

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 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

送出日期：2026 年 8 月 29 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
7.6 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	69

7.7 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	69
7.8 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	70
7.9 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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	70
§ 8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
8.3 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	71
§ 9 开放式基金份额变动	72
§ 10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
10.2 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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	73
10.8 其他重大事件	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	77
11.1 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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 2000ETF
场内简称	中证 2000（扩位证券简称：中证 2000ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	563300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 6 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	2,116,174,000.00 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 9 月 14 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	1、股票（含存托凭证）的投资策略 本基金主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。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。 为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素，决定是否采用完全复制法的策略。完全复制法指完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。若本基金决定修改复制方法，将在更换复制方法前按规定履行适当程序并公告。 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。 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。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	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。 本基金属于股票型基金中的指数型基金，跟踪中证 2000 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。
--	--

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	康珂	张姗
	联系电话	021-38601777	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	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告置备地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	599,168,924.78
本期利润	554,845,552.41
加权平均基金份额本期利润	0.2082
本期加权平均净值利润率	13.67%
本期基金份额净值增长率	17.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,280,437,798.20
期末可供分配基金份额利润	0.6051
期末基金资产净值	3,396,611,798.20
期末基金份额净值	1.6051

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	60.51%

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。

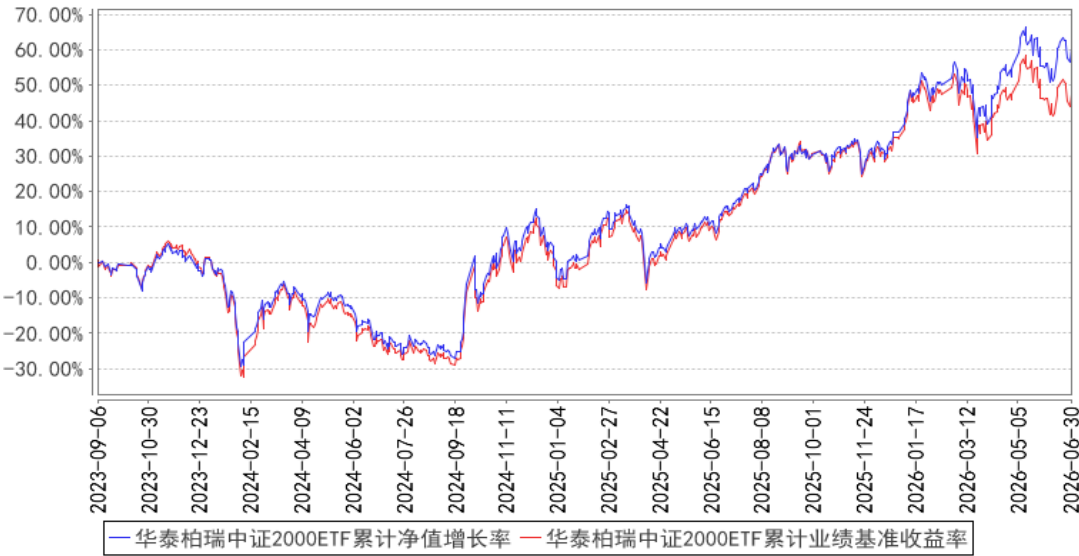
3.2 基金净值表现

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	13.68%	1.62%	7.78%	1.62%	5.90%	0.00%
过去六个月	17.51%	1.66%	9.10%	1.68%	8.41%	-0.02%
过去一年	38.86%	1.40%	29.14%	1.42%	9.72%	-0.02%
自基金合同生效起至今	60.51%	1.84%	47.46%	1.91%	13.05%	-0.07%

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2000ETF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 9 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日。

§ 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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 201 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	2026 年 2 月 25 日	7 年	理学硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
柳军	副总经理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 6 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、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理，兼任华泰盈科资产管

					理有限公司证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（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。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 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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。
李沐阳	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 6 日	-	8 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 4 月任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 2 月任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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 4 月至 2025 年 10 月任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。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、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发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 10 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发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞中证 2000 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。2024 年 1 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 2 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 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。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 5 月至 2026 年 5 月任华泰柏瑞恒生消费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。2025 年 5 月起任华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月起任华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

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《证券投资基金法》等有关法律法规及本基金的基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 11 次，是指数或量化投资组合因投资策略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

2026 年上半年，中证 2000 指数在 A 股极致风格分化与美以伊冲突、霍尔木兹危机的外部扰动交织中，走出“年初冲高—3 月急调—5 月再探底—6 月企稳反弹”的震荡行情，呈现典型小微盘高波动特征。1—2 月流动性宽松与“专精特新”预期推动资金沿市值下沉，指数跟随微盘活跃；3 月美以伊冲突爆发、全球风险偏好降温，小微盘首当其冲回调；5 月大盘科技主线虹吸资金、纯题材小票监管收紧，指数二次探底；6 月美伊临时停火、中报预喜与政策扶持预期升温，专精特新小微企企稳反弹，完成估值探底与筹码交换。

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 1.6051 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.51%，业绩比较基准收益率为 9.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中证 2000ETF 表现取决于“宽货币持续性”与“小微盘风格拥挤度”的博弈，美伊冲突是否再度升级是核心外生变量。积极因素在于稳健偏松流动性、中小企业扶持政策及中报盈利底修复支撑估值安全垫；若美伊谈判破裂、海峡通航受限引发油价与美元同向上行，全球风险

偏好收缩将率先冲击高 Beta 小微盘，放大回撤。风险亦来自市场风格切向科技、大盘价值或红利、异常炒作监管加码及中报低于预期引发分化踩踏。整体看小微盘长期占优基础未完全破坏，但需严控地缘升级与风格逆转带来的高波动。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	48,598,236.38	36,060,885.34
结算备付金		31,331,923.21	15,880,029.21
存出保证金		3,413,596.58	2,669,325.64
交易性金融资产	6.4.7.2	3,313,484,470.38	2,628,290,618.47
其中：股票投资		3,313,259,447.70	2,627,394,535.99
基金投资		-	-
债券投资		225,022.68	896,082.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		41,466,044.82	8,348,379.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		3,438,354,764.00	2,691,249,238.26
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		7,255,765.85	142,541.93

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	200,763.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,471,921.92	1,103,257.11
应付托管费		294,384.36	220,651.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.74	5.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	32,720,890.93	14,222,621.37
负债合计		41,742,965.80	15,889,840.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,116,174,000.00	1,958,674,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,280,437,798.20	716,685,397.97
净资产合计		3,396,611,798.20	2,675,359,397.97
负债和净资产总计		3,438,354,764.00	2,691,249,238.26

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6051 元，基金份额总额 2,116,174,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		567,205,811.59	514,652,146.54
1. 利息收入		143,098.54	144,630.14
其中：存款利息收入	6.4.7.13	143,098.54	144,630.14
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）		595,458,396.01	324,293,803.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	576,438,250.84	311,621,789.65
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	1,737,032.15	429,160.51
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,283,113.02	12,242,853.29
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）	6.4.7.20	-44,323,372.37	178,228,227.99
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	15,927,689.41	11,985,484.96
减：二、营业总支出		12,360,259.18	8,053,040.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,143,706.89	6,542,842.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,028,741.37	1,308,568.52
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.95	0.27
8. 其他费用	6.4.7.23	187,809.97	201,628.91
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		554,845,552.41	506,599,106.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		554,845,552.41	506,599,106.13
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		554,845,552.41	506,599,106.13

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	1,958,674,000.00	-	716,685,397.97	2,675,359,397.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,958,674,000.00	-	716,685,397.97	2,675,359,397.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	157,500,000.00	-	563,752,400.23	721,252,400.23
（一）、综合收益总额	-	-	554,845,552.41	554,845,552.41
（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）	157,500,000.00	-	8,906,847.82	166,406,847.82
其中：1. 基金申购款	7,702,500,000.00	-	4,030,013,441.75	11,732,513,441.75
2. 基金赎回款	-7,545,000,000.00	-	-4,021,106,593.93	-11,566,106,593.93
（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	2,116,174,000.00	-	1,280,437,798.20	3,396,611,798.20
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	2,883,674,000.00	-	45,378,841.85	2,929,052,841.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,883,674,000.00	-	45,378,841.85	2,929,052,841.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,167,500,000.00	-	222,142,354.37	-945,357,645.63
(一)、综合收益总额	-	-	506,599,106.13	506,599,106.13
(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)	-1,167,500,000.00	-	-284,456,751.76	-1,451,956,751.76
其中：1. 基金申购款	8,537,500,000.00	-	429,234,576.05	8,966,734,576.05
2. 基金赎回款	-9,705,000,000.00	-	-713,691,327.81	-10,418,691,327.81
(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	1,716,174,000.00	-	267,521,196.22	1,983,695,196.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

崔春

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 2000 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]1940 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 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 2000 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 588,674,000.00 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 0459 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 588,674,000.00 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]210 号核准,本基金 588,674,000.00 份基金份额于 2023 年 9 月 14 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 2000 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 2000 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 2000 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 2000ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 2000ETF 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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[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》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。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交易，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。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税。

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 日前取得的基金、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基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	48,598,236.38
等于：本金	48,591,591.43
加：应计利息	6,644.95
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	48,598,236.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,284,272,529.61	-	3,313,259,447.70	28,986,918.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	225,000.00	22.68	225,022.68	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	225,000.00	22.68	225,022.68	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,284,497,529.61	22.68	3,313,484,470.38	28,986,918.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	—

待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	2,418,488.41
其中：交易所市场	2,418,488.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,136.54
应退退补款	30,198,265.98
合计	32,720,890.93

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,958,674,000.00	1,958,674,000.00
本期申购	7,702,500,000.00	7,702,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-7,545,000,000.00	-7,545,000,000.00
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	2,116,174,000.00	2,116,174,000.00

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。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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	1,324,065,996.65	-607,380,598.68	716,685,397.97
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	1,324,065,996.65	-607,380,598.68	716,685,397.97
本期利润	599,168,924.78	-44,323,372.37	554,845,552.41
本期基金份额交易产生的变动数	-15,748,317.79	24,655,165.61	8,906,847.82
其中：基金申购款	6,013,367,724.54	-1,983,354,282.79	4,030,013,441.75
基金赎回款	-6,029,116,042.33	2,008,009,448.40	-4,021,106,593.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,907,486,603.64	-627,048,805.44	1,280,437,798.20

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	103,947.48
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	33,877.00
其他	5,274.06
合计	143,098.54

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	425,990,621.12
股票投资收益——赎回差价收入	150,447,629.72
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	576,438,250.84

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,988,177,340.74
减：卖出股票成本总额	9,551,839,686.60
减：交易费用	10,347,033.02
买卖股票差价收入	425,990,621.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	11,566,106,593.93
减：现金支付赎回款总额	7,578,164,191.93
减：赎回股票成本总额	3,837,494,772.28
减：交易费用	-
赎回差价收入	150,447,629.72

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	269.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,736,762.50
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	1,737,032.15

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,214,868.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,477,600.00
减：应计利息总额	337.40
减：交易费用	168.44
买卖债券差价收入	1,736,762.50

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,283,113.02
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	17,283,113.02

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-44,316,535.07
股票投资	-44,316,535.07
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	-
权证投资	-
3. 其他	-6,837.30
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-44,323,372.37

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	15,927,689.41
合计	15,927,689.41

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。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	59,507.37
IOPV 计算发布费	9,916.99
银行划款手续费	24,166.06

合计	187,809.97
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“中证 2000 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	5,605,735,766.03	27.32	3,897,296,423.33	27.63

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	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 成交总额的比例 (%)
华泰证券	813,585.68	19.30	—	—

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30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	1,121,250.64	27.78	210,921.91	8.72
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30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	779,570.45	27.63	779,570.45	58.37

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》，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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,143,706.89	6,542,842.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	575,714.66	248,163.67
应支付基金管理人的净管理费	9,567,992.23	6,294,679.04

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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,028,741.37	1,308,568.52

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：

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固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。

6.4.10.5.2 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	26,680,000.00	1.2608	25,117,100.00	1.2824
华泰证券股份有限公司	7,513,149.00	0.3550	8,018,260.00	0.4094

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。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	48,598,236.38	103,947.48	40,982,336.74	103,458.96

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。

6.4.10.7 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	127113	长高转债	优先配售	5,679	567,900.00
华泰联合证券	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	钧威电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合证券	113694	清源转债	配售	2,610	261,000.00
华泰联合证券	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

				内						
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高	2026	6 个月	新	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

	特电子	年 6 月 2 日		股 锁 定 期 内						
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

	展	日		定期内						
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688308	欧科亿	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	96.45	155.08	30,000	2,893,500.00	4,652,400.00	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-

				内						
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月以上	新股锁定期内	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	新股锁定期内	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月以上	新股锁定期内	114.28	676.94	9,647	1,102,459.16	6,530,440.18	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	新股锁定期内	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有	2026	6 个月	新	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

	研复材	年 4 月 1 日		股 锁 定 期 内						
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113703	翔 26 转债	2026 年 6 月 8 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.01	2,250	225,000.00	225,022.68	-

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。

6.4.12.2 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	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300332	天壕能源	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	4.30	2026 年 7 月 9 日	4.64	742,900	3,396,194.76	3,194,470.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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同责任，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 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01% (2025 年 12 月 31 日：0.03%)。

6.4.13.3 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 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 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“期末本基金持有的流通受限证券”。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%。于本报告期末，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30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	48,598,236.38	-	-	-	-	-	48,598,236.38
结算备付金	31,331,923.21	-	-	-	-	-	31,331,923.21
存出保证金	3,413,596.58	-	-	-	-	-	3,413,596.58
交易性金融资产	-	-	-	-	225,022.68	3,313,259,447.70	3,313,484,470.38
应收清算款	-	-	-	-	-	41,466,044.82	41,466,044.82
其他资产	-	-	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	83,343,756.17	-	-	-	225,022.68	3,354,785,985.15	3,438,354,764.00
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	7,255,765.85	7,255,765.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,471,921.92	1,471,921.92
应付托管费	-	-	-	-	-	294,384.36	294,384.36
应交税费	-	-	-	-	-	2.74	2.74
其他负债	-	-	-	-	-	32,720,890.93	32,720,890.93
负债总计	-	-	-	-	-	41,742,965.80	41,742,965.80
利率敏感度缺口	83,343,756.17	-	-	-	225,022.68	3,313,043,019.35	3,396,611,798.20
上年度末 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	36,060,885.34	-	-	-	-	-	36,060,885.34
结算备付金	15,880,029.21	-	-	-	-	-	15,880,029.21

存出保证金	2,669,325.64	-	-	-	-	-	2,669,325.64
交易性金融资产	-	-	-	-	896,082.48	2,627,394,535.99	2,628,290,618.47
应收清算款	-	-	-	-	-	8,348,379.60	8,348,379.60
资产总计	54,610,240.19	-	-	-	896,082.48	2,635,742,915.59	2,691,249,238.26
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	142,541.93	142,541.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,103,257.11	1,103,257.11
应付托管费	-	-	-	-	-	220,651.42	220,651.42
应付清算款	-	-	-	-	-	200,763.16	200,763.16
应交税费	-	-	-	-	-	5.30	5.30
其他负债	-	-	-	-	-	14,222,621.37	14,222,621.37
负债总计	-	-	-	-	-	15,889,840.29	15,889,840.29
利率敏感度缺口	54,610,240.19	-	-	-	896,082.48	2,619,853,075.30	2,675,359,397.97

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%(2025 年 12 月 31 日：0.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	3,313,259,447.70	97.55	2,627,394,535.99	98.21
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	-7,255,765.85	-0.21	-142,541.93	-0.01
合计	3,306,003,681.85	97.33	2,627,251,994.06	98.20

注：其他包含可退替代款。

6.4.13.4.3.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	162,511,094.50	127,598,932.24
	业绩比较基准下降 5%	-162,511,094.50	-127,598,932.24

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	3,292,251,749.28	2,617,621,914.76
第二层次	4,269,784.12	3,488,514.48
第三层次	16,962,936.98	7,180,189.23
合计	3,313,484,470.38	2,628,290,618.47

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 11,732,513,441.75 元（2025 年度：17,585,114,434.90 元），其中包括以股票支付的申购款 3,581,629,577.41 元和以现金支付的申购款 8,150,883,864.34 元（2025 年度：其中包括以股票支付的申购款 5,207,072,634.02 元和以现金支付的申购款 12,378,041,800.88 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	3,313,259,447.70	96.36
	其中：股票	3,313,259,447.70	96.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	225,022.68	0.01
	其中：债券	225,022.68	0.01
	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	79,930,159.59	2.32
8	其他各项资产	44,940,134.03	1.31
9	合计	3,438,354,764.00	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	18,170,006.00	0.53
B	采矿业	23,742,890.74	0.70
C	制造业	2,528,250,634.67	74.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,272,136.98	1.48
E	建筑业	34,947,484.00	1.03
F	批发和零售业	131,800,927.32	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	38,832,986.55	1.14
H	住宿和餐饮业	5,442,197.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,387,478.60	6.99
J	金融业	5,028,662.52	0.15
K	房地产业	45,258,732.42	1.33
L	租赁和商务服务业	29,644,743.40	0.87
M	科学研究和技术服务业	79,740,292.04	2.35

N	水利、环境和公共设施管理业	33,179,316.99	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	3,185,295.00	0.09
Q	卫生和社会工作	3,152,822.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	23,810,044.40	0.70
S	综合	2,453,877.00	0.07
	合计	3,294,300,527.63	96.99

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 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	36,149.82	0.00
C	制造业	18,070,895.35	0.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.03
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
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	—	—
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	18,958,920.07	0.56

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 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。

7.3 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

7.3.1 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	300835	龙磁科技	169,000	38,783,810.00	1.14
2	603186	华正新材	158,700	35,755,110.00	1.05
3	688233	神工股份	161,797	34,692,512.74	1.02
4	688059	华锐精密	166,709	33,293,454.39	0.98
5	688359	三孚新科	162,237	32,194,310.28	0.95
6	688416	恒烁股份	214,415	30,018,100.00	0.88
7	300843	胜蓝股份	169,200	26,437,500.00	0.78
8	688028	沃尔德	165,502	25,796,796.74	0.76
9	301021	英诺激光	169,000	20,601,100.00	0.61
10	300489	光智科技	65,600	20,463,920.00	0.60
11	688258	卓易信息	165,037	19,563,485.98	0.58
12	688222	成都先导	585,165	18,789,648.15	0.55
13	300201	海伦哲	844,600	17,795,722.00	0.52
14	688428	诺诚健华	580,235	16,519,290.45	0.49
15	002297	博云新材	565,417	16,391,438.83	0.48
16	000510	新金路	636,500	15,810,660.00	0.47
17	688401	路维光电	164,114	15,751,661.72	0.46
18	002552	宝鼎科技	254,600	15,530,600.00	0.46
19	002803	吉宏股份	591,200	15,276,608.00	0.45
20	002787	华源控股	466,800	15,030,960.00	0.44
21	688035	德邦科技	162,099	14,880,688.20	0.44
22	688663	新风光	166,125	14,695,417.50	0.43
23	600367	红星发展	229,500	14,442,435.00	0.43
24	301338	凯格精机	84,240	13,721,853.60	0.40
25	688202	美迪西	166,642	13,449,675.82	0.40
26	301128	强瑞技术	84,572	13,184,774.80	0.39
27	688518	联赢激光	415,998	12,854,338.20	0.38
28	300483	首华燃气	724,162	12,730,767.96	0.37
29	301307	美利信	168,900	12,716,481.00	0.37
30	300905	宝丽迪	250,400	12,670,240.00	0.37
31	300938	信测标准	253,318	12,635,501.84	0.37
32	300959	线上线下	83,900	12,401,259.00	0.37
33	002169	智光电气	844,400	12,362,016.00	0.36
34	301349	信德新材	166,800	12,276,480.00	0.36
35	002975	博杰股份	85,310	12,114,020.00	0.36
36	605289	罗曼股份	83,020	12,037,900.00	0.35

37	603618	杭电股份	240,996	12,020,880.48	0.35
38	300331	苏大维格	168,900	12,010,479.00	0.35
39	300656	民德电子	313,900	11,956,451.00	0.35
40	301603	乔锋智能	83,000	11,935,400.00	0.35
41	301326	捷邦科技	84,500	11,776,765.00	0.35
42	688049	炬芯科技	250,428	11,747,577.48	0.35
43	002741	光华科技	326,200	11,658,388.00	0.34
44	301382	蜂助手	253,400	11,656,400.00	0.34
45	688103	国力电子	156,640	11,655,582.40	0.34
46	301093	华兰股份	84,400	11,447,172.00	0.34
47	301580	爱迪特	174,100	11,199,853.00	0.33
48	603936	博敏电子	417,000	11,138,070.00	0.33
49	301248	杰创智能	132,600	11,129,118.00	0.33
50	603626	科森科技	585,037	10,823,184.50	0.32
51	301393	昊帆生物	161,900	10,486,263.00	0.31
52	603507	振江股份	318,000	10,459,020.00	0.31
53	301285	鸿日达	94,200	10,393,086.00	0.31
54	300619	金银河	329,820	10,260,700.20	0.30
55	688079	美迪凯	332,545	10,225,758.75	0.30
56	301123	奕东电子	84,600	10,212,912.00	0.30
57	002971	和远气体	163,200	10,118,400.00	0.30
58	688601	力芯微	165,862	10,042,944.10	0.30
59	300909	汇创达	169,100	9,845,002.00	0.29
60	301162	国能日新	224,764	9,833,425.00	0.29
61	300499	高澜股份	253,500	9,810,450.00	0.29
62	300943	春晖智控	216,800	9,745,160.00	0.29
63	600230	沧州大化	743,200	9,676,464.00	0.28
64	603738	泰晶科技	160,845	9,658,742.25	0.28
65	001314	亿道信息	156,100	9,646,980.00	0.28
66	000949	新乡化纤	1,520,100	9,637,434.00	0.28
67	688550	瑞联新材	166,281	9,619,355.85	0.28
68	300903	科翔股份	94,400	9,563,664.00	0.28
69	688173	希荻微	498,956	9,550,017.84	0.28
70	300709	精研科技	169,000	9,506,250.00	0.28
71	301566	达利凯普	254,600	9,440,568.00	0.28
72	002885	京泉华	228,500	9,336,510.00	0.27
73	000823	超声电子	360,663	9,251,005.95	0.27
74	002805	丰元股份	316,100	9,037,299.00	0.27
75	300461	田中精机	243,500	9,019,240.00	0.27
76	605058	澳弘电子	245,800	8,888,128.00	0.26
77	301132	满坤科技	168,700	8,860,124.00	0.26
78	300302	同有科技	169,000	8,647,730.00	0.25
79	600397	江钨装备	315,200	8,582,896.00	0.25

80	300617	安靠智电	158,700	8,409,513.00	0.25
81	603867	新化股份	250,100	8,375,849.00	0.25
82	000920	沃顿科技	506,100	8,330,406.00	0.25
83	000782	恒申新材	1,010,500	8,164,840.00	0.24
84	301099	雅创电子	84,112	8,032,696.00	0.24
85	301529	福赛科技	83,200	8,017,152.00	0.24
86	605389	长龄液压	82,340	7,904,640.00	0.23
87	301188	力诺药包	117,500	7,860,750.00	0.23
88	001212	中旗新材	164,700	7,803,486.00	0.23
89	300531	优博讯	506,900	7,679,535.00	0.23
90	603078	江化微	154,500	7,635,390.00	0.22
91	301080	百普赛斯	158,550	7,610,400.00	0.22
92	600590	泰豪科技	751,700	7,592,170.00	0.22
93	002785	万里石	168,900	7,483,959.00	0.22
94	300842	帝科股份	83,200	7,418,944.00	0.22
95	000036	华联控股	1,690,100	7,385,737.00	0.22
96	688319	欧林生物	165,872	7,295,050.56	0.21
97	300706	阿石创	84,100	7,262,035.00	0.21
98	002669	康达新材	422,500	7,220,525.00	0.21
99	300420	五洋自控	759,700	7,186,762.00	0.21
100	688226	威腾电气	166,588	7,134,964.04	0.21
101	300745	欣锐科技	168,800	7,126,736.00	0.21
102	688135	利扬芯片	166,999	7,027,317.92	0.21
103	002164	宁波东力	590,700	6,970,260.00	0.21
104	002943	宇晶股份	157,250	6,955,167.50	0.20
105	603977	国泰集团	417,540	6,893,585.40	0.20
106	300840	酷特智能	334,100	6,892,483.00	0.20
107	688179	阿拉丁	248,669	6,890,617.99	0.20
108	002796	世嘉科技	168,800	6,883,664.00	0.20
109	688733	壹石通	166,270	6,875,264.50	0.20
110	000593	德龙汇能	319,881	6,839,055.78	0.20
111	300435	中泰股份	252,400	6,832,468.00	0.20
112	688320	禾川科技	164,635	6,824,120.75	0.20
113	300480	光力科技	159,800	6,820,264.00	0.20
114	301302	华如科技	253,300	6,818,836.00	0.20
115	002935	天奥电子	310,180	6,805,349.20	0.20
116	300648	星云股份	154,500	6,677,490.00	0.20
117	605228	神通科技	495,100	6,649,193.00	0.20
118	300696	爱乐达	253,300	6,593,399.00	0.19
119	603032	德新科技	243,400	6,547,460.00	0.19
120	300900	广联航空	168,700	6,506,759.00	0.19
121	300491	通合科技	168,800	6,446,472.00	0.19
122	301172	君逸数码	248,410	6,446,239.50	0.19

123	605133	嵘泰股份	163,540	6,438,569.80	0.19
124	300042	朗科科技	84,400	6,428,748.00	0.19
125	002283	天润工业	665,800	6,424,970.00	0.19
126	603558	健盛集团	577,200	6,401,148.00	0.19
127	300863	卡倍亿	83,300	6,383,279.00	0.19
128	688678	福立旺	262,958	6,355,694.86	0.19
129	002376	新北洋	1,097,500	6,310,625.00	0.19
130	002057	中钢天源	506,100	6,290,823.00	0.19
131	300299	富春股份	1,277,600	6,260,240.00	0.18
132	002348	高乐股份	591,300	6,232,302.00	0.18
133	300740	水羊股份	337,696	6,216,983.36	0.18
134	002728	特一药业	674,740	6,173,871.00	0.18
135	002392	北京利尔	759,900	6,132,393.00	0.18
136	300867	圣元环保	337,598	6,117,275.76	0.18
137	300681	英搏尔	213,700	6,116,094.00	0.18
138	000751	锌业股份	997,600	6,105,312.00	0.18
139	300643	万通智控	337,900	6,045,031.00	0.18
140	600513	联环药业	411,600	5,984,664.00	0.18
141	002593	日上集团	1,497,000	5,973,030.00	0.18
142	002829	星网宇达	338,182	5,938,475.92	0.17
143	002103	广博股份	1,004,900	5,898,763.00	0.17
144	002515	金字火腿	589,072	5,896,610.72	0.17
145	002685	华东重机	912,000	5,891,520.00	0.17
146	603701	德宏股份	267,457	5,878,704.86	0.17
147	605366	宏柏新材	450,500	5,870,015.00	0.17
148	002734	利民股份	337,500	5,794,875.00	0.17
149	002878	元隆雅图	501,200	5,788,860.00	0.17
150	300852	四会富仕	83,100	5,753,844.00	0.17
151	603275	众辰科技	151,100	5,752,377.00	0.17
152	002040	南 京 港	765,600	5,703,720.00	0.17
153	688277	天智航	333,452	5,702,029.20	0.17
154	300005	探路者	252,200	5,699,720.00	0.17
155	000700	模塑科技	382,400	5,644,224.00	0.17
156	600960	渤海汽车	1,396,100	5,626,283.00	0.17
157	002106	莱宝高科	314,900	5,517,048.00	0.16
158	003015	日久光电	421,700	5,494,751.00	0.16
159	003019	宸展光电	168,800	5,494,440.00	0.16
160	300264	佳创视讯	675,600	5,492,628.00	0.16
161	603969	银龙股份	751,003	5,459,791.81	0.16
162	600838	上海九百	751,900	5,376,085.00	0.16
163	300700	岱勒新材	252,340	5,369,795.20	0.16
164	603538	美诺华	164,600	5,357,730.00	0.16
165	002559	亚威股份	420,600	5,345,826.00	0.16

166	688435	英方软件	166,952	5,342,464.00	0.16
167	603223	恒通股份	408,600	5,332,230.00	0.16
168	603399	永杉锂业	237,100	5,330,008.00	0.16
169	002632	道明光学	590,600	5,321,306.00	0.16
170	300501	海顺新材	416,100	5,284,470.00	0.16
171	300890	翔丰华	158,700	5,264,079.00	0.15
172	002957	科瑞技术	95,600	5,242,704.00	0.15
173	300041	回天新材	336,200	5,224,548.00	0.15
174	000863	三湘印象	1,237,900	5,199,180.00	0.15
175	600191	华资实业	571,300	5,198,830.00	0.15
176	002725	跃岭股份	421,800	5,196,576.00	0.15
177	002448	中原内配	422,300	5,194,290.00	0.15
178	688716	中研股份	164,669	5,175,546.67	0.15
179	300473	德尔股份	168,700	5,128,480.00	0.15
180	603777	来伊份	329,300	5,114,029.00	0.15
181	300380	安硕信息	165,100	5,080,127.00	0.15
182	600203	福日电子	417,700	5,075,055.00	0.15
183	002590	万安科技	506,100	5,061,000.00	0.15
184	300858	科拓生物	331,800	5,040,042.00	0.15
185	301085	亚康股份	83,100	5,036,691.00	0.15
186	600318	新力金融	835,326	5,028,662.52	0.15
187	300647	超频三	842,800	5,014,660.00	0.15
188	300873	海晨股份	148,400	5,011,468.00	0.15
189	002824	和胜股份	143,655	4,967,589.90	0.15
190	002976	瑞玛精密	196,710	4,957,092.00	0.15
191	300606	金太阳	116,300	4,949,728.00	0.15
192	601116	三江购物	501,100	4,945,857.00	0.15
193	300731	科创新源	84,600	4,937,256.00	0.15
194	600962	国投中鲁	163,200	4,923,744.00	0.14
195	688148	芳源股份	573,839	4,923,538.62	0.14
196	002782	可立克	232,800	4,900,440.00	0.14
197	300486	东杰智能	228,700	4,882,745.00	0.14
198	002286	保龄宝	591,300	4,878,225.00	0.14
199	002970	锐明技术	90,900	4,856,787.00	0.14
200	000017	深中华 A	791,300	4,842,756.00	0.14
201	300399	天利科技	253,300	4,832,964.00	0.14
202	000919	金陵药业	828,800	4,831,904.00	0.14
203	301391	卡莱特	84,420	4,820,382.00	0.14
204	002301	齐心集团	666,300	4,817,349.00	0.14
205	301305	朗坤科技	168,900	4,817,028.00	0.14
206	002284	亚太股份	506,400	4,805,736.00	0.14
207	300572	安车检测	168,700	4,786,019.00	0.14
208	000798	中水渔业	675,500	4,769,030.00	0.14

209	300328	宜安科技	337,900	4,744,116.00	0.14
210	000554	泰山石油	843,500	4,732,035.00	0.14
211	600980	北矿科技	250,600	4,698,750.00	0.14
212	002902	铭普光磁	158,400	4,698,144.00	0.14
213	002919	名臣健康	245,312	4,658,474.88	0.14
214	605088	冠盛股份	164,600	4,638,428.00	0.14
215	002983	芯瑞达	167,347	4,632,164.96	0.14
216	002752	昇兴股份	830,000	4,581,600.00	0.13
217	600814	杭州解百	750,800	4,579,880.00	0.13
218	301260	格力博	337,400	4,558,274.00	0.13
219	002520	日发精机	658,500	4,550,235.00	0.13
220	301251	威尔高	84,700	4,512,816.00	0.13
221	002533	金杯电工	422,400	4,507,008.00	0.13
222	002132	恒星科技	828,800	4,483,808.00	0.13
223	603318	水发燃气	468,500	4,469,490.00	0.13
224	300056	中创环保	612,400	4,452,148.00	0.13
225	002708	光洋股份	337,400	4,450,306.00	0.13
226	603031	安孚科技	83,530	4,447,972.50	0.13
227	301379	天山电子	155,600	4,425,264.00	0.13
228	300424	航新科技	281,100	4,424,514.00	0.13
229	603811	诚意药业	583,940	4,391,228.80	0.13
230	300975	商络电子	84,300	4,362,525.00	0.13
231	603387	基蛋生物	576,293	4,356,775.08	0.13
232	603416	信捷电气	82,200	4,345,914.00	0.13
233	002455	百川股份	603,000	4,341,600.00	0.13
234	000819	岳阳兴长	382,300	4,331,459.00	0.13
235	300135	宝利国际	1,419,800	4,330,390.00	0.13
236	002474	榕基软件	759,321	4,328,129.70	0.13
237	605016	百龙创园	166,946	4,315,554.10	0.13
238	603855	华荣股份	249,000	4,315,170.00	0.13
239	002452	长高电气	337,400	4,308,598.00	0.13
240	603861	白云电器	332,000	4,286,120.00	0.13
241	603665	康隆达	166,800	4,271,748.00	0.13
242	002695	煌上煌	420,300	4,266,045.00	0.13
243	301280	珠城科技	84,120	4,253,948.40	0.13
244	300565	科信技术	417,500	4,250,150.00	0.13
245	002166	莱茵生物	675,600	4,242,768.00	0.12
246	002107	沃华医药	745,600	4,242,464.00	0.12
247	300986	志特新材	247,100	4,237,765.00	0.12
248	300563	神宇股份	147,700	4,193,203.00	0.12
249	603668	天马科技	329,800	4,175,268.00	0.12
250	300107	建新股份	742,900	4,160,240.00	0.12
251	300053	航宇微	252,500	4,153,625.00	0.12

252	603126	中材节能	658,600	4,149,180.00	0.12
253	001283	豪鹏科技	84,600	4,147,092.00	0.12
254	300018	中元股份	335,600	4,144,660.00	0.12
255	002255	海陆重工	420,900	4,133,238.00	0.12
256	002845	同兴达	251,000	4,116,400.00	0.12
257	603966	法兰泰克	503,644	4,104,698.60	0.12
258	002866	传艺科技	250,600	4,097,310.00	0.12
259	300504	天邑股份	252,800	4,077,664.00	0.12
260	603209	兴通股份	325,300	4,076,009.00	0.12
261	300569	天能重工	844,200	4,069,044.00	0.12
262	002735	王子新材	250,100	4,059,123.00	0.12
263	603611	诺力股份	250,500	4,055,595.00	0.12
264	300221	银禧科技	252,200	4,052,854.00	0.12
265	300263	隆华科技	248,500	4,050,550.00	0.12
266	300320	海达股份	420,800	4,014,432.00	0.12
267	002150	正泰电源	158,700	4,013,523.00	0.12
268	300227	光韵达	336,600	4,005,540.00	0.12
269	000822	山东海化	995,300	4,001,106.00	0.12
270	688510	航亚科技	166,987	3,987,649.56	0.12
271	600708	光明地产	1,240,900	3,983,289.00	0.12
272	301439	泓淋电力	253,300	3,981,876.00	0.12
273	603191	望变电气	250,700	3,958,553.00	0.12
274	301160	翔楼新材	84,816	3,956,666.40	0.12
275	603859	能科科技	82,300	3,948,754.00	0.12
276	300048	合康新能	844,300	3,942,881.00	0.12
277	601789	宁波建工	982,800	3,941,028.00	0.12
278	688512	慧智微	246,749	3,940,581.53	0.12
279	300086	康芝药业	665,800	3,928,220.00	0.12
280	300452	山河药辅	336,300	3,927,984.00	0.12
281	300238	冠昊生物	337,600	3,916,160.00	0.12
282	001288	运机集团	163,260	3,883,955.40	0.11
283	000905	厦门港务	499,400	3,875,344.00	0.11
284	002609	捷顺科技	506,200	3,857,244.00	0.11
285	300267	尔康制药	1,165,300	3,845,490.00	0.11
286	605277	新亚电子	201,720	3,844,783.20	0.11
287	000011	深物业 A	591,000	3,829,680.00	0.11
288	002772	众兴菌业	337,100	3,829,456.00	0.11
289	000925	众合科技	409,900	3,828,466.00	0.11
290	300505	川金诺	166,400	3,818,880.00	0.11
291	301257	普蕊斯	84,100	3,816,458.00	0.11
292	300032	金龙机电	1,001,500	3,805,700.00	0.11
293	301270	汉仪股份	148,120	3,803,721.60	0.11
294	301152	天力锂能	160,600	3,801,402.00	0.11

295	300571	平治信息	82,500	3,766,950.00	0.11
296	000655	金岭矿业	590,700	3,756,852.00	0.11
297	300434	金石亚药	334,500	3,756,435.00	0.11
298	301168	通灵股份	83,500	3,749,985.00	0.11
299	002628	成都路桥	699,700	3,743,395.00	0.11
300	300788	中信出版	166,400	3,739,008.00	0.11
301	605208	永茂泰	233,674	3,727,100.30	0.11
302	002394	联发股份	417,200	3,721,424.00	0.11
303	301299	卓创资讯	84,400	3,718,664.00	0.11
304	300507	苏奥传感	491,400	3,700,242.00	0.11
305	603380	易德龙	81,900	3,692,871.00	0.11
306	603285	键邦股份	82,400	3,692,344.00	0.11
307	300241	瑞丰光电	504,800	3,654,752.00	0.11
308	000965	天保基建	1,239,900	3,620,508.00	0.11
309	002418	康盛股份	918,300	3,618,102.00	0.11
310	600851	海欣股份	401,400	3,616,614.00	0.11
311	600251	冠农股份	417,600	3,608,064.00	0.11
312	300994	久祺股份	337,300	3,598,991.00	0.11
313	300545	联得装备	77,700	3,589,740.00	0.11
314	002576	通达动力	253,100	3,581,365.00	0.11
315	603200	上海洗霸	82,100	3,559,856.00	0.10
316	000922	佳电股份	253,800	3,543,048.00	0.10
317	003025	思进智能	251,000	3,534,080.00	0.10
318	002083	孚日股份	336,300	3,527,787.00	0.10
319	002956	西麦食品	169,480	3,518,404.80	0.10
320	000428	华天酒店	1,156,100	3,514,544.00	0.10
321	002860	星帅尔	240,100	3,503,059.00	0.10
322	300440	运达科技	164,200	3,502,386.00	0.10
323	002989	中天精装	102,706	3,492,004.00	0.10
324	300566	激智科技	94,400	3,488,080.00	0.10
325	300162	雷曼光电	252,400	3,485,644.00	0.10
326	002917	金奥博	328,200	3,459,228.00	0.10
327	605305	中际联合	82,500	3,458,400.00	0.10
328	002367	康力电梯	500,200	3,456,382.00	0.10
329	002915	中欣氟材	168,485	3,455,627.35	0.10
330	300921	南凌科技	169,160	3,435,639.60	0.10
331	002115	三维通信	332,400	3,423,720.00	0.10
332	300539	横河精密	167,900	3,420,123.00	0.10
333	600594	益佰制药	1,149,100	3,412,827.00	0.10
334	600785	新华百货	347,800	3,408,440.00	0.10
335	300148	天舟文化	1,095,900	3,408,249.00	0.10
336	000551	创元科技	164,900	3,401,887.00	0.10
337	600106	重庆路桥	742,200	3,399,276.00	0.10

338	002167	东方锆业	153,600	3,389,952.00	0.10
339	300193	佳士科技	416,100	3,387,054.00	0.10
340	603390	通达电气	322,300	3,364,812.00	0.10
341	600769	祥龙电业	163,000	3,343,130.00	0.10
342	002676	顺威股份	669,000	3,331,620.00	0.10
343	605299	舒华体育	247,000	3,297,450.00	0.10
344	002786	银宝山新	419,100	3,294,126.00	0.10
345	688207	格灵深瞳	163,561	3,287,576.10	0.10
346	600638	新黄浦	751,700	3,284,929.00	0.10
347	002358	森源电气	590,400	3,276,720.00	0.10
348	600727	鲁北化工	487,400	3,275,328.00	0.10
349	603165	荣晟环保	250,600	3,265,318.00	0.10
350	300389	艾比森	251,600	3,225,512.00	0.09
351	300400	劲拓股份	85,600	3,222,840.00	0.09
352	300217	东方电热	754,300	3,220,861.00	0.09
353	600571	信雅达	330,300	3,220,425.00	0.09
354	603050	科林电气	164,627	3,220,104.12	0.09
355	600400	红豆股份	978,500	3,219,265.00	0.09
356	603196	璞源材料	131,700	3,218,748.00	0.09
357	002527	新时达	250,400	3,212,632.00	0.09
358	002870	香山股份	83,200	3,206,528.00	0.09
359	603686	福龙马	247,900	3,202,868.00	0.09
360	002443	金洲管道	335,800	3,200,174.00	0.09
361	300332	天壕能源	742,900	3,194,470.00	0.09
362	688697	纽威数控	234,558	3,187,643.22	0.09
363	300099	尤洛卡	504,300	3,187,176.00	0.09
364	300230	永利股份	753,700	3,165,540.00	0.09
365	300560	中富通	165,700	3,156,585.00	0.09
366	300067	安诺其	581,500	3,151,730.00	0.09
367	301110	青木科技	83,200	3,149,952.00	0.09
368	002886	沃特股份	111,200	3,123,608.00	0.09
369	001215	千味央厨	84,400	3,114,360.00	0.09
370	605179	一鸣食品	246,900	3,103,533.00	0.09
371	600189	泉阳泉	411,890	3,101,531.70	0.09
372	688339	亿华通	165,715	3,098,870.50	0.09
373	301201	诚达药业	85,186	3,097,362.96	0.09
374	600336	澳柯玛	496,900	3,095,687.00	0.09
375	300790	宇瞳光学	118,480	3,093,512.80	0.09
376	002039	黔源电力	164,300	3,092,126.00	0.09
377	605598	上海港湾	80,100	3,078,243.00	0.09
378	300139	晓程科技	83,900	3,066,545.00	0.09
379	000652	泰达股份	899,000	3,065,590.00	0.09
380	300206	理邦仪器	250,300	3,061,169.00	0.09

381	000014	沙河股份	332,900	3,039,377.00	0.09
382	002206	海利得	587,700	3,038,409.00	0.09
383	002645	华宏科技	110,000	3,026,100.00	0.09
384	300584	海辰药业	83,500	3,025,205.00	0.09
385	000531	穗恒运 A	504,400	3,021,356.00	0.09
386	603015	弘讯科技	248,100	3,014,415.00	0.09
387	002386	天原股份	484,400	3,003,280.00	0.09
388	300365	恒华科技	652,300	2,987,534.00	0.09
389	601798	蓝科高新	412,400	2,985,776.00	0.09
390	002757	南兴股份	165,400	2,985,470.00	0.09
391	600496	精工钢构	959,600	2,974,760.00	0.09
392	002876	三利谱	84,200	2,964,682.00	0.09
393	002296	辉煌科技	332,600	2,953,488.00	0.09
394	301277	新天地	337,400	2,952,250.00	0.09
395	300291	百纳千成	609,000	2,941,470.00	0.09
396	300278	华昌达	757,400	2,938,712.00	0.09
397	000705	浙江震元	501,000	2,930,850.00	0.09
398	300511	雪榕生物	582,600	2,930,478.00	0.09
399	603617	君禾股份	411,300	2,928,456.00	0.09
400	300061	旗天科技	418,800	2,927,412.00	0.09
401	300304	云意电气	163,300	2,914,905.00	0.09
402	300448	浩云科技	504,931	2,908,402.56	0.09
403	600278	东方创业	494,000	2,904,720.00	0.09
404	002137	实益达	252,500	2,903,750.00	0.09
405	600108	亚盛集团	976,600	2,890,736.00	0.09
406	600576	祥源文旅	488,000	2,879,200.00	0.08
407	300952	恒辉安防	165,114	2,872,983.60	0.08
408	300662	科锐国际	168,500	2,861,130.00	0.08
409	300354	东华测试	84,200	2,852,696.00	0.08
410	600558	大西洋	576,859	2,849,683.46	0.08
411	002264	新华都	504,700	2,846,508.00	0.08
412	000421	南京公用	572,800	2,841,088.00	0.08
413	300404	博济医药	321,400	2,815,464.00	0.08
414	002398	垒知集团	748,000	2,805,000.00	0.08
415	300756	金马游乐	84,600	2,796,030.00	0.08
416	603373	安邦护卫	76,860	2,785,406.40	0.08
417	000501	武商集团	416,100	2,783,709.00	0.08
418	688299	长阳科技	166,322	2,779,240.62	0.08
419	601218	吉鑫科技	646,100	2,778,230.00	0.08
420	605056	咸亨国际	173,500	2,776,000.00	0.08
421	300542	新晨科技	250,100	2,771,108.00	0.08
422	002406	远东传动	421,000	2,761,760.00	0.08
423	301226	祥明智能	83,200	2,761,408.00	0.08

424	600551	时代出版	415,020	2,759,883.00	0.08
425	002769	普路通	421,700	2,753,701.00	0.08
426	001316	润贝航科	83,180	2,743,276.40	0.08
427	603703	盛洋科技	246,200	2,732,820.00	0.08
428	002135	东南网架	400,900	2,722,111.00	0.08
429	688687	凯因科技	165,887	2,705,616.97	0.08
430	300945	曼卡龙	249,000	2,696,670.00	0.08
431	600425	青松建化	822,700	2,690,229.00	0.08
432	603897	长城科技	82,400	2,674,704.00	0.08
433	002849	威星智能	157,900	2,671,668.00	0.08
434	300801	泰和科技	82,600	2,667,980.00	0.08
435	000936	华西股份	499,700	2,648,410.00	0.08
436	301149	隆华新材	249,700	2,641,826.00	0.08
437	688365	光云科技	167,022	2,633,936.94	0.08
438	603211	晋拓股份	74,100	2,631,291.00	0.08
439	601226	华电科工	413,300	2,628,588.00	0.08
440	000404	长虹华意	333,500	2,621,310.00	0.08
441	000701	厦门信达	590,400	2,615,472.00	0.08
442	600693	东百集团	333,500	2,614,640.00	0.08
443	002441	众业达	332,600	2,594,280.00	0.08
444	002235	安妮股份	334,100	2,589,275.00	0.08
445	603199	九华旅游	83,000	2,586,280.00	0.08
446	002641	公元股份	669,500	2,584,270.00	0.08
447	300219	鸿利智汇	247,200	2,578,296.00	0.08
448	300559	佳发教育	251,700	2,574,891.00	0.08
449	002587	奥拓电子	328,800	2,567,928.00	0.08
450	002562	兄弟科技	589,700	2,565,195.00	0.08
451	600829	人民同泰	329,300	2,555,368.00	0.08
452	002042	华孚时尚	749,300	2,555,113.00	0.08
453	603967	中创物流	246,400	2,550,240.00	0.08
454	603125	常青科技	77,500	2,537,350.00	0.07
455	603499	翔港科技	191,380	2,516,647.00	0.07
456	003020	立方制药	169,220	2,506,148.20	0.07
457	002788	鹭燕医药	249,700	2,504,491.00	0.07
458	300884	狄耐克	252,000	2,499,840.00	0.07
459	601588	北辰实业	1,561,700	2,498,720.00	0.07
460	688186	广大特材	164,825	2,497,098.75	0.07
461	000852	石化机械	503,260	2,496,169.60	0.07
462	002640	跨境通	828,800	2,494,688.00	0.07
463	002483	润邦股份	504,800	2,493,712.00	0.07
464	002730	电光科技	83,200	2,488,512.00	0.07
465	001207	联科科技	166,400	2,482,688.00	0.07
466	603222	济民健康	292,400	2,470,780.00	0.07

467	002438	江苏神通	165,200	2,466,436.00	0.07
468	300228	富瑞特装	333,100	2,464,940.00	0.07
469	000601	韶能股份	420,700	2,461,095.00	0.07
470	002322	理工能科	252,500	2,449,250.00	0.07
471	301122	采纳股份	83,200	2,446,912.00	0.07
472	603239	浙江仙通	165,100	2,445,131.00	0.07
473	002523	天桥起重	820,200	2,444,196.00	0.07
474	002476	新叶股份	502,800	2,443,608.00	0.07
475	600368	五洲交通	726,353	2,433,282.55	0.07
476	300160	秀强股份	583,500	2,433,195.00	0.07
477	002224	三力士	742,500	2,427,975.00	0.07
478	300174	元力股份	82,900	2,422,338.00	0.07
479	600742	富维股份	331,300	2,398,612.00	0.07
480	300541	先进数通	248,060	2,393,779.00	0.07
481	301119	正强股份	97,540	2,393,631.60	0.07
482	002454	松芝股份	499,847	2,389,268.66	0.07
483	603590	康辰药业	82,300	2,387,523.00	0.07
484	002225	濮耐股份	504,400	2,385,812.00	0.07
485	300824	北鼎股份	331,300	2,378,734.00	0.07
486	688410	山外山	164,669	2,364,646.84	0.07
487	300988	津荣天宇	151,220	2,363,568.60	0.07
488	000957	中通客车	252,500	2,363,400.00	0.07
489	000912	泸天化	736,200	2,363,202.00	0.07
490	600605	汇通能源	81,702	2,362,821.84	0.07
491	002187	广百股份	504,700	2,361,996.00	0.07
492	300105	龙源技术	333,500	2,357,845.00	0.07
493	603095	越剑智能	164,600	2,357,072.00	0.07
494	600846	同济科技	235,600	2,356,000.00	0.07
495	600630	龙头股份	241,800	2,355,132.00	0.07
496	002923	润都股份	248,300	2,348,918.00	0.07
497	600668	尖峰集团	322,000	2,347,380.00	0.07
498	002467	二六三	499,400	2,332,198.00	0.07
499	002765	蓝黛科技	333,400	2,320,464.00	0.07
500	002140	东华科技	252,900	2,319,093.00	0.07
501	603111	康尼机电	406,800	2,302,488.00	0.07
502	002997	瑞鹄模具	83,200	2,292,992.00	0.07
503	603767	中马传动	160,800	2,286,576.00	0.07
504	002232	启明信息	168,200	2,280,792.00	0.07
505	300138	晨光生物	252,400	2,271,600.00	0.07
506	002469	三维化学	396,100	2,265,692.00	0.07
507	688588	凌志软件	248,556	2,259,374.04	0.07
508	002393	力生制药	158,500	2,249,115.00	0.07
509	300829	金丹科技	163,700	2,247,601.00	0.07

510	300787	海能实业	245,200	2,236,224.00	0.07
511	600694	大商股份	168,304	2,226,661.92	0.07
512	002638	勤上股份	502,700	2,221,934.00	0.07
513	605007	五洲特纸	164,600	2,203,994.00	0.06
514	002940	昂利康	83,200	2,197,312.00	0.06
515	600824	益民集团	663,500	2,182,915.00	0.06
516	600721	百花医药	329,300	2,179,966.00	0.06
517	600288	大恒科技	163,700	2,177,210.00	0.06
518	002864	盘龙药业	84,100	2,169,780.00	0.06
519	002480	新筑股份	420,800	2,167,120.00	0.06
520	301111	粤万年青	83,200	2,153,216.00	0.06
521	300636	同和药业	336,300	2,142,231.00	0.06
522	300719	安达维尔	182,100	2,132,391.00	0.06
523	600784	鲁银投资	327,900	2,131,350.00	0.06
524	600293	三峡新材	743,742	2,127,102.12	0.06
525	300532	今天国际	340,000	2,118,200.00	0.06
526	688488	艾迪药业	164,669	2,115,996.65	0.06
527	000505	京粮控股	419,500	2,110,085.00	0.06
528	000520	凤凰航运	565,600	2,109,688.00	0.06
529	002037	保利联合	337,700	2,107,248.00	0.06
530	300786	国林科技	84,000	2,105,880.00	0.06
531	300758	七彩化学	167,100	2,097,105.00	0.06
532	603167	渤海轮渡	244,500	2,095,365.00	0.06
533	300310	宜通世纪	499,200	2,081,664.00	0.06
534	300683	海特生物	83,200	2,080,832.00	0.06
535	300494	盛天网络	245,900	2,072,937.00	0.06
536	002033	丽江股份	249,500	2,060,870.00	0.06
537	301060	兰卫医学	252,000	2,058,840.00	0.06
538	600758	辽宁能源	650,900	2,050,335.00	0.06
539	300011	鼎汉技术	336,600	2,046,528.00	0.06
540	600279	重庆港	560,600	2,046,190.00	0.06
541	000886	海南高速	500,300	2,041,224.00	0.06
542	300933	中辰股份	335,300	2,038,624.00	0.06
543	300375	鹏翎股份	496,900	2,037,290.00	0.06
544	002457	青龙管业	166,400	2,035,072.00	0.06
545	000900	现代投资	587,100	2,031,366.00	0.06
546	002196	方正电机	168,300	2,029,698.00	0.06
547	000862	银星能源	420,700	2,027,774.00	0.06
548	300962	中金辐照	161,000	2,012,500.00	0.06
549	301507	民生健康	165,700	1,993,371.00	0.06
550	603660	苏州科达	162,300	1,988,175.00	0.06
551	300589	江龙船艇	167,900	1,981,220.00	0.06
552	002363	隆基机械	329,000	1,980,580.00	0.06

553	301012	扬电科技	84,100	1,975,509.00	0.06
554	301181	标榜股份	85,230	1,972,222.20	0.06
555	300218	安利股份	164,900	1,962,310.00	0.06
556	002449	国星光电	252,500	1,956,875.00	0.06
557	603121	华培动力	166,500	1,956,375.00	0.06
558	002996	顺博合金	331,300	1,954,670.00	0.06
559	300629	新劲刚	90,900	1,950,714.00	0.06
560	600819	耀皮玻璃	305,600	1,949,728.00	0.06
561	600101	明星电力	246,980	1,948,672.20	0.06
562	300248	新开普	252,100	1,943,691.00	0.06
563	603187	海容冷链	165,000	1,895,850.00	0.06
564	300382	斯莱克	82,000	1,895,020.00	0.06
565	600351	亚宝药业	328,900	1,891,175.00	0.06
566	600822	上海物贸	248,500	1,891,085.00	0.06
567	688602	康鹏科技	238,978	1,883,146.64	0.06
568	300722	新余国科	84,200	1,877,660.00	0.06
569	301388	欣灵电气	80,300	1,872,596.00	0.06
570	301052	果麦文化	84,200	1,870,924.00	0.06
571	601956	东贝集团	404,500	1,868,790.00	0.06
572	603681	永冠新材	81,300	1,857,705.00	0.05
573	002337	赛象科技	418,200	1,852,626.00	0.05
574	605319	无锡振华	81,580	1,851,050.20	0.05
575	603217	元利科技	82,300	1,845,989.00	0.05
576	300247	融捷健康	501,400	1,840,138.00	0.05
577	600249	两面针	411,750	1,832,287.50	0.05
578	002328	新朋股份	248,800	1,826,192.00	0.05
579	300110	华仁药业	735,000	1,822,800.00	0.05
580	600503	华丽家族	914,242	1,819,341.58	0.05
581	603110	东方材料	78,500	1,818,845.00	0.05
582	600628	新世界	322,500	1,815,675.00	0.05
583	000607	华媒控股	589,400	1,809,458.00	0.05
584	300349	金卡智能	164,600	1,800,724.00	0.05
585	300465	高伟达	164,400	1,796,892.00	0.05
586	300239	东宝生物	336,800	1,795,144.00	0.05
587	688238	和元生物	330,522	1,791,429.24	0.05
588	600262	北方股份	89,900	1,779,121.00	0.05
589	002479	富春环保	419,600	1,766,516.00	0.05
590	688609	九联科技	160,425	1,766,279.25	0.05
591	300445	康斯特	84,300	1,755,126.00	0.05
592	002059	云南旅游	410,700	1,749,582.00	0.05
593	300292	吴通控股	321,800	1,744,156.00	0.05
594	002846	英联股份	164,620	1,743,325.80	0.05
595	600327	大东方	561,200	1,739,720.00	0.05

596	300534	陇神戎发	245,700	1,739,556.00	0.05
597	600405	动力源	383,744	1,734,522.88	0.05
598	300862	蓝盾光电	83,200	1,733,888.00	0.05
599	000850	华茂股份	493,800	1,733,238.00	0.05
600	002843	泰嘉股份	80,100	1,719,747.00	0.05
601	000931	中关村	418,200	1,718,802.00	0.05
602	002995	天地在线	96,900	1,713,192.00	0.05
603	600523	贵航股份	162,200	1,711,210.00	0.05
604	301026	浩通科技	84,620	1,711,016.40	0.05
605	603776	永安行	81,900	1,709,253.00	0.05
606	600526	菲达环保	411,601	1,691,680.11	0.05
607	000803	山高环能	248,400	1,684,152.00	0.05
608	000892	欢瑞世纪	505,400	1,682,982.00	0.05
609	300771	智莱科技	159,800	1,649,136.00	0.05
610	300021	大禹节水	412,200	1,644,678.00	0.05
611	301051	信濠光电	84,727	1,643,703.80	0.05
612	300094	国联水产	667,500	1,635,375.00	0.05
613	605066	天正电气	240,825	1,635,201.75	0.05
614	300798	锦鸡股份	249,700	1,630,541.00	0.05
615	300729	乐歌股份	168,630	1,622,220.60	0.05
616	601086	国芳集团	242,300	1,606,449.00	0.05
617	300654	世纪天鸿	164,870	1,602,536.40	0.05
618	600794	保税科技	562,200	1,602,270.00	0.05
619	603697	有友食品	166,300	1,594,817.00	0.05
620	688176	亚虹医药	160,629	1,593,439.68	0.05
621	600620	天宸股份	402,900	1,591,455.00	0.05
622	300639	凯普生物	318,900	1,584,933.00	0.05
623	002927	泰永长征	80,100	1,557,945.00	0.05
624	603918	金桥信息	164,000	1,554,720.00	0.05
625	605166	聚合顺	161,100	1,544,949.00	0.05
626	300510	金冠股份	487,000	1,519,440.00	0.04
627	002526	山东矿机	588,600	1,506,816.00	0.04
628	600479	千金药业	161,900	1,505,670.00	0.04
629	300429	强力新材	84,400	1,495,568.00	0.04
630	002662	峰璟股份	400,700	1,482,590.00	0.04
631	000888	峨眉山 A	165,700	1,481,358.00	0.04
632	002090	金智科技	167,100	1,477,164.00	0.04
633	000715	中兴商业	316,900	1,470,416.00	0.04
634	002248	华东数控	163,300	1,469,700.00	0.04
635	300057	万顺新材	169,100	1,467,788.00	0.04
636	603610	麒盛科技	81,200	1,458,352.00	0.04
637	000797	中国武夷	664,600	1,455,474.00	0.04
638	603758	秦安股份	162,700	1,454,538.00	0.04

639	301073	君亭酒店	79,125	1,440,075.00	0.04
640	603960	克来机电	82,600	1,438,066.00	0.04
641	300667	必创科技	84,200	1,435,610.00	0.04
642	300578	会畅科技	82,400	1,432,936.00	0.04
643	002178	延华智能	329,800	1,431,332.00	0.04
644	002404	嘉欣丝绸	249,400	1,426,568.00	0.04
645	002664	信质集团	82,400	1,424,696.00	0.04
646	002343	慈文传媒	324,900	1,416,564.00	0.04
647	002172	澳洋健康	501,100	1,413,102.00	0.04
648	300025	华星创业	335,400	1,408,680.00	0.04
649	301082	久盛电气	156,930	1,406,092.80	0.04
650	600826	兰生股份	159,900	1,405,521.00	0.04
651	300538	同益股份	84,100	1,403,629.00	0.04
652	002627	三峡旅游	244,513	1,396,169.23	0.04
653	002519	银河电子	237,700	1,390,545.00	0.04
654	603112	华翔股份	83,100	1,390,263.00	0.04
655	300340	科恒股份	158,600	1,386,164.00	0.04
656	600081	东风科技	152,600	1,385,608.00	0.04
657	603081	大丰实业	159,700	1,381,405.00	0.04
658	600300	维维股份	488,800	1,378,416.00	0.04
659	300192	科德教育	84,400	1,377,408.00	0.04
660	002682	龙洲股份	323,400	1,371,216.00	0.04
661	301151	冠龙节能	82,400	1,359,600.00	0.04
662	605068	明新旭腾	80,700	1,354,146.00	0.04
663	000159	国际实业	250,500	1,347,690.00	0.04
664	300950	德固特	80,350	1,347,469.50	0.04
665	002522	浙江众成	168,600	1,343,742.00	0.04
666	300711	广哈通信	81,600	1,338,240.00	0.04
667	002758	浙农股份	168,700	1,332,730.00	0.04
668	603579	荣泰健康	78,300	1,328,751.00	0.04
669	003029	吉大正元	82,800	1,326,456.00	0.04
670	001379	腾达科技	84,400	1,325,080.00	0.04
671	300893	松原安全	81,500	1,320,300.00	0.04
672	002117	东港股份	165,700	1,305,716.00	0.04
673	002016	世荣兆业	326,100	1,304,400.00	0.04
674	300231	银信科技	163,800	1,302,210.00	0.04
675	301038	深水规院	80,300	1,297,648.00	0.04
676	600127	金健米业	249,200	1,295,840.00	0.04
677	603615	茶花股份	79,100	1,277,465.00	0.04
678	603727	博迈科	74,863	1,277,162.78	0.04
679	300982	苏文电能	84,100	1,270,751.00	0.04
680	301025	读客文化	163,600	1,269,536.00	0.04
681	600979	广安爱众	324,000	1,266,840.00	0.04

682	300940	南极光	84,000	1,266,720.00	0.04
683	002599	盛通股份	247,300	1,261,230.00	0.04
684	000509	华塑控股	337,200	1,257,756.00	0.04
685	605167	利柏特	78,100	1,257,410.00	0.04
686	002659	凯文教育	335,400	1,254,396.00	0.04
687	600212	绿能慧充	241,200	1,254,240.00	0.04
688	600135	乐凯胶片	156,600	1,251,234.00	0.04
689	002875	安奈儿	84,200	1,251,212.00	0.04
690	300272	开能健康	237,700	1,250,302.00	0.04
691	300879	大叶股份	79,200	1,241,856.00	0.04
692	600467	好当家	628,500	1,238,145.00	0.04
693	600616	金枫酒业	326,000	1,222,500.00	0.04
694	300650	太龙股份	83,500	1,213,255.00	0.04
695	300490	华自科技	91,300	1,207,899.00	0.04
696	300697	电工合金	79,700	1,207,455.00	0.04
697	000514	渝开发	337,200	1,207,176.00	0.04
698	002546	新联电子	165,700	1,206,296.00	0.04
699	688579	地纬智能	158,024	1,199,402.16	0.04
700	002671	龙泉股份	322,500	1,196,475.00	0.04
701	301011	华立科技	84,351	1,192,723.14	0.04
702	300805	电声股份	164,000	1,189,000.00	0.04
703	002852	道道全	167,100	1,184,739.00	0.03
704	600067	冠城新材	407,700	1,182,330.00	0.03
705	002560	通达股份	158,400	1,178,496.00	0.03
706	000570	苏常柴 A	252,100	1,177,307.00	0.03
707	301185	鸥玛软件	79,200	1,176,912.00	0.03
708	600222	太龙药业	161,900	1,175,394.00	0.03
709	600510	黑牡丹	156,600	1,168,236.00	0.03
710	603518	锦泓集团	163,300	1,167,595.00	0.03
711	605136	丽人丽妆	163,400	1,165,042.00	0.03
712	601579	会稽山	78,300	1,150,227.00	0.03
713	603168	莎普爱思	242,900	1,146,488.00	0.03
714	600354	敦煌种业	239,600	1,140,496.00	0.03
715	300752	隆利科技	84,600	1,139,562.00	0.03
716	605388	均瑶健康	235,000	1,135,050.00	0.03
717	301516	中远通	79,200	1,120,680.00	0.03
718	001239	永达股份	84,400	1,115,768.00	0.03
719	300189	神农种业	252,300	1,089,936.00	0.03
720	002905	金逸影视	161,200	1,088,100.00	0.03
721	000576	甘化科工	164,900	1,083,393.00	0.03
722	301136	招标股份	98,400	1,080,432.00	0.03
723	300466	赛摩智能	153,200	1,078,528.00	0.03
724	603916	苏博特	78,900	1,077,774.00	0.03

725	002375	亚厦股份	316,900	1,071,122.00	0.03
726	603366	日出东方	147,200	1,070,144.00	0.03
727	600858	银座股份	242,100	1,067,661.00	0.03
728	603367	辰欣药业	82,900	1,063,607.00	0.03
729	002556	辉隆股份	237,400	1,063,552.00	0.03
730	300987	川网传媒	84,400	1,038,120.00	0.03
731	002419	天虹股份	245,100	1,036,773.00	0.03
732	002615	哈尔斯	148,400	1,023,960.00	0.03
733	600626	申达股份	320,065	1,021,007.35	0.03
734	300317	珈伟新能	253,400	1,018,668.00	0.03
735	000635	英力特	167,000	1,008,680.00	0.03
736	002642	荣联科技	160,000	985,600.00	0.03
737	600684	珠江股份	325,600	980,056.00	0.03
738	002589	瑞康医药	396,100	974,406.00	0.03
739	002279	久其软件	168,300	962,676.00	0.03
740	002722	物产金轮	81,448	960,271.92	0.03
741	000948	南天信息	80,230	953,934.70	0.03
742	002148	北纬科技	163,000	947,030.00	0.03
743	002401	中远海科	81,500	946,215.00	0.03
744	603917	合力科技	79,200	929,808.00	0.03
745	300423	昇辉科技	168,600	928,986.00	0.03
746	002420	毅昌科技	167,300	910,112.00	0.03
747	603569	长久物流	163,000	863,900.00	0.03
748	000532	华金资本	80,300	862,422.00	0.03
749	002285	世联行	420,500	862,025.00	0.03
750	601121	宝地矿业	152,700	861,228.00	0.03
751	301211	亨迪药业	75,800	858,056.00	0.03
752	300612	宣亚国际	77,700	849,261.00	0.03
753	002377	国创高新	336,300	847,476.00	0.02
754	603035	常熟汽饰	78,900	837,918.00	0.02
755	600880	博瑞传播	224,200	829,540.00	0.02
756	300240	飞力达	163,600	816,364.00	0.02
757	002365	永安药业	79,200	801,504.00	0.02
758	603999	读者传媒	160,100	800,500.00	0.02
759	300551	古鳌科技	80,000	787,200.00	0.02
760	600724	宁波富达	155,200	786,864.00	0.02
761	000816	智慧农业	336,900	774,870.00	0.02
762	600152	维科技术	77,200	771,228.00	0.02
763	601113	华鼎股份	228,900	755,370.00	0.02
764	000533	顺钠股份	79,200	753,192.00	0.02
765	002184	海得控制	78,800	721,808.00	0.02
766	600796	钱江生化	152,500	707,600.00	0.02
767	601599	浙文影业	248,200	692,478.00	0.02

768	002953	日丰股份	79,200	690,624.00	0.02
769	000507	珠海港	145,600	681,408.00	0.02
770	002825	纳尔股份	82,400	677,328.00	0.02
771	300063	天龙集团	77,700	674,436.00	0.02
772	001217	华尔泰	77,700	655,011.00	0.02
773	300471	厚普股份	75,800	652,638.00	0.02
774	300016	北陆药业	84,300	646,581.00	0.02
775	002658	雪迪龙	75,800	640,510.00	0.02
776	000926	福星股份	329,800	629,918.00	0.02
777	603333	福华尚纬	77,100	621,426.00	0.02
778	000779	甘咨询	77,700	605,283.00	0.02
779	002369	卓翼科技	110,800	601,644.00	0.02
780	002481	双塔食品	158,400	600,336.00	0.02
781	300587	天铁科技	155,200	597,520.00	0.02
782	002330	得利斯	163,000	563,980.00	0.02
783	600052	东望时代	156,600	554,364.00	0.02
784	600661	昂立教育	80,100	553,491.00	0.02
785	002877	智能自控	77,700	547,008.00	0.02
786	300071	福石控股	155,500	544,250.00	0.02
787	600658	电子城	146,000	543,120.00	0.02
788	600218	全柴动力	74,400	537,168.00	0.02
789	600738	丽尚国潮	148,600	534,960.00	0.02
790	000812	陕西金叶	168,200	521,420.00	0.02
791	600828	茂业商业	145,400	520,532.00	0.02
792	600617	国新能源	189,300	507,324.00	0.01
793	601007	金陵饭店	79,800	487,578.00	0.01
794	603421	鼎信通讯	78,300	481,545.00	0.01
795	300195	长荣股份	78,400	460,208.00	0.01
796	002161	远望谷	80,500	433,090.00	0.01
797	300426	华智数媒	79,200	400,752.00	0.01
798	600284	浦东建设	78,300	380,538.00	0.01
799	002022	科华生物	79,200	362,736.00	0.01
800	002540	亚太科技	76,300	356,321.00	0.01
801	002614	奥佳华	75,800	335,036.00	0.01
802	002666	德联集团	84,300	332,985.00	0.01
803	300172	中电环保	75,800	313,054.00	0.01
804	002548	金新农	84,100	310,329.00	0.01
805	600168	武汉控股	76,200	307,848.00	0.01
806	002321	华英农业	168,700	281,729.00	0.01
807	300194	福安药业	80,300	271,414.00	0.01
808	600280	中央商场	78,000	205,140.00	0.01
809	000882	华联股份	158,400	204,336.00	0.01
810	002210	飞马国际	75,800	160,696.00	0.00

811	002146	荣盛发展	79,200	84,744.00	0.00
-----	--------	------	--------	-----------	------

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.3.2 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	688795	摩尔线程	9,647	6,530,440.18	0.19
2	688308	欧科亿	30,000	4,652,400.00	0.14
3	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.09
4	688818	电科蓝天	17,168	1,266,122.03	0.04
5	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
6	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
7	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
8	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.01
9	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
10	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
11	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
12	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
13	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
14	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
15	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
16	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
17	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
18	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
19	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
20	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
21	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
22	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
23	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
24	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
25	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
26	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
27	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
28	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
29	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
30	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
31	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
32	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
33	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
34	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
35	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
36	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
37	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

38	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
39	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300835	龙磁科技	62,306,511.59	2.33
2	300806	斯迪克	62,034,123.19	2.32
3	300469	信息发展	53,075,811.83	1.98
4	688258	卓易信息	52,397,305.23	1.96
5	301285	鸿日达	51,742,101.03	1.93
6	001267	汇绿生态	48,592,620.90	1.82
7	300905	宝丽迪	48,024,399.25	1.80
8	301338	凯格精机	47,817,030.42	1.79
9	002169	智光电气	46,047,789.78	1.72
10	300843	胜蓝股份	44,386,259.54	1.66
11	002803	吉宏股份	42,877,861.10	1.60
12	002297	博云新材	42,698,903.05	1.60
13	300938	信测标准	42,144,598.46	1.58
14	301021	英诺激光	41,627,565.36	1.56
15	300619	金银河	40,973,269.17	1.53
16	301389	隆扬电子	40,633,474.64	1.52
17	301382	蜂助手	39,641,075.66	1.48
18	301580	爱迪特	39,186,399.94	1.46
19	000510	新金路	38,914,357.99	1.45
20	002246	北化股份	38,896,164.11	1.45

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	300806	斯迪克	95,654,024.98	3.58
2	688668	鼎通科技	76,472,641.95	2.86
3	001267	汇绿生态	67,560,929.84	2.53
4	300469	信息发展	64,466,712.99	2.41
5	300835	龙磁科技	60,586,289.34	2.26
6	688258	卓易信息	60,382,505.33	2.26
7	300905	宝丽迪	53,627,883.31	2.00
8	301389	隆扬电子	50,796,404.00	1.90
9	002246	北化股份	49,019,163.50	1.83
10	301338	凯格精机	47,472,293.18	1.77

11	300843	胜蓝股份	45,851,520.62	1.71
12	002297	博云新材	45,316,386.04	1.69
13	301285	鸿日达	45,298,450.55	1.69
14	300814	中富电路	45,126,837.32	1.69
15	301580	爱迪特	44,385,260.53	1.66
16	300938	信测标准	44,283,419.37	1.66
17	301183	东田微	43,960,778.32	1.64
18	300179	四方达	43,495,618.53	1.63
19	002169	智光电气	43,347,427.02	1.62
20	002803	吉宏股份	42,461,774.90	1.59

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	10,537,886,328.25
卖出股票收入（成交）总额	9,988,177,340.74

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	225,022.68	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	225,022.68	0.01

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113703	翔 26 转债	2,250	225,022.68	0.01

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	3,413,596.58
2	应收清算款	41,466,044.82
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	60,492.63
8	其他	-
9	合计	44,940,134.03

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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	688795	摩尔线程	6,530,440.18	0.19	新股锁定期内
2	688308	欧科亿	4,652,400.00	0.14	新股锁定期内
3	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.09	新股锁定期内
4	001248	华润新能源	595,206.03	0.02	新股锁定期内
4	001248	华润新能源	255,085.41	0.01	新股未上市
5	688818	电科蓝天	120,430.38	0.00	新股锁定期内

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 2000 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（%）
21,698	97,528.53	1,281,775,145.00	60.57	807,718,855.00	38.17	26,680,000.00	1.26

8.2 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	200.00	0.0000

8.3 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	0

负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 6 日）基金份额总额	588,674,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,958,674,000.00
本报告期基金总申购份额	7,702,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	7,545,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,116,174,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

经公司股东书面决定，谢仕荣先生于 2026 年 1 月 16 日起担任公司董事，陈健先生担任公司监事，Kirk Chester SWEENEY 先生不再担任公司董事，卢龙威先生不再担任公司监事。

经公司股东书面决定，刘晓冰先生于 2026 年 3 月 21 日起担任公司董事，徐珊女士担任公司监事，陆春光先生不再担任公司董事，刘晓冰先生不再担任公司监事。

经公司董事会审议通过，董辰先生于 2026 年 3 月 25 日起担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人重大人事变动：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 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、基金财产的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 3 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	—
管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 2	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 6 月 8 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	—

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
国联民生证券	2	6,200,956,599.59	30.22	1,240,285.28	30.73	-
华泰证券	6	5,605,735,766.03	27.32	1,121,250.64	27.78	-
银河证券	2	4,963,762,670.92	24.19	992,863.14	24.60	-
中信证券	2	1,357,615,270.66	6.62	203,642.20	5.05	-
方正证券	4	987,845,968.08	4.81	197,585.21	4.90	-
平安证券	2	637,709,315.80	3.11	127,544.59	3.16	-
中航证券	1	407,018,463.47	1.98	81,408.92	2.02	-
国泰海通证券	2	358,649,323.92	1.75	71,735.09	1.78	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	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为，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国联民生证券。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	813,585.68	19.30	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	604,935.66	14.35	-	-	-	-
中航证券	1,155,873.98	27.42	-	-	-	-

国泰海通 证券	1,640,473.02	38.92	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 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部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
3	关于兴业证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 16 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领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	2026 年 06 月 12 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）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	2026 年 06 月 06 日
6	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	2026 年 04 月 10 日
7	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	2026 年 03 月 27 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金变更基金简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 日
10	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	2026 年 03 月 11 日
11	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	2026 年 03 月 05 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 27 日

	基金持有停牌证券估值调整的提示性公告		
13	关于同意国泰海通证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 06 日
14	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	2026 年 01 月 26 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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 8 月 29 日