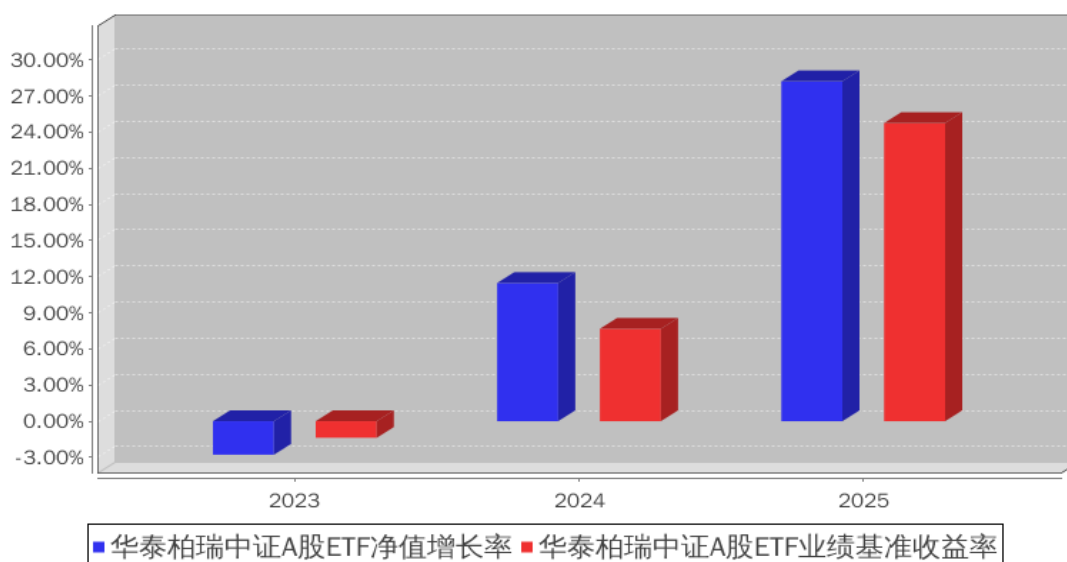
华泰柏瑞中证A股ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2023 年 10 月 30 日至 2025 年 12 月 31 日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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A股ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2023 年 10 月 30 日起生效，2023 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、Heron View Partners LLC 和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2025 年 12 月 31 日，公司旗下管理 190 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	-	7 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 10 月 30 日	-	24 年	副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、基金经理助理、指数投资部副总监、总监。现任副总经理、指数投资部总监、基金经理。兼任华泰柏瑞资产管理（国际）有限公司就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、证券交易负责人员（RO）。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任

				<p>华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份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 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月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。2021 年 8 月至 2023 年 12 月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。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 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、华泰柏瑞中证 1000 增强策略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 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的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A</p>
--	--	--	--	---

					股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证 A 股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。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。柳叶青 2026 年 2 月 25 日离任本基金基金经理助理。

4.1.3 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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 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。

4.3.3 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 39 次，是指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回望 2025 年，全球金融市场与宏观经济运行始终围绕两条核心主线展开——大国博弈下的政策变化与资产重定价，以及 AI 科技革命驱动的产业变革与市场叙事。两大主线交织共振，深刻影响了全球各类资产的表现逻辑。

具体来看，大国博弈维度，美国特朗普政府政策的反复摇摆成为市场波动的重要诱因。政策重心从前期的贸易保护、地缘风险升级引发全球避险情绪升温，逐步转向以“TACO”（关税减免、产业补贴、资本开放、海外合作）为核心的边际宽松导向，驱动市场风险偏好显著修复。在此背景下，美元指数与黄金价格呈现清晰的此消彼长格局，美元流动性边际宽松叠加新兴市场基本面相对改善，推动新兴市场权益资产在全球资产配置中占据优势地位。

科技叙事维度，AI 技术的突破性进展成为牵引全球市场的核心动力之一。以 DeepSeek 为代表的国内 AI 龙头企业实现技术迭代与商业化落地的双重突破，不仅激活了国内 AI 产业链的估值弹性，更带动整个科技板块及相关中国资产迎来价值重估浪潮。与之形成对比的是，美股科技板块虽延续高景气，但高估值压力与持续巨额研发投入的可持续性问题引发市场广泛讨论，科技泡沫的担忧情绪阶段性扰动市场节奏。

聚焦中国市场，2025 年在全球资产再平衡与美元走弱的双重背景下，中国资产迎来明确上行行情。年初，科技、港股、新消费、创新药、机器人等热门主题赛道多点开花，驱动市场实现“开门红”；但四月初受外部环境扰动，市场进入快速调整阶段。进入三季度后，市场重拾上行动能，开启持续上涨行情，沪指一度突破 4000 点整数关口，全年沪深 300 全收益指数累计上涨 20.98%，赚钱效应显著。

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 0.082%，期间日跟踪误差为 0.100%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 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 4.1730 元，本报告期基金份额净值增长率为 28.21%，业

绩比较基准收益率为 24.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，全球流动性环境有望维持相对宽松格局。尽管部分发达经济体央行或已步入宽松周期尾声，但多重因素或将约束紧缩力度并支撑宽松预期：美国就业市场偏弱态势未改、核心通胀逐步回落至可控区间，叠加美联储主席换届带来的政策取向调整，以及美国高额财政赤字带来的债务压力，美联储年内或实施 1 次左右的降息操作，有望为全球资产提供流动性支撑。

中国资产的中期配置价值有望持续提升，A 股上行格局有望延续。全球层面，美联储降息周期落地，为新兴市场资金流入创造了有利的流动性环境；而中国资产凭借科技实力与产业竞争力的持续提升等核心优势，在全球资金再平衡进程中具备突出吸引力。政策层面，2026 年作为“十五五”规划开局之年，政策或将延续“稳增长”与“适度宽松”的主基调，以扩大内需为战略基点，聚焦“产业科技+扩大内需”，为经济持续复苏与市场表现提供坚实支撑。资金层面，2025 年保险资金已显著加仓权益资产；2026 年在中长期资金入市政策的持续推动下，理财、信托、资管产品等更多机构资金有望加快入市，为市场注入增量资金。在此背景下，2026 年 A 股市场的驱动逻辑可能从 2025 年的估值修复逐步切换至盈利改善，核心资产或成为行情主导力量。一方面，随着国内经济稳步回升、企业盈利逐步改善，核心资产的盈利与增长韧性有望进一步凸显；另一方面，在“产业科技+扩大内需”的引领下，具备核心技术优势、深度绑定内需市场的核心资产，有望持续获得全球资金与国内机构资金的重点配置，或成为行情的核心引擎之一。

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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规法律部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；

对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；

严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司合规法律部开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司合规法律部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司合规法律部通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2026)审字第 70025451_B22 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的

	经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之

	<p>上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	施翊洲 胡莲莲
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2026 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,877,965.53	8,447,589.65
结算备付金		4,134,568.01	3,829,535.60
存出保证金		731,984.31	1,418,992.40
交易性金融资产	7.4.7.2	109,990,786.88	112,831,716.41
其中：股票投资		109,990,786.88	112,831,716.41
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		58,624.76	127,092.59
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		117,793,929.49	126,654,926.65
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	1,444.00
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	75,423.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,988.62	64,697.98
应付托管费		10,397.71	12,939.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,604.32	51,739.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	214,463.02	945,207.10
负债合计		278,453.67	1,151,451.10
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	84,572,059.36	115,805,369.78
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	32,943,416.46	9,698,105.77
净资产合计		117,515,475.82	125,503,475.55
负债和净资产总计		117,793,929.49	126,654,926.65

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.1730 元，基金份额总额 28,160,621.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		20,169,162.39	11,984,143.99
1. 利息收入		59,615.25	72,057.81
其中：存款利息收入	7.4.7.13	59,615.25	72,057.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,639,431.54	290,985.22
其中：股票投资收益	7.4.7.14	17,324,536.27	-3,975,655.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	14,882.66	13,361.32
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	1,014,789.17	1,589,658.98
股利收益	7.4.7.19	1,285,223.44	2,663,620.56
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	98,664.89	11,166,791.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	371,450.71	454,309.40
减：二、营业总支出		926,292.90	1,281,957.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	491,133.11	799,877.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	98,226.53	159,975.51
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,660.61	5,732.41
8. 其他费用	7.4.7.23	333,272.65	316,372.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,242,869.49	10,702,186.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,242,869.49	10,702,186.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,242,869.49	10,702,186.28

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	115,805,369.78	-	9,698,105.77	125,503,475.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	115,805,369.78	-	9,698,105.77	125,503,475.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,233,310.42	-	23,245,310.69	-7,987,999.73
（一）、综合收益总额	-	-	19,242,869.49	19,242,869.49
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-31,233,310.42	-	4,002,441.20	-27,230,869.22
其中：1. 基金申购款	171,783,207.29	-	45,420,102.92	217,203,310.21
2. 基金赎回	-203,016,517.7	-	-41,417,661.72	-244,434,179.43

回款	1			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	84,572,059.36	-	32,943,416.46	117,515,475.82
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-183,615,630.2 2	-	18,036,782.43	-165,578,847.79
(一)、综合收益总额	-	-	10,702,186.28	10,702,186.28
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-183,615,630.2 2	-	7,334,596.15	-176,281,034.07
其中：1. 基金申购款	110,659,318.25	-	-572,683.07	110,086,635.18
2. 基金赎回款	-294,274,948.4 7	-	7,907,279.22	-286,367,669.25
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	115,805,369.78	-	9,698,105.77	125,503,475.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>崔春</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2267 号《关于准予华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 635,421,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0531 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 10 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 635,421,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]244 号核准,本基金 635,421,000.00 份基金份额于 2023 年 11 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法

律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 A 股指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 A 股 ETF 发起式联接基金”)。华泰柏瑞中证 A 股 ETF 发起式联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2026 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类

取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账

面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代

缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息,以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配;基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估,基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上,方可对超额收益进行分配;本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的100%,基金收益分配每年至多4次。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	2,877,965.53	8,447,589.65
等于：本金	2,877,661.78	8,446,667.25
加：应计利息	303.75	922.40
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	2,877,965.53	8,447,589.65

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	103,179,379.63	-	109,990,786.88	6,811,407.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	103,179,379.63	-	109,990,786.88	6,811,407.25
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	105,699,554.05	-	112,831,716.41	7,132,162.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	105,699,554.05	-	112,831,716.41	7,132,162.36

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,476,260.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,476,260.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,476,260.00	-	-	-

项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,879,520.00	-	-	-
其中：股指期货投资	11,879,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,879,520.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2603	中证 500 股指期货 2603	1.00	1,473,320.00	108,120.00
IF2603	沪深 300 股指期货 2603	2.00	2,755,920.00	47,940.00
IM2603	中证 1000 股指期货 2603	1.00	1,487,800.00	84,720.00
合计				240,780.00
减：可抵销期货暂收款				240,780.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	14,463.02	13,864.41
其中：交易所市场	14,463.02	13,864.41
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	200,000.00	180,000.00
应退退补款	-	751,342.69

合计	214,463.02	945,207.10
----	------------	------------

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,560,621.00	115,805,369.78
本期申购	57,200,000.00	171,783,207.29
本期赎回（以“-”号填列）	-67,600,000.00	-203,016,517.71
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	28,160,621.00	84,572,059.36

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,503,088.43	3,195,017.34	9,698,105.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,503,088.43	3,195,017.34	9,698,105.77
本期利润	19,144,204.60	98,664.89	19,242,869.49
本期基金份额交易产生的变动数	-351,177.94	4,353,619.14	4,002,441.20
其中：基金申购款	32,502,247.35	12,917,855.57	45,420,102.92
基金赎回款	-32,853,425.29	-8,564,236.43	-41,417,661.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,296,115.09	7,647,301.37	32,943,416.46

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
	活期存款利息收入	11,542.86
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	47,954.62	42,074.19
其他	117.77	1,961.87
合计	59,615.25	72,057.81

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	11,334,461.02	-4,777,557.49
股票投资收益——赎回 差价收入	5,990,075.25	801,901.85
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	17,324,536.27	-3,975,655.64

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	147,587,365.34	204,691,171.11
减：卖出股票成本 总额	136,102,109.95	209,207,739.15
减：交易费用	150,794.37	260,989.45
买卖股票差价收入	11,334,461.02	-4,777,557.49

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	244,434,179.43	286,367,669.25

减：现金支付赎回款总额	123,129,749.43	136,219,795.25
减：赎回股票成本总额	115,314,354.75	149,345,972.15
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	5,990,075.25	801,901.85

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	2.63	10.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,880.03	13,350.97
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	14,882.66	13,361.32

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	49,884.67	112,367.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,000.00	99,000.00
减：应计利息总额	2.63	12.28
减：交易费用	2.01	4.49
买卖债券差价收入	14,880.03	13,350.97

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股指期货投资收益	1,014,789.17	1,589,658.98

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,285,223.44	2,663,620.56
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,285,223.44	2,663,620.56

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-320,755.11	11,294,115.56
股票投资	-320,755.11	11,294,115.56
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	419,420.00	-126,640.00
权证投资	-	-
期货投资	419,420.00	-126,640.00
3. 其他	-	-684.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	98,664.89	11,166,791.56

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	371,450.71	454,309.40
合计	371,450.71	454,309.40

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代

股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
注册登记费	150,000.00	150,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00	3,013.70
银行划款手续费	3,272.65	3,358.74
合计	333,272.65	316,372.44

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
Heron View Partners LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华泰柏瑞中证 A 股 ETF 发起式联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
华泰柏瑞资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证监会的相关批复，华泰柏瑞基金管理有限公司已在香港特别行政区政府的公司注册处办理完成香港子公司——华泰柏瑞资产管理（国际）有限公司的注册登记手续，并于 2025

年 9 月 12 日获得香港证券及期货事务监察委员会颁发的第一号（证券交易）、第四号（就证券提供意见）及第九号（提供资产管理）牌照。

3、本基金管理人股东 PineBridge Investment LLC 已于 2025 年 12 月 29 日在特拉华州完成公司名称变更，正式更名为 Heron View Partners LLC。本次更名系法律实体名称调整，未导致基金管理人控制权、股权结构或实际控制关系发生变更。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
华泰证券	114,617,973.21	39.26	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	22,925.65	39.26	7,525.76	52.03
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	491,133.11	799,877.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,930.23	18,461.28
应支付基金管理人的净管理费	481,202.88	781,416.07

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	98,226.53	159,975.51

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费

率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	3,521,100.00	12.5036	-	-
华泰证券股份有限公司	623,860.00	2.2154	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,877,965.53	11,542.86	8,447,589.65	28,021.75

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年12月31日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	301458	钧崴电子	网下申购	4,167	43,336.80
华泰联合证券	113697	应流转债	网上配售	30	3,000.00
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	4,318	67,749.42
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	1,173	30,498.00
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	622	18,050.44
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	5,893	66,531.97
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	1,866	41,723.76
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	2,506	54,455.38

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001369	双欣材料	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	6.85	12.89	183	1,253.55	2,358.87	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	22.29	35.39	52	1,159.08	1,840.28	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	36.80	65.23	73	2,686.40	4,761.79	-
301667	纳	2025	6 个月	新股	22.63	57.07	83	1,878.29	4,736.81	-

	百川	年 12 月 10 日		锁定期内						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	21.93	54.39	88	1,929.84	4,786.32	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	10.10	16.30	120	1,212.00	1,956.00	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	新股锁定期内	83.06	117.07	319	26,496.14	37,345.33	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	18.58	32.37	142	2,638.36	4,596.54	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	51.66	135.56	43	2,221.38	5,829.08	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	85.09	203.31	32	2,722.88	6,505.92	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股，按发行人及主承销商公告的限售档位执行，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份或创业板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌	复牌开盘单	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	----	------	------	------	----	-------	-------	--------	--------	----

	名称			单价	日期	价				
002049	紫光国微	2025年12月30日	重大事项	78.81	2026年1月15日	86.69	2,100	159,808.55	165,501.00	-
600058	五矿发展	2025年12月30日	拟筹划重大资产重组	11.52	2026年1月15日	12.67	9,100	81,888.10	104,832.00	-

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 日止持有以上因公布的拟筹划重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工

作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,877,965.53	-	-	-	-	-	-2,877,965.53
结算备付金	4,134,568.01	-	-	-	-	-	-4,134,568.01

存出保证金	45,939.51	-	-	-	-	-686,044.80	731,984.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	109,990.78	109,990,786.88
应收清算款	-	-	-	-	-	58,624.76	58,624.76
资产总计	7,058,473.05	-	-	-	-	110,735.45	117,793,929.64
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,988.62	51,988.62
应付托管费	-	-	-	-	-	10,397.71	10,397.71
应交税费	-	-	-	-	-	1,604.32	1,604.32
其他负债	-	-	-	-	-	214,463.02	214,463.02
负债总计	-	-	-	-	-	278,453.67	278,453.67
利率敏感度缺口	7,058,473.05	-	-	-	-	110,457.00	117,515,475.82
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,447,589.65	-	-	-	-	-	8,447,589.65
结算备付金	3,829,535.60	-	-	-	-	-	3,829,535.60
存出保证金	14,886.80	-	-	-	-	1,404,105.60	1,418,992.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	112,831.71	112,831,716.41
应收清算款	-	-	-	-	-	127,092.59	127,092.59
资产总计	12,292,012.05	-	-	-	-	114,362.91	126,654,926.65
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,444.00	1,444.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,697.98	64,697.98
应付托管费	-	-	-	-	-	12,939.59	12,939.59
应付清算款	-	-	-	-	-	75,423.00	75,423.00
应交税费	-	-	-	-	-	51,739.43	51,739.43
其他负债	-	-	-	-	-	945,207.10	945,207.10
负债总计	-	-	-	-	-	1,151,451.10	1,151,451.10
利率敏感度缺口	12,292,012.05	-	-	-	-	113,211.46	125,503,475.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	109,990,786.88	93.60	112,831,716.41	89.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-1,444.00	-0.00
合计	109,990,786.88	93.60	112,830,272.41	89.90

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	5,633,290.25	6,101,676.54
业绩比较基准下降 5%	-5,633,290.25	-6,101,676.54	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	109,645,736.94	112,586,463.51
第二层次	270,333.00	122,411.80
第三层次	74,716.94	122,841.10
合计	109,990,786.88	112,831,716.41

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三

层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	122,841.10	122,841.10
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	75,991.88	75,991.88
转出第三层次	-	254,995.05	254,995.05
当期利得或损失总额	-	130,879.01	130,879.01
其中：计入损益的利得或损失	-	130,879.01	130,879.01
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	74,716.94	74,716.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	30,519.02	30,519.02
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	55,269.25	55,269.25
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	188,751.32	188,751.32
转出第三层次	-	293,360.40	293,360.40
当期利得或损失总额	-	172,180.93	172,180.93
其中：计入损益的利得或损失	-	172,180.93	172,180.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	122,841.10	122,841.10

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	70,390.13	70,390.13
--	---	-----------	-----------

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2025 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	74,716.94	平均价格亚式期权模型	预期波动率	1.1989~2.4267	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	122,841.10	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3521~4.9648	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2025 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 217,203,310.21 元(2024 年度：110,086,635.18 元)，其中包括以股票支付的申购款 103,569,317.81 元和以现金支付的申购款 113,633,992.40 元(2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 55,547,827.59 元和以现金支付的申购款 54,538,807.59 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	109,990,786.88	93.38
	其中：股票	109,990,786.88	93.38
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	7,012,533.54	5.95
8	其他各项资产	790,609.07	0.67
9	合计	117,793,929.49	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	758,355.00	0.65
B	采矿业	5,404,581.50	4.60
C	制造业	70,854,815.83	60.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,741,006.00	2.33
E	建筑业	1,160,116.00	0.99
F	批发和零售业	1,084,001.80	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	2,455,976.88	2.09
H	住宿和餐饮业	170,251.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,096,426.30	5.19
J	金融业	13,797,442.56	11.74
K	房地产业	1,270,219.00	1.08
L	租赁和商务服务业	1,122,442.80	0.96

M	科学研究和技术服务业	1,252,119.50	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	791,232.75	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	55,348.00	0.05
Q	卫生和社会工作	291,648.02	0.25
R	文化、体育和娱乐业	470,028.00	0.40
S	综合	136,823.00	0.12
	合计	109,912,833.94	93.53

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.2 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	71,350.87	0.06
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	-	-
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	6,602.07	0.01
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	77,952.94	0.07

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600519	贵州茅台	2,000	2,754,360.00	2.34
2	300750	宁德时代	6,156	2,260,852.56	1.92
3	601318	中国平安	22,200	1,518,480.00	1.29
4	300308	中际旭创	2,100	1,281,000.00	1.09
5	601899	紫金矿业	34,800	1,199,556.00	1.02
6	300502	新易盛	2,100	904,848.00	0.77
7	688041	海光信息	3,995	896,517.95	0.76
8	000333	美的集团	10,199	797,051.85	0.68
9	601166	兴业银行	34,800	732,888.00	0.62
10	300274	阳光电源	4,080	697,843.20	0.59
11	002594	比亚迪	6,300	615,636.00	0.52
12	300059	东方财富	26,500	614,270.00	0.52
13	600276	恒瑞医药	10,300	613,571.00	0.52
14	300476	胜宏科技	2,100	603,918.00	0.51
15	600900	长江电力	22,200	603,618.00	0.51
16	601398	工商银行	73,100	579,683.00	0.49
17	002475	立讯精密	10,200	578,442.00	0.49
18	603259	药明康德	6,200	561,968.00	0.48
19	600030	中信证券	18,100	519,651.00	0.44
20	601138	工业富联	8,200	508,810.00	0.43
21	601288	农业银行	65,100	499,968.00	0.43
22	601211	国泰海通	24,316	499,693.80	0.43
23	688008	澜起科技	4,014	472,849.20	0.40
24	688981	中芯国际	3,559	437,151.97	0.37
25	000858	五粮液	4,100	434,354.00	0.37
26	300394	天孚通信	2,052	416,617.56	0.35
27	300760	迈瑞医疗	2,100	399,945.00	0.34
28	603986	兆易创新	1,800	385,650.00	0.33
29	601328	交通银行	50,000	362,500.00	0.31
30	600809	山西汾酒	2,100	360,570.00	0.31
31	600000	浦发银行	28,500	354,540.00	0.30
32	603019	中科曙光	4,100	351,124.00	0.30
33	002384	东山精密	4,100	347,065.00	0.30
34	002050	三花智控	6,200	342,922.00	0.29
35	601689	拓普集团	4,300	331,874.00	0.28
36	000651	格力电器	8,200	329,804.00	0.28

37	600309	万华化学	4,100	314,388.00	0.27
38	002028	思源电气	2,000	309,180.00	0.26
39	300124	汇川技术	4,100	308,853.00	0.26
40	002463	沪电股份	4,100	299,587.00	0.25
41	300115	长盈精密	6,300	292,950.00	0.25
42	601336	新华保险	4,200	292,740.00	0.25
43	600887	伊利股份	10,200	291,720.00	0.25
44	002969	嘉美包装	22,900	289,914.00	0.25
45	002709	天赐材料	6,200	287,246.00	0.24
46	600111	北方稀土	6,200	285,944.00	0.24
47	600183	生益科技	4,000	285,640.00	0.24
48	603799	华友钴业	4,100	279,866.00	0.24
49	002407	多氟多	8,200	278,062.00	0.24
50	603993	洛阳钼业	13,900	278,000.00	0.24
51	600919	江苏银行	26,600	276,640.00	0.24
52	000807	云铝股份	8,300	272,572.00	0.23
53	603083	剑桥科技	2,000	268,760.00	0.23
54	600660	福耀玻璃	4,100	265,557.00	0.23
55	600031	三一重工	12,300	259,899.00	0.22
56	601601	中国太保	6,200	259,842.00	0.22
57	300136	信维通信	4,100	254,200.00	0.22
58	601127	赛力斯	2,100	254,016.00	0.22
59	603501	豪威集团	2,000	251,800.00	0.21
60	601088	中国神华	6,200	251,100.00	0.21
61	000063	中兴通讯	6,200	234,608.00	0.20
62	601816	京沪高铁	45,400	233,810.00	0.20
63	000792	盐湖股份	8,300	233,728.00	0.20
64	000568	泸州老窖	2,000	232,440.00	0.20
65	601100	恒立液压	2,100	230,811.00	0.20
66	002837	英维克	2,150	229,813.50	0.20
67	601012	隆基绿能	12,400	225,680.00	0.19
68	300390	天华新能	4,100	223,901.00	0.19
69	600016	民生银行	57,400	219,842.00	0.19
70	601225	陕西煤业	10,300	219,596.00	0.19
71	000426	兴业银锡	6,100	217,160.00	0.18
72	000425	徐工机械	18,700	216,546.00	0.18
73	300058	蓝色光标	18,440	212,428.80	0.18
74	300223	北京君正	2,000	212,080.00	0.18
75	601857	中国石油	20,300	211,323.00	0.18
76	601939	建设银行	22,600	209,728.00	0.18
77	002714	牧原股份	4,100	207,378.00	0.18
78	002230	科大讯飞	4,100	206,189.00	0.18
79	601728	中国电信	32,700	206,010.00	0.18

80	605358	立昂微	5,900	205,438.00	0.17
81	601229	上海银行	20,300	205,030.00	0.17
82	300450	先导智能	4,100	204,918.00	0.17
83	600418	江淮汽车	4,100	202,950.00	0.17
84	300604	长川科技	2,000	202,620.00	0.17
85	600941	中国移动	2,000	202,100.00	0.17
86	000975	山金国际	8,300	201,939.00	0.17
87	300724	捷佳伟创	2,100	200,760.00	0.17
88	002532	天山铝业	12,400	200,632.00	0.17
89	300395	菲利华	2,000	200,600.00	0.17
90	002625	光启技术	4,100	199,916.00	0.17
91	600118	中国卫星	2,100	199,395.00	0.17
92	600699	均胜电子	6,200	194,432.00	0.17
93	002472	双环传动	4,100	194,381.00	0.17
94	000661	长春高新	2,100	194,355.00	0.17
95	603296	华勤技术	2,100	190,554.00	0.16
96	688013	天臣医疗	3,939	189,387.12	0.16
97	688237	超卓航科	3,874	188,857.50	0.16
98	601919	中远海控	12,400	188,232.00	0.16
99	300408	三环集团	4,100	187,575.00	0.16
100	001203	大中矿业	6,100	186,965.00	0.16
101	600406	国电南瑞	8,300	186,584.00	0.16
102	600580	卧龙电驱	3,800	186,580.00	0.16
103	601628	中国人寿	4,100	186,550.00	0.16
104	002430	杭氧股份	6,200	185,194.00	0.16
105	002415	海康威视	6,100	182,024.00	0.15
106	002422	科伦药业	6,200	181,970.00	0.15
107	605117	德业股份	2,100	181,020.00	0.15
108	002851	麦格米特	2,000	180,140.00	0.15
109	601888	中国中免	1,900	179,664.00	0.15
110	002558	巨人网络	4,100	177,489.00	0.15
111	600879	航天电子	8,300	176,956.00	0.15
112	000001	平安银行	15,500	176,855.00	0.15
113	002241	歌尔股份	6,100	175,253.00	0.15
114	300418	昆仑万维	4,200	175,140.00	0.15
115	300762	上海瀚讯	4,200	175,056.00	0.15
116	601988	中国银行	30,500	174,765.00	0.15
117	601600	中国铝业	14,300	174,746.00	0.15
118	002142	宁波银行	6,200	174,158.00	0.15
119	600150	中国船舶	5,179	172,253.54	0.15
120	601168	西部矿业	6,200	171,368.00	0.15
121	300782	卓胜微	2,100	171,108.00	0.15
122	000933	神火股份	6,200	170,314.00	0.14

123	002595	豪迈科技	2,000	169,020.00	0.14
124	002008	大族激光	4,100	168,879.00	0.14
125	000408	藏格矿业	2,000	168,800.00	0.14
126	603272	联翔股份	8,300	166,913.00	0.14
127	000100	TCL 科技	36,600	166,164.00	0.14
128	603160	汇顶科技	2,100	165,900.00	0.14
129	603730	岱美股份	18,900	165,564.00	0.14
130	002049	紫光国微	2,100	165,501.00	0.14
131	002738	中矿资源	2,100	164,955.00	0.14
132	600143	金发科技	8,300	162,182.00	0.14
133	603979	金诚信	2,100	159,915.00	0.14
134	000400	许继电气	6,200	159,402.00	0.14
135	600601	方正科技	13,600	159,392.00	0.14
136	600690	海尔智家	6,100	159,149.00	0.14
137	600547	山东黄金	4,100	158,711.00	0.14
138	002545	东方铁塔	8,600	158,670.00	0.14
139	000988	华工科技	2,000	158,660.00	0.14
140	002027	分众传媒	21,500	158,455.00	0.13
141	601077	渝农商行	24,500	158,270.00	0.13
142	002352	顺丰控股	4,100	157,112.00	0.13
143	603179	新泉股份	2,111	155,960.68	0.13
144	688472	阿特斯	10,380	154,765.80	0.13
145	002156	通富微电	4,100	154,570.00	0.13
146	300316	晶盛机电	4,200	154,350.00	0.13
147	300054	鼎龙股份	4,100	154,160.00	0.13
148	600160	巨化股份	4,000	153,680.00	0.13
149	603228	景旺电子	2,100	153,489.00	0.13
150	600487	亨通光电	6,200	153,326.00	0.13
151	000938	紫光股份	6,200	152,520.00	0.13
152	300118	东方日升	10,400	152,464.00	0.13
153	300132	青松股份	17,500	152,425.00	0.13
154	688021	奥福科技	8,260	151,571.00	0.13
155	000725	京东方 A	36,000	151,560.00	0.13
156	300024	机器人	8,300	150,977.00	0.13
157	002497	雅化集团	6,100	150,975.00	0.13
158	300474	景嘉微	2,100	150,927.00	0.13
159	600783	鲁信创投	6,100	150,853.00	0.13
160	600584	长电科技	4,100	150,798.00	0.13
161	601818	光大银行	43,200	150,768.00	0.13
162	002138	顺络电子	4,200	149,226.00	0.13
163	688005	容百科技	4,211	149,069.40	0.13
164	002353	杰瑞股份	2,100	148,743.00	0.13
165	002409	雅克科技	2,000	148,200.00	0.13

166	601658	邮储银行	26,600	144,970.00	0.12
167	601825	沪农商行	15,600	144,924.00	0.12
168	600489	中金黄金	6,200	144,832.00	0.12
169	688681	科汇股份	8,194	144,050.52	0.12
170	603087	甘李药业	2,100	142,947.00	0.12
171	300373	扬杰科技	2,100	142,800.00	0.12
172	600089	特变电工	6,400	142,208.00	0.12
173	301019	宁波色母	6,209	141,937.74	0.12
174	300018	中元股份	12,900	141,900.00	0.12
175	600141	兴发集团	4,100	141,778.00	0.12
176	300661	圣邦股份	2,060	141,398.40	0.12
177	002240	盛新锂能	4,100	141,163.00	0.12
178	601998	中信银行	18,200	140,140.00	0.12
179	002281	光迅科技	2,000	139,900.00	0.12
180	300748	金力永磁	4,100	139,851.00	0.12
181	000338	潍柴动力	8,100	139,320.00	0.12
182	600486	扬农化工	2,000	138,780.00	0.12
183	688599	天合光能	8,382	138,722.10	0.12
184	300498	温氏股份	8,200	138,416.00	0.12
185	300014	亿纬锂能	2,100	138,096.00	0.12
186	600096	云天化	4,100	136,981.00	0.12
187	600673	东阳光	6,100	136,823.00	0.12
188	301358	湖南裕能	2,100	135,786.00	0.12
189	002517	恺英网络	6,200	135,594.00	0.12
190	300432	富临精工	8,100	135,270.00	0.12
191	300496	中科创达	2,000	135,000.00	0.11
192	601058	赛轮轮胎	8,300	134,294.00	0.11
193	600066	宇通客车	4,100	134,070.00	0.11
194	300929	华骐环保	12,400	133,300.00	0.11
195	000977	浪潮信息	2,000	133,200.00	0.11
196	600363	联创光电	2,100	132,426.00	0.11
197	600415	小商品城	8,300	132,385.00	0.11
198	300509	新美星	10,300	132,252.00	0.11
199	002460	赣锋锂业	2,100	132,069.00	0.11
200	688180	君实生物	3,864	131,994.24	0.11
201	000923	河钢资源	6,200	131,254.00	0.11
202	002131	利欧股份	23,200	130,848.00	0.11
203	300255	常山药业	2,100	130,410.00	0.11
204	300487	蓝晓科技	2,100	129,675.00	0.11
205	600761	安徽合力	6,200	129,518.00	0.11
206	601872	招商轮船	14,400	129,312.00	0.11
207	002436	兴森科技	6,100	129,137.00	0.11
208	600221	海航控股	71,300	129,053.00	0.11

209	002600	领益智造	8,300	128,982.00	0.11
210	600426	华鲁恒升	4,100	128,863.00	0.11
211	002195	岩山科技	18,100	128,329.00	0.11
212	600988	赤峰黄金	4,100	128,084.00	0.11
213	601665	齐鲁银行	22,300	128,002.00	0.11
214	600885	宏发股份	4,200	127,680.00	0.11
215	002268	电科网安	6,200	127,348.00	0.11
216	600438	通威股份	6,200	127,224.00	0.11
217	600010	包钢股份	53,300	126,854.00	0.11
218	603919	金徽酒	6,200	126,604.00	0.11
219	002797	第一创业	18,400	126,408.00	0.11
220	002346	柘中股份	6,200	125,922.00	0.11
221	688128	中国电研	4,300	125,044.00	0.11
222	601727	上海电气	14,500	124,845.00	0.11
223	002396	星网锐捷	4,100	124,230.00	0.11
224	300433	蓝思科技	4,100	124,107.00	0.11
225	601233	桐昆股份	7,200	123,912.00	0.11
226	600050	中国联通	24,200	123,662.00	0.11
227	600570	恒生电子	4,100	123,615.00	0.11
228	300126	锐奇股份	14,400	123,264.00	0.10
229	002966	苏州银行	14,800	122,692.00	0.10
230	300385	雪浪环境	19,700	122,534.00	0.10
231	002202	金风科技	6,000	122,400.00	0.10
232	601963	重庆银行	11,278	122,140.74	0.10
233	000009	中国宝安	12,400	122,140.00	0.10
234	300601	康泰生物	8,260	122,000.20	0.10
235	301237	和顺科技	2,100	121,611.00	0.10
236	300045	华力创通	4,200	121,422.00	0.10
237	300073	当升科技	2,100	121,380.00	0.10
238	688251	井松智能	4,103	120,628.20	0.10
239	603606	东方电缆	2,000	119,500.00	0.10
240	300170	汉得信息	6,300	119,196.00	0.10
241	300347	泰格医药	2,100	119,070.00	0.10
242	601021	春秋航空	2,000	119,000.00	0.10
243	603338	浙江鼎力	2,100	118,944.00	0.10
244	601009	南京银行	10,400	118,872.00	0.10
245	605589	圣泉集团	4,200	118,860.00	0.10
246	002318	久立特材	4,100	118,695.00	0.10
247	603000	人民网	6,200	118,110.00	0.10
248	600760	中航沈飞	2,100	117,915.00	0.10
249	002439	启明星辰	8,300	117,196.00	0.10
250	300122	智飞生物	6,200	116,994.00	0.10
251	600460	士兰微	4,100	116,481.00	0.10

252	002466	天齐锂业	2,100	116,298.00	0.10
253	300657	弘信电子	4,200	116,172.00	0.10
253	603005	晶方科技	4,200	116,172.00	0.10
254	688558	国盛智科	4,004	115,835.72	0.10
255	000551	创元科技	7,860	115,542.00	0.10
256	688701	卓锦股份	14,161	115,412.15	0.10
257	000683	博源化工	15,500	115,320.00	0.10
258	000799	酒鬼酒	2,100	114,618.00	0.10
259	002386	天原股份	21,100	114,573.00	0.10
260	000966	长源电力	26,800	114,436.00	0.10
261	002128	电投能源	4,100	114,431.00	0.10
262	002139	拓邦股份	8,300	114,374.00	0.10
263	000960	锡业股份	4,100	114,308.00	0.10
264	601106	中国一重	28,600	114,114.00	0.10
265	601360	三六零	10,200	113,934.00	0.10
266	002756	永兴材料	2,100	113,925.00	0.10
267	601187	厦门银行	15,500	113,770.00	0.10
268	002812	恩捷股份	2,000	113,280.00	0.10
269	003039	顺控发展	7,100	113,103.00	0.10
270	688367	工大高科	3,650	113,004.00	0.10
271	002185	华天科技	10,300	112,991.00	0.10
272	000766	通化金马	4,100	112,709.00	0.10
273	300832	新产业	2,000	112,500.00	0.10
274	002212	天融信	12,400	112,468.00	0.10
275	300285	国瓷材料	4,100	112,381.00	0.10
276	600522	中天科技	6,200	112,344.00	0.10
277	002330	得利斯	23,200	112,288.00	0.10
278	600702	舍得酒业	2,000	112,160.00	0.10
279	688586	江航装备	8,600	112,144.00	0.10
280	603659	璞泰来	4,100	112,094.00	0.10
281	601668	中国建筑	21,800	111,834.00	0.10
282	000672	上峰水泥	8,600	111,714.00	0.10
283	603298	杭叉集团	4,200	111,594.00	0.09
284	000980	众泰汽车	31,600	111,548.00	0.09
285	000036	华联控股	16,900	111,540.00	0.09
286	000564	供销大集	44,600	111,500.00	0.09
287	002271	东方雨虹	8,200	111,438.00	0.09
288	600063	皖维高新	18,900	111,321.00	0.09
289	300142	沃森生物	10,200	111,282.00	0.09
290	601169	北京银行	20,300	111,244.00	0.09
291	000735	罗牛山	12,300	111,192.00	0.09
292	002335	科华数据	2,000	111,060.00	0.09
293	002961	瑞达期货	4,100	110,987.00	0.09

294	603987	康德莱	12,900	110,940.00	0.09
295	300036	超图软件	6,100	110,776.00	0.09
296	002311	海大集团	2,000	110,760.00	0.09
297	300001	特锐德	4,300	110,424.00	0.09
298	300983	尤安设计	4,120	110,416.00	0.09
299	002245	蔚蓝锂芯	6,200	110,360.00	0.09
300	601162	天风证券	26,500	110,240.00	0.09
301	601020	华钰矿业	4,100	110,126.00	0.09
302	603885	吉祥航空	7,400	110,112.00	0.09
303	300037	新宙邦	2,100	110,040.00	0.09
304	002459	晶澳科技	9,600	109,920.00	0.09
305	600884	杉杉股份	8,100	109,431.00	0.09
306	002456	欧菲光	10,300	109,386.00	0.09
307	002865	钧达股份	2,000	109,220.00	0.09
308	002585	双星新材	16,200	109,026.00	0.09
309	600872	中炬高新	6,200	108,810.00	0.09
310	688267	中触媒	3,857	108,651.69	0.09
311	688352	颀中科技	8,600	108,446.00	0.09
312	301097	天益医疗	2,100	108,402.00	0.09
313	000767	晋控电力	38,700	108,360.00	0.09
314	300219	鸿利智汇	15,000	108,150.00	0.09
315	600115	中国东航	18,000	108,000.00	0.09
316	002653	海思科	2,100	107,772.00	0.09
317	605116	奥锐特	4,300	107,715.00	0.09
318	603596	伯特利	2,100	107,667.00	0.09
319	600312	平高电气	6,200	107,570.00	0.09
320	600300	维维股份	30,600	107,406.00	0.09
321	603968	醋化股份	9,600	107,232.00	0.09
322	300207	欣旺达	4,100	107,215.00	0.09
323	300182	捷成股份	19,400	107,088.00	0.09
324	601700	风范股份	18,900	106,974.00	0.09
325	000422	湖北宜化	7,500	106,575.00	0.09
326	600015	华夏银行	15,500	106,485.00	0.09
327	600795	国电电力	21,100	106,344.00	0.09
328	002938	鹏鼎控股	2,100	106,218.00	0.09
329	300088	长信科技	17,500	106,050.00	0.09
330	600176	中国巨石	6,200	106,020.00	0.09
331	002603	以岭药业	6,200	105,834.00	0.09
332	688303	大全能源	3,939	105,643.98	0.09
333	601099	太平洋	25,700	105,627.00	0.09
334	300442	润泽科技	2,000	105,600.00	0.09
335	300364	中文在线	4,200	105,504.00	0.09
336	002768	国恩股份	2,000	105,360.00	0.09

337	002130	沃尔核材	4,000	105,280.00	0.09
338	601611	中国核建	7,800	105,144.00	0.09
339	688469	芯联集成	15,700	105,033.00	0.09
340	600546	山煤国际	10,400	104,936.00	0.09
341	000600	建投能源	12,300	104,919.00	0.09
342	600058	五矿发展	9,100	104,832.00	0.09
343	000733	振华科技	2,000	104,820.00	0.09
344	603279	景津装备	6,200	104,594.00	0.09
345	601766	中国中车	15,300	104,346.00	0.09
346	601198	东兴证券	7,500	104,100.00	0.09
347	002294	信立泰	2,100	104,055.00	0.09
348	688223	晶科能源	18,425	103,917.00	0.09
349	000021	深科技	4,100	103,648.00	0.09
350	600222	太龙药业	15,700	103,306.00	0.09
351	000423	东阿阿胶	2,100	103,068.00	0.09
352	600428	中远海特	14,500	102,950.00	0.09
353	000718	苏宁环球	44,700	102,363.00	0.09
354	002807	江阴银行	22,300	101,911.00	0.09
355	600233	圆通速递	6,200	101,804.00	0.09
356	300251	光线传媒	6,200	101,556.00	0.09
357	002262	恩华药业	4,200	101,346.00	0.09
358	601128	常熟银行	14,363	101,115.52	0.09
359	601606	长城军工	2,100	101,052.00	0.09
360	000987	越秀资本	12,400	100,936.00	0.09
361	600100	同方股份	11,300	100,796.00	0.09
362	601007	金陵饭店	12,900	100,749.00	0.09
363	601717	中创智领	4,100	100,655.00	0.09
364	600801	华新建材	4,100	100,614.00	0.09
365	002273	水晶光电	4,000	100,480.00	0.09
366	002025	航天电器	2,000	100,260.00	0.09
367	002400	省广集团	11,300	100,231.00	0.09
368	301105	鸿铭股份	2,100	100,107.00	0.09
369	002624	完美世界	6,100	99,979.00	0.09
370	601838	成都银行	6,200	99,944.00	0.09
371	601577	长沙银行	10,300	99,910.00	0.09
372	000758	中色股份	15,000	99,600.00	0.08
373	600060	海信视像	4,100	99,548.00	0.08
374	300674	宇信科技	4,100	99,466.00	0.08
375	000935	四川双马	4,000	99,360.00	0.08
376	601059	信达证券	5,600	99,176.00	0.08
377	688178	万德斯	4,120	99,003.60	0.08
378	300339	润和软件	2,000	99,000.00	0.08
379	002067	景兴纸业	17,500	98,875.00	0.08

380	002673	西部证券	12,500	98,625.00	0.08
381	002958	青农商行	31,800	98,580.00	0.08
382	300009	安科生物	10,300	98,571.00	0.08
383	002389	航天彩虹	4,100	98,318.00	0.08
384	601669	中国电建	18,900	98,280.00	0.08
385	300512	中亚股份	10,300	98,056.00	0.08
386	300558	贝达药业	2,100	98,049.00	0.08
387	000617	中油资本	10,200	97,920.00	0.08
388	300068	南都电源	6,300	97,902.00	0.08
389	600416	湘电股份	6,200	97,836.00	0.08
390	002465	海格通信	6,200	97,650.00	0.08
391	000823	超声电子	7,200	97,632.00	0.08
392	300012	华测检测	7,200	97,560.00	0.08
393	601969	海南矿业	8,200	97,416.00	0.08
394	600351	亚宝药业	15,000	97,350.00	0.08
395	300919	中伟新材	2,100	97,293.00	0.08
396	000625	长安汽车	8,200	97,252.00	0.08
397	600536	中国软件	2,100	97,230.00	0.08
398	601375	中原证券	22,600	97,180.00	0.08
399	600026	中远海能	8,300	96,944.00	0.08
400	002129	TCL 中环	11,300	96,841.00	0.08
401	002555	三七互娱	4,100	96,760.00	0.08
402	000791	甘肃能源	15,000	96,750.00	0.08
403	601567	三星医疗	4,200	96,684.00	0.08
404	600970	中材国际	9,300	96,627.00	0.08
405	002373	千方科技	8,200	96,514.00	0.08
406	300003	乐普医疗	6,100	96,441.00	0.08
407	688101	三达膜	5,865	96,420.60	0.08
408	688395	正弦电气	3,950	96,064.00	0.08
409	600621	华鑫股份	6,300	96,012.00	0.08
410	000686	东北证券	10,300	95,996.00	0.08
411	601991	大唐发电	27,500	95,975.00	0.08
412	000893	亚钾国际	2,000	95,940.00	0.08
413	601528	瑞丰银行	16,800	95,760.00	0.08
414	002539	云图控股	8,100	95,742.00	0.08
415	000402	金融街	34,800	95,700.00	0.08
416	600157	永泰能源	60,900	95,613.00	0.08
417	000797	中国武夷	24,300	95,499.00	0.08
418	002151	北斗星通	2,100	95,403.00	0.08
419	002825	纳尔股份	8,300	95,367.00	0.08
420	300676	华大基因	2,100	95,256.00	0.08
421	300640	德艺文创	12,300	95,202.00	0.08
422	600596	新安股份	8,300	95,201.00	0.08

423	000887	中鼎股份	4,100	95,161.00	0.08
424	601633	长城汽车	4,200	95,046.00	0.08
425	300834	星辉环材	4,100	95,038.00	0.08
426	300352	北信源	15,500	95,015.00	0.08
427	300618	寒锐钴业	2,100	94,941.00	0.08
428	301236	软通动力	2,000	94,860.00	0.08
429	600728	佳都科技	14,200	94,856.00	0.08
430	600926	杭州银行	6,200	94,736.00	0.08
431	300377	赢时胜	4,200	94,710.00	0.08
432	301059	金三江	7,500	94,500.00	0.08
433	603392	万泰生物	2,100	94,374.00	0.08
434	000911	广农糖业	12,900	94,299.00	0.08
435	002548	金新农	15,500	94,240.00	0.08
436	000750	国海证券	22,200	94,128.00	0.08
437	688669	聚石化学	4,039	93,866.36	0.08
438	600839	四川长虹	10,300	93,730.00	0.08
439	002216	三全食品	8,300	93,707.00	0.08
440	300168	万达信息	14,500	93,670.00	0.08
441	002533	金杯电工	7,500	93,600.00	0.08
442	300110	华仁药业	29,700	93,555.00	0.08
443	002367	康力电梯	11,600	93,496.00	0.08
444	603311	金海高科	6,100	93,208.00	0.08
445	002957	科瑞技术	4,300	93,095.00	0.08
446	300568	星源材质	6,100	93,025.00	0.08
447	601696	中银证券	6,200	92,938.00	0.08
448	000831	中国稀土	2,000	92,880.00	0.08
449	301109	军信股份	6,180	92,700.00	0.08
450	600019	宝钢股份	12,400	92,380.00	0.08
451	000783	长江证券	11,300	92,095.00	0.08
452	600338	西藏珠峰	6,100	91,744.00	0.08
453	300303	聚飞光电	13,400	91,656.00	0.08
454	603323	苏农银行	18,130	91,556.50	0.08
455	301189	奥尼电子	2,100	91,329.00	0.08
456	000069	华侨城 A	36,700	91,016.00	0.08
457	603132	金徽股份	6,200	90,954.00	0.08
458	300346	南大光电	2,120	90,948.00	0.08
459	002557	洽洽食品	4,200	90,804.00	0.08
460	688779	五矿新能	12,109	90,696.41	0.08
461	002948	青岛银行	20,200	90,496.00	0.08
462	300015	爱尔眼科	8,200	90,036.00	0.08
463	601975	招商南油	29,800	89,996.00	0.08
464	002429	兆驰股份	12,100	89,782.00	0.08
465	600585	海螺水泥	4,100	89,626.00	0.08

466	002414	高德红外	6,100	89,487.00	0.08
467	003008	开普检测	4,150	89,432.50	0.08
468	600211	西藏药业	2,100	89,355.00	0.08
469	000066	中国长城	6,200	89,342.00	0.08
470	301037	保立佳	6,200	89,280.00	0.08
471	300761	立华股份	4,300	89,225.00	0.08
472	600017	日照港	29,700	89,100.00	0.08
473	600028	中国石化	14,400	88,992.00	0.08
474	601326	秦港股份	25,400	88,646.00	0.08
475	002690	美亚光电	4,300	88,451.00	0.08
476	002706	良信股份	8,200	88,396.00	0.08
477	301098	金埔园林	10,300	88,374.00	0.08
478	600989	宝丰能源	4,500	88,335.00	0.08
479	601615	明阳智能	6,100	88,328.00	0.08
480	601777	千里科技	8,300	88,229.00	0.08
481	002511	中顺洁柔	10,300	88,168.00	0.08
482	000157	中联重科	10,200	88,026.00	0.07
483	002612	朗姿股份	4,300	87,892.00	0.07
484	600895	张江高科	2,000	87,800.00	0.07
485	603939	益丰药房	4,040	87,748.80	0.07
486	600703	三安光电	6,200	87,606.00	0.07
487	301065	本立科技	4,100	87,535.00	0.07
488	002155	湖南黄金	4,150	87,523.50	0.07
489	600298	安琪酵母	2,000	87,480.00	0.07
490	300458	全志科技	2,080	87,422.40	0.07
491	600759	洲际油气	28,000	87,360.00	0.07
492	600845	宝信软件	4,200	86,982.00	0.07
493	301190	善水科技	4,100	86,961.00	0.07
494	300241	瑞丰光电	15,500	86,645.00	0.07
495	601985	中国核电	10,000	86,500.00	0.07
496	002332	仙琚制药	9,600	86,496.00	0.07
497	002984	森麒麟	4,080	86,373.60	0.07
498	600123	兰花科创	14,600	86,286.00	0.07
499	600461	洪城环境	9,300	86,211.00	0.07
500	600392	盛和资源	4,000	86,120.00	0.07
501	600201	生物股份	5,700	85,899.00	0.07
502	300133	华策影视	10,300	85,696.00	0.07
503	002701	奥瑞金	14,400	85,680.00	0.07
503	300777	中简科技	2,100	85,680.00	0.07
504	601000	唐山港	22,300	85,632.00	0.07
505	002152	广电运通	6,200	85,622.00	0.07
506	600039	四川路桥	8,600	85,570.00	0.07
507	300026	红日药业	24,300	85,536.00	0.07

508	603587	地素时尚	6,400	85,504.00	0.07
509	600971	恒源煤电	13,700	85,488.00	0.07
510	000917	电广传媒	8,300	85,324.00	0.07
511	600726	华电能源	35,700	85,323.00	0.07
512	000531	穗恒运 A	13,300	85,253.00	0.07
513	300943	春晖智控	4,100	85,198.00	0.07
514	300017	网宿科技	8,300	85,075.00	0.07
515	002180	纳思达	4,200	84,924.00	0.07
516	600285	羚锐制药	4,100	84,911.00	0.07
517	601933	永辉超市	18,100	84,889.00	0.07
518	600482	中国动力	4,100	84,870.00	0.07
519	600908	无锡银行	14,300	84,799.00	0.07
520	300296	利亚德	13,400	84,688.00	0.07
521	601179	中国西电	9,300	84,630.00	0.07
522	600499	科达制造	6,100	84,607.00	0.07
523	002057	中钢天源	8,300	84,577.00	0.07
524	000581	威孚高科	4,100	84,542.00	0.07
525	601997	贵阳银行	14,400	84,528.00	0.07
526	301175	中科环保	14,300	84,513.00	0.07
527	000528	柳工	7,100	84,277.00	0.07
528	300085	银之杰	2,100	84,189.00	0.07
529	600893	航发动力	2,100	84,063.00	0.07
530	002479	富春环保	17,100	83,790.00	0.07
531	601699	潞安环能	7,100	83,780.00	0.07
532	600512	腾达建设	34,600	83,732.00	0.07
533	601882	海天精工	4,300	83,678.00	0.07
534	000429	粤高速 A	7,100	83,638.00	0.07
535	000158	常山北明	4,100	83,599.00	0.07
536	603308	应流股份	2,000	83,500.00	0.07
537	600199	金种子酒	8,600	83,248.00	0.07
538	300193	佳士科技	9,300	83,235.00	0.07
539	300100	双林股份	2,100	83,202.00	0.07
540	600313	农发种业	12,900	83,076.00	0.07
541	300091	*ST 金灵	26,100	82,998.00	0.07
542	300002	神州泰岳	7,200	82,944.00	0.07
543	688772	珠海冠宇	3,850	82,890.50	0.07
544	000963	华东医药	2,100	82,845.00	0.07
545	600733	北汽蓝谷	10,300	82,709.00	0.07
546	001965	招商公路	8,200	82,656.00	0.07
547	300529	健帆生物	4,200	82,614.00	0.07
548	002506	协鑫集成	29,500	82,600.00	0.07
549	600073	光明肉业	12,900	82,560.00	0.07
550	001258	立新能源	11,600	82,476.00	0.07

551	600933	爱柯迪	4,100	82,410.00	0.07
552	002839	张家港行	18,000	82,260.00	0.07
553	600797	浙大网新	8,300	82,253.00	0.07
554	600588	用友网络	6,200	82,212.00	0.07
555	600390	五矿资本	14,800	82,140.00	0.07
556	002074	国轩高科	2,100	82,131.00	0.07
557	002079	苏州固锝	8,600	82,130.00	0.07
558	002041	登海种业	8,600	82,044.00	0.07
559	601666	平煤股份	10,400	81,848.00	0.07
560	600029	南方航空	10,200	81,702.00	0.07
561	300677	英科医疗	2,100	81,690.00	0.07
562	300160	秀强股份	15,000	81,600.00	0.07
563	600515	海南机场	15,300	81,549.00	0.07
564	300468	四方精创	2,100	81,543.00	0.07
565	601001	晋控煤业	6,200	81,530.00	0.07
566	300365	恒华科技	12,900	81,528.00	0.07
567	000563	陕国投 A	23,600	81,420.00	0.07
568	601918	新集能源	12,300	81,303.00	0.07
569	000932	华菱钢铁	14,400	80,928.00	0.07
570	300332	天壕能源	15,500	80,910.00	0.07
571	000983	山西焦煤	12,600	80,892.00	0.07
572	002626	金达威	4,100	80,811.00	0.07
573	300439	美康生物	8,200	80,770.00	0.07
574	600779	水井坊	2,100	80,766.00	0.07
575	600928	西安银行	21,700	80,290.00	0.07
576	002601	龙佰集团	4,100	80,278.00	0.07
576	300034	钢研高纳	4,100	80,278.00	0.07
577	600012	皖通高速	5,400	80,028.00	0.07
578	600350	山东高速	8,200	79,950.00	0.07
579	300741	华宝股份	4,300	79,894.00	0.07
580	300768	迪普科技	4,300	79,679.00	0.07
581	002783	凯龙股份	8,300	79,431.00	0.07
582	000401	金隅冀东	18,000	79,380.00	0.07
583	600348	华阳股份	9,600	79,296.00	0.07
584	002841	视源股份	2,000	79,260.00	0.07
585	600295	鄂尔多斯	6,400	79,104.00	0.07
586	000629	钒钛股份	25,500	79,050.00	0.07
587	300699	光威复材	2,000	78,920.00	0.07
588	600763	通策医疗	1,962	78,892.02	0.07
589	600425	青松建化	18,900	78,624.00	0.07
590	600765	中航重机	4,100	78,556.00	0.07
591	002203	海亮股份	6,200	78,492.00	0.07
592	600331	宏达股份	6,100	78,019.00	0.07

593	002051	中工国际	8,600	78,002.00	0.07
594	002410	广联达	6,200	77,996.00	0.07
595	688132	邦彦技术	4,229	77,898.18	0.07
596	603861	白云电器	6,400	77,888.00	0.07
597	688718	唯赛勃	5,954	77,878.32	0.07
598	000034	神州数码	2,000	77,820.00	0.07
599	002317	众生药业	4,100	77,818.00	0.07
600	603288	海天味业	2,100	77,742.00	0.07
601	603197	保隆科技	2,100	77,679.00	0.07
602	002236	大华股份	4,100	77,654.00	0.07
603	000031	大悦城	27,500	77,550.00	0.07
604	600488	津药药业	18,900	77,301.00	0.07
605	002926	华西证券	8,300	77,024.00	0.07
606	688126	沪硅产业	3,559	77,016.76	0.07
607	600410	华胜天成	4,300	76,884.00	0.07
608	600011	华能国际	10,300	76,838.00	0.07
609	601111	中国国航	8,200	76,834.00	0.07
610	603688	石英股份	2,100	76,818.00	0.07
611	603927	中科软	4,020	76,741.80	0.07
612	600903	贵州燃气	11,600	76,676.00	0.07
613	002481	双塔食品	15,000	76,650.00	0.07
614	300083	创世纪	8,300	76,443.00	0.07
615	002060	广东建工	21,200	76,320.00	0.06
616	002080	中材科技	2,100	76,314.00	0.06
617	300383	光环新网	6,100	76,311.00	0.06
618	603105	芯能科技	8,300	76,277.00	0.06
619	002065	东华软件	8,300	75,945.00	0.06
620	600127	金健米业	11,300	75,936.00	0.06
621	600248	陕建股份	21,500	75,895.00	0.06
622	600208	衢州发展	19,600	75,852.00	0.06
623	300765	新诺威	2,100	75,747.00	0.06
624	603077	和邦生物	33,500	75,710.00	0.06
625	002126	银轮股份	2,000	75,600.00	0.06
626	002123	梦网科技	6,200	75,392.00	0.06
626	603136	天目湖	6,400	75,392.00	0.06
627	300470	中密控股	2,000	75,200.00	0.06
628	002911	佛燃能源	6,200	75,144.00	0.06
629	002372	伟星新材	7,200	75,096.00	0.06
630	605111	新洁能	2,100	75,033.00	0.06
631	000519	中兵红箭	4,100	74,661.00	0.06
632	600827	百联股份	8,300	74,617.00	0.06
633	600745	闻泰科技	2,000	74,560.00	0.06
634	002402	和而泰	1,900	74,328.00	0.06

635	600518	康美药业	38,900	74,299.00	0.06
636	002500	山西证券	12,400	74,276.00	0.06
637	300876	蒙泰高新	2,100	74,067.00	0.06
638	002405	四维图新	8,200	73,882.00	0.06
639	600771	广誉远	4,100	73,718.00	0.06
640	600618	氯碱化工	6,200	73,656.00	0.06
641	000410	沈阳机床	10,300	73,645.00	0.06
642	603456	九洲药业	4,100	73,390.00	0.06
643	600316	洪都航空	2,100	73,311.00	0.06
644	300535	达威股份	4,100	73,226.00	0.06
645	601860	紫金银行	26,500	73,140.00	0.06
646	000848	承德露露	8,600	73,100.00	0.06
647	002031	巨轮智能	9,300	73,098.00	0.06
648	603369	今世缘	2,100	73,038.00	0.06
649	600399	抚顺特钢	12,500	73,000.00	0.06
650	000723	美锦能源	15,500	72,850.00	0.06
651	600810	神马股份	8,100	72,819.00	0.06
652	002648	卫星化学	4,100	72,488.00	0.06
653	002385	大北农	18,100	72,400.00	0.06
654	600963	岳阳林纸	15,500	72,385.00	0.06
655	600325	华发股份	17,100	72,162.00	0.06
656	002458	益生股份	8,600	72,068.00	0.06
657	002226	江南化工	12,400	72,044.00	0.06
658	000722	湖南发展	6,100	71,980.00	0.06
659	601788	光大证券	4,100	71,955.00	0.06
660	300298	三诺生物	4,200	71,862.00	0.06
661	600868	梅雁吉祥	21,500	71,810.00	0.06
662	000539	粤电力 A	16,200	71,604.00	0.06
663	002444	巨星科技	2,100	71,442.00	0.06
664	600027	华电国际	14,400	71,424.00	0.06
665	688505	复旦张江	8,600	71,380.00	0.06
666	300628	亿联网络	2,000	71,300.00	0.06
667	002179	中航光电	2,000	70,880.00	0.06
668	002441	众业达	7,500	70,500.00	0.06
669	301088	戎美股份	4,100	70,315.00	0.06
670	002583	海能达	6,200	70,184.00	0.06
670	002739	万达电影	6,200	70,184.00	0.06
671	000415	渤海租赁	17,200	69,660.00	0.06
672	600521	华海药业	4,100	69,577.00	0.06
673	002186	全聚德	5,900	69,502.00	0.06
674	002670	国盛证券	4,100	69,044.00	0.06
675	300375	鹏翎股份	13,100	68,906.00	0.06
676	300987	川网传媒	4,100	68,880.00	0.06

676	600967	内蒙一机	4,100	68,880.00	0.06
677	002360	同德化工	14,200	68,728.00	0.06
678	600906	财达证券	10,300	68,701.00	0.06
679	600369	西南证券	15,300	68,544.00	0.06
680	600495	晋西车轴	14,300	68,354.00	0.06
681	301559	中集环科	4,300	68,327.00	0.06
682	002382	蓝帆医疗	12,200	68,320.00	0.06
683	600155	华创云信	10,300	68,186.00	0.06
684	600170	上海建工	25,700	68,105.00	0.06
685	300829	金丹科技	4,100	68,019.00	0.06
686	002299	圣农发展	4,100	67,814.00	0.06
687	002312	川发龙蟒	6,200	67,766.00	0.06
688	002556	辉隆股份	11,200	67,648.00	0.06
689	600095	湘财股份	6,100	67,466.00	0.06
690	301373	凌玮科技	2,100	67,410.00	0.06
691	300854	中兰环保	4,000	67,360.00	0.06
692	002111	威海广泰	6,400	67,328.00	0.06
693	002960	青鸟消防	6,400	67,264.00	0.06
694	600388	龙净环保	4,100	66,871.00	0.06
695	600820	隧道股份	10,300	66,847.00	0.06
696	600161	天坛生物	4,080	66,667.20	0.06
697	002985	北摩高科	2,100	66,633.00	0.06
698	601995	中金公司	1,900	66,500.00	0.06
699	000301	东方盛虹	6,100	66,429.00	0.06
700	000756	新华制药	4,300	66,263.00	0.06
701	300181	佐力药业	4,100	66,256.00	0.06
702	002261	拓维信息	2,000	66,200.00	0.06
703	000567	海德股份	10,300	66,126.00	0.06
704	300459	汤姆猫	14,400	66,096.00	0.06
705	002044	美年健康	12,500	66,000.00	0.06
706	600927	永安期货	4,100	65,887.00	0.06
707	600283	钱江水利	7,200	65,880.00	0.06
708	601865	福莱特	4,200	65,814.00	0.06
709	600559	老白干酒	4,100	65,764.00	0.06
710	603578	三星新材	5,443	65,751.44	0.06
711	002003	伟星股份	6,200	65,720.00	0.06
712	300315	掌趣科技	13,300	65,702.00	0.06
713	002085	万丰奥威	4,100	65,641.00	0.06
714	600171	上海贝岭	2,100	65,625.00	0.06
715	300766	每日互动	2,000	65,540.00	0.06
716	600133	东湖高新	7,200	65,376.00	0.06
717	603609	禾丰股份	9,200	65,228.00	0.06
718	002635	安洁科技	4,700	65,142.00	0.06

719	600986	浙文互联	8,300	64,906.00	0.06
720	301115	联检科技	4,100	64,821.00	0.06
721	002864	盘龙药业	2,100	64,764.00	0.06
722	601881	中国银河	4,100	64,452.00	0.05
723	600378	昊华科技	2,000	63,920.00	0.05
724	300775	三角防务	2,100	63,840.00	0.05
725	600859	王府井	4,100	63,673.00	0.05
726	000090	天健集团	17,200	63,640.00	0.05
727	300253	卫宁健康	7,200	63,504.00	0.05
728	600435	北方导航	4,100	63,222.00	0.05
729	600481	双良节能	9,600	62,784.00	0.05
730	601890	亚星锚链	6,100	62,769.00	0.05
731	300196	长海股份	4,300	62,608.00	0.05
732	301339	通行宝	4,300	62,522.00	0.05
733	002327	富安娜	9,300	62,403.00	0.05
734	600398	海澜之家	10,300	62,315.00	0.05
735	002244	滨江集团	6,200	62,310.00	0.05
736	300638	广和通	2,100	62,244.00	0.05
737	601117	中国化学	8,200	61,746.00	0.05
738	603816	顾家家居	2,000	61,480.00	0.05
739	002832	比音勒芬	4,100	61,336.00	0.05
740	002705	新宝股份	4,300	61,318.00	0.05
741	000860	顺鑫农业	4,100	60,065.00	0.05
742	301212	联盛化学	2,000	59,920.00	0.05
743	301332	德尔玛	6,400	59,776.00	0.05
744	600685	中船防务	2,100	59,745.00	0.05
745	002154	报喜鸟	15,500	59,675.00	0.05
746	603063	禾望电气	1,800	59,526.00	0.05
747	002176	江特电机	6,100	59,414.00	0.05
748	601236	红塔证券	7,200	58,968.00	0.05
749	603613	国联股份	2,100	58,800.00	0.05
750	300355	蒙草生态	14,400	58,176.00	0.05
751	300908	仲景食品	2,100	58,170.00	0.05
752	000998	隆平高科	6,200	58,032.00	0.05
753	000011	深物业 A	6,400	57,664.00	0.05
754	300204	舒泰神	2,100	57,372.00	0.05
755	000729	燕京啤酒	5,100	57,273.00	0.05
756	601155	新城控股	4,100	57,195.00	0.05
757	603567	珍宝岛	6,400	57,152.00	0.05
758	300623	捷捷微电	2,100	57,057.00	0.05
759	601956	东贝集团	8,000	57,040.00	0.05
760	603806	福斯特	4,080	56,956.80	0.05
761	688728	格科微	3,806	56,861.64	0.05

762	300759	康龙化成	2,000	56,860.00	0.05
763	600197	伊力特	4,100	56,744.00	0.05
764	300284	苏交科	7,200	56,736.00	0.05
765	603882	金城医学	2,000	56,720.00	0.05
766	600985	淮北矿业	5,100	56,661.00	0.05
767	000997	新大陆	2,000	56,640.00	0.05
768	001227	兰州银行	24,400	56,608.00	0.05
769	002675	东诚药业	4,100	56,334.00	0.05
770	300327	中颖电子	2,000	56,060.00	0.05
771	300633	开立医疗	2,100	55,482.00	0.05
772	002607	中公教育	20,200	55,348.00	0.05
773	688327	云从科技	3,850	55,324.50	0.05
774	002563	森马服饰	10,200	55,284.00	0.05
775	301206	三元生物	2,100	55,209.00	0.05
776	601216	君正集团	11,400	54,948.00	0.05
777	600732	爱旭股份	4,100	54,940.00	0.05
778	600256	广汇能源	11,100	54,612.00	0.05
779	600729	重庆百货	2,100	54,600.00	0.05
780	300981	中红医疗	4,300	54,008.00	0.05
781	600886	国投电力	4,100	53,792.00	0.05
782	600548	深高速	6,100	53,680.00	0.05
783	600383	金地集团	17,500	53,550.00	0.05
784	001979	招商蛇口	6,100	52,704.00	0.04
785	000921	海信家电	2,100	52,101.00	0.04
786	300886	华业香料	2,000	51,820.00	0.04
787	000524	岭南控股	4,300	51,557.00	0.04
788	600422	昆药集团	4,100	51,496.00	0.04
789	300413	芒果超媒	2,100	51,282.00	0.04
790	600120	浙江东方	8,300	51,211.00	0.04
791	603733	仙鹤股份	2,100	50,757.00	0.04
792	600126	杭钢股份	6,200	50,592.00	0.04
793	002936	郑州银行	26,200	50,566.00	0.04
794	601519	大智慧	3,900	50,193.00	0.04
795	002270	华明装备	2,000	50,080.00	0.04
796	000786	北新建材	2,000	49,940.00	0.04
797	002867	周大生	4,100	49,938.00	0.04
798	002136	安纳达	4,100	49,774.00	0.04
799	600048	保利发展	8,000	48,800.00	0.04
800	603300	海南华铁	6,200	48,670.00	0.04
801	600326	西藏天路	4,300	47,429.00	0.04
802	600862	中航高科	2,000	47,260.00	0.04
803	002550	千红制药	6,000	47,160.00	0.04
804	000002	万科 A	10,100	46,965.00	0.04

805	300824	北鼎股份	4,100	46,371.00	0.04
806	001696	宗申动力	2,100	45,549.00	0.04
807	001333	光华股份	2,100	45,150.00	0.04
808	002791	坚朗五金	2,100	44,541.00	0.04
809	603535	嘉诚国际	4,128	44,210.88	0.04
810	600643	爱建集团	7,900	43,687.00	0.04
811	002568	百润股份	2,000	43,620.00	0.04
812	000099	中信海直	2,100	43,575.00	0.04
813	300077	国民技术	2,100	42,462.00	0.04
814	600110	诺德股份	5,900	41,831.00	0.04
815	300229	拓尔思	2,100	41,790.00	0.04
816	603712	七一二	2,000	41,540.00	0.04
817	601609	金田股份	3,800	41,040.00	0.03
818	600206	有研新材	2,000	40,660.00	0.03
819	000785	居然智家	13,200	38,544.00	0.03
820	300199	翰宇药业	2,100	37,590.00	0.03
821	600602	云赛智联	2,000	37,380.00	0.03
822	300738	奥飞数据	2,000	36,980.00	0.03
823	600129	太极集团	2,000	36,100.00	0.03
824	002488	金固股份	4,100	36,039.00	0.03
825	600137	浪莎股份	1,800	34,614.00	0.03

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688790	昂瑞微	319	37,345.33	0.03
2	688809	强一股份	32	6,505.92	0.01
3	688807	优迅股份	43	5,829.08	0.00
4	301687	新广益	88	4,786.32	0.00
5	301449	天溯计量	73	4,761.79	0.00
6	301667	纳百川	83	4,736.81	0.00
7	688805	健信超导	142	4,596.54	0.00
8	920185	贝特瑞	100	3,236.00	0.00
9	001369	双欣环保	183	2,358.87	0.00
10	603248	锡华科技	120	1,956.00	0.00
11	001396	誉帆科技	52	1,840.28	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	300750	宁德时代	4,390,014.40	3.50
2	000333	美的集团	1,718,032.00	1.37
3	300308	中际旭创	1,661,187.00	1.32
4	002594	比亚迪	1,440,878.00	1.15
5	300059	东方财富	1,360,655.00	1.08
6	300502	新易盛	1,166,621.00	0.93
7	000858	五粮液	1,156,878.00	0.92
8	002475	立讯精密	1,094,271.00	0.87
9	300760	迈瑞医疗	1,072,970.00	0.85
10	300274	阳光电源	1,060,060.00	0.84
11	300476	胜宏科技	964,560.00	0.77
12	000651	格力电器	902,238.00	0.72
13	300124	汇川技术	660,544.00	0.53
14	300394	天孚通信	606,675.00	0.48
15	000568	泸州老窖	597,009.00	0.48
16	601211	国泰海通	561,524.08	0.45
17	000063	中兴通讯	552,593.00	0.44
18	002714	牧原股份	524,364.40	0.42
19	002422	科伦药业	522,383.00	0.42
20	002384	东山精密	522,031.00	0.42

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,616,678.58	3.68
2	000333	美的集团	1,940,179.00	1.55
3	300308	中际旭创	1,658,923.60	1.32
4	002594	比亚迪	1,629,651.00	1.30
5	300059	东方财富	1,483,221.00	1.18
6	000858	五粮液	1,305,822.00	1.04
7	300502	新易盛	1,270,045.00	1.01
8	300760	迈瑞医疗	1,175,750.00	0.94
9	002475	立讯精密	1,129,316.00	0.90
10	000651	格力电器	1,120,224.00	0.89
11	300274	阳光电源	1,066,753.00	0.85
12	300476	胜宏科技	889,724.00	0.71
13	300124	汇川技术	733,981.00	0.58
14	300394	天孚通信	708,784.40	0.56
15	002714	牧原股份	671,423.00	0.53
16	000568	泸州老窖	664,742.00	0.53
17	000725	京东方 A	635,131.00	0.51
18	002415	海康威视	610,451.00	0.49
19	000063	中兴通讯	594,565.31	0.47

20	000001	平安银行	572,928.00	0.46
----	--------	------	------------	------

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	145,326,972.47
卖出股票收入（成交）总额	147,587,365.34

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，兴业银行（601166）在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会和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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	731,984.31
2	应收清算款	58,624.76
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	-
8	其他	-
9	合计	790,609.07

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688790	昂瑞微	37,345.33	0.03	新股锁定期内
2	688809	强一股份	6,505.92	0.01	新股锁定期内
3	688807	优迅股份	5,829.08	0.00	新股锁定期内
4	301687	新广益	4,786.32	0.00	新股锁定期内
5	301449	天溯计量	4,761.79	0.00	新股锁定期内

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1, 295	21, 745. 65	17, 024, 727. 00	60. 46	7, 614, 794. 00	27. 04	3, 521, 100. 00	12. 50

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信建投证券股份有限公司	1, 767, 886. 00	6. 28
2	国信证券股份有限公司	1, 737, 279. 00	6. 17
3	方正证券股份有限公司	1, 725, 900. 00	6. 13
4	国联民生证券股份有限公司	1, 500, 000. 00	5. 33
5	国泰海通证券股份有限公司	1, 454, 594. 00	5. 17
6	中信证券股份有限公司	1, 389, 502. 00	4. 93
7	招商证券股份有限公司	1, 070, 483. 00	3. 80
8	申万宏源证券有限公司	961, 094. 00	3. 41
9	广发证券股份有限公司	800, 182. 00	2. 84
10	中国银河证券股份有限公司	753, 861. 00	2. 68
11	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	3, 521, 100. 00	12. 50

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 10 月 30 日）	635,421,000.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	38,560,621.00
本报告期基金总申购份额	57,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	67,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,160,621.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

经公司董事会审议通过，田汉卿女士于 2025 年 4 月 30 日起不再担任公司副总经理。

经公司董事会审议通过，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司总经理，董事长贾波先生代为履行总经理职责。

经公司股东书面决定，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司董事。

经公司董事会审议通过，崔春女士于 2025 年 10 月 28 日起担任公司总经理，董事长贾波先生不再代任总经理职务。

经公司股东书面决定，崔春女士于 2025 年 10 月 28 日起担任公司董事。

2025 年 11 月 18 日，公司进行董事会、监事会换届选举，股东批准贾波先生、陆春光先生、Kirk Chester SWEENEY 先生、杨智雅女士、崔春女士担任公司第八届董事会董事，尹雷先生、田中荣治先生、孙茂竹先生、吴冠雄先生担任公司第八届董事会独立董事，刘晓冰先生、卢龙

威先生、刘声先生、杨宇先生担任公司第八届监事会监事。李晗女士不再担任公司独立董事，赵景云女士不再担任公司监事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门调查或处罚。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人未受监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	6	114,617,973.21	39.26	22,925.65	39.26	-

银河证券	2	59,883,063.33	20.51	11,978.27	20.51	-
方正证券	4	34,066,928.70	11.67	6,814.09	11.67	-
招商证券	2	31,275,751.09	10.71	6,256.78	10.72	-
国泰海通 证券	2	27,553,140.15	9.44	5,510.51	9.44	-
中航证券	1	18,775,299.98	6.43	3,755.61	6.43	-
广发证券	2	5,740,883.50	1.97	1,148.56	1.97	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当综合考虑下列因素：

(1) 具有相应的业务经营资格；

(2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；

(4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需

要；
(6) 被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1) 公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核

的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

(2)基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

(3)如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，基金租用券商交易单元新增申万宏源证券、国泰海通证券、中航证券。

4、国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	12,214.10	24.48	-	-	-	-
国泰海通证券	37,670.57	75.52	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 12 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范以教育机构退费为由诱导转账诈骗的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 12 月 09 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 12 月 02 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 11 月 22 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 11 月 20 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 10 月 29 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 09 月 23 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 09 月 23 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 09 月 05 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 06 月 04 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 24 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 14 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 10 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 01 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 01 月 03 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20250814-20250815;	5,400,287.00	99,418,463.00	103,050,864.00	1,767,886.00	6.28
	2	20250311-20250324;20250408-20250415;	6,675,340.00	2,275,800.00	8,907,236.00	43,904.00	0.16

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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 3 月 31 日