

# 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 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52

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	53
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12	投资组合报告附注	65
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>66</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2	期末上市基金前十名持有人	66
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>67</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>67</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	67
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	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8	其他重大事件	73
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>74</b>
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	74
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	74
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>74</b>
13.1	备查文件目录	74
13.2	存放地点	74
13.3	查阅方式	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCIETF（扩位证券简称：MSCI 中国 ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	512520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,056,394.00 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	2018 年 5 月 18 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。本基金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。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即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。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	021-60637228
传真	021-38601799	021-60635778

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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	张金良

## 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	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
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
本期已实现收益	3,070,765.45	-6,753,955.97	-19,080,163.40
本期利润	14,265,763.66	12,409,288.43	11,868,085.82
加权平均基金份额本期利润	0.2385	0.1535	0.0916
本期加权平均净值利润率	18.85%	14.24%	7.91%
本期基金份额净值增长率	20.80%	14.60%	-9.31%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	5,478,456.56	3,593,908.72	3,717,206.86
期末可供分配基金份额利润	0.1073	0.0520	0.0399

期末基金资产净值	73,501,005.59	82,293,090.32	96,773,600.86
期末基金份额净值	1.4396	1.1917	1.0399
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	83.34%	51.77%	32.43%

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。

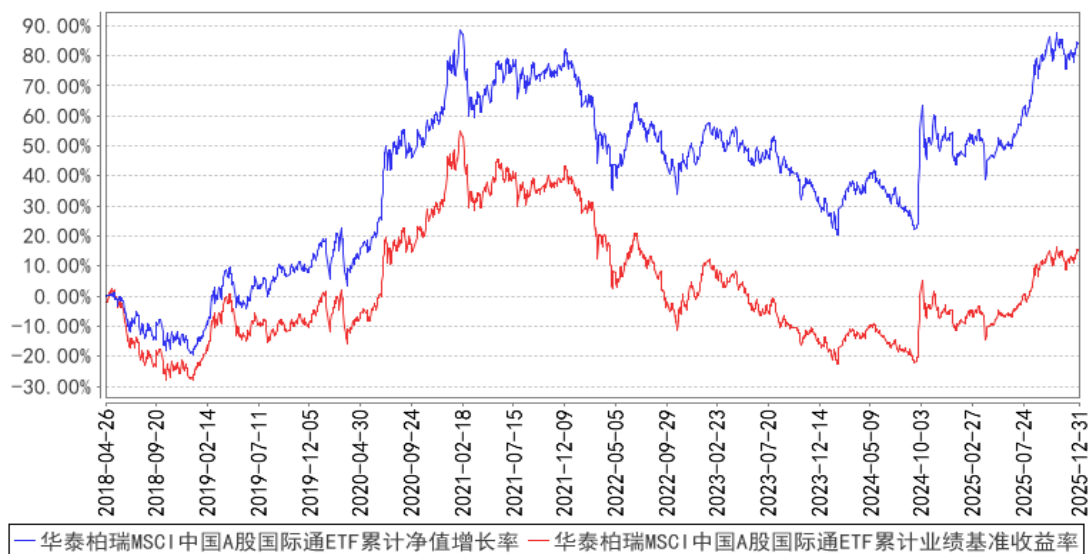
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.06%	0.95%	1.58%	0.98%	-1.52%	-0.03%
过去六个月	19.49%	0.90%	20.74%	0.94%	-1.25%	-0.04%
过去一年	20.80%	0.97%	22.60%	1.01%	-1.80%	-0.04%
过去三年	25.55%	1.07%	14.14%	1.15%	11.41%	-0.08%
过去五年	9.21%	1.13%	-15.44%	1.24%	24.65%	-0.11%
自基金合同生效起至今	83.34%	1.21%	15.18%	1.33%	68.16%	-0.12%

### 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

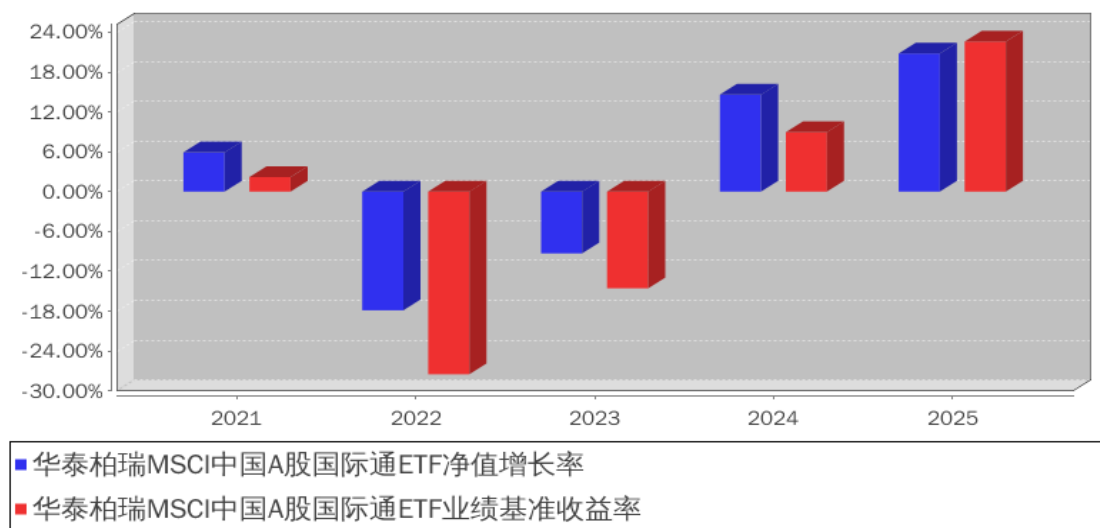
华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2018年4月26日至2025年12月31日。

### 3.2.3 过去五年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MSCI中国A股国际通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



### 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	2018 年 4 月 26 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

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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合规守信情况的说明

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 0.030%，期间日跟踪误差为 0.041%，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 1.4396 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.80%，业绩比较基准收益率为 22.60%。

#### 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，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，方可进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本托管人复核审查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。

### § 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_B76 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 MSCI 中国 A 股国际通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 MSCI 中国 A 股国际通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 MSCI 中国 A 股国际通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 MSCI 中国 A 股国际通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 MSCI 中国 A 股国际通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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华泰柏瑞 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。</p> <p>治理层负责监督华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p>

	<p>(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，就可能对华泰柏瑞 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 MSCI 中国 A 股国际通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 MSCI 中国 A 股国际通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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,193,769.76	2,174,963.55
结算备付金		4,904,768.52	4,927,253.03
存出保证金		675,295.89	841,089.65
交易性金融资产	7.4.7.2	66,861,666.32	74,873,654.09

其中：股票投资		66,861,666.32	74,873,654.09
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		-	8,842.39
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		73,635,500.49	82,825,802.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	433.20
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	119,444.55
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,253.09	10,999.62
应付托管费		3,084.39	3,666.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,190.19	25,163.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	120,967.23	373,004.99
负债合计		134,494.90	532,712.39
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	51,056,394.00	69,056,394.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	22,444,611.59	13,236,696.32
净资产合计		73,501,005.59	82,293,090.32
负债和净资产总计		73,635,500.49	82,825,802.71

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4396 元，基金份额总额 51,056,394.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

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
<b>一、营业总收入</b>		14,569,722.14	12,980,602.36
1. 利息收入		65,319.32	76,966.70
其中：存款利息收入	7.4.7.13	65,319.32	76,966.70
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）		3,301,848.32	-6,236,988.48
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-18,053.85	-9,437,557.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	4,698.13	3,054.65
资产支持证券投 资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	1,494,522.79	942,831.64
股利收益	7.4.7.19	1,820,681.25	2,254,683.02
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	11,194,998.21	19,163,244.40
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	7,556.29	-22,620.26
<b>减：二、营业总支出</b>		303,958.48	571,313.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	113,559.03	131,014.55
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	37,852.96	43,671.56

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		5,386.22	3,399.60
8. 其他费用	7.4.7.23	147,160.27	393,228.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,265,763.66	12,409,288.43
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,265,763.66	12,409,288.43
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		14,265,763.66	12,409,288.43

### 7.3 净资产变动表

会计主体：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

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	69,056,394.00	-	13,236,696.32	82,293,090.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	69,056,394.00	-	13,236,696.32	82,293,090.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,000,000.00	-	9,207,915.27	-8,792,084.73
（一）、综合收益总额	-	-	14,265,763.66	14,265,763.66
（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）	-18,000,000.00	-	-5,057,848.39	-23,057,848.39

其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-	-5,057,848.39	-23,057,848.39
(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	51,056,394.00	-	22,444,611.59	73,501,005.59
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	93,056,394.00	-	3,717,206.86	96,773,600.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	93,056,394.00	-	3,717,206.86	96,773,600.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	9,519,489.46	-14,480,510.54
(一)、综合收益总额	-	-	12,409,288.43	12,409,288.43
(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）	-24,000,000.00	-	-2,889,798.97	-26,889,798.97
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	-	152,736.64	3,152,736.64
2. 基金赎回款	-27,000,000.00	-	-3,042,535.61	-30,042,535.61
(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	69,056,394.00	-	13,236,696.32	82,293,090.32

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 MSCI 中国 A 股国际通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[2018]501 号《关于准予华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，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 MSCI 中国 A 股国际通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 1,547,024,828.00 元(含募集股票市值)，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(2018)第 0284 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,547,056,394.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,566.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2018]58 号文审核同意，本基金 1,547,056,394.00 份基金份额于 2018 年 5 月 18 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 MSCI 中国 A 股国际通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(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、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)、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、权证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。本基金将根据法律法规的规定,在履行适当程序后参与融资及转融通证券出借业务。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》,本基金自 2019 年 10 月 16 日起,修改上述投资范围表述:本基金可根据法律法规的规定,参与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的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

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 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(以下简称“华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 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商业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商业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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	1,193,769.76	2,174,963.55
等于：本金	1,193,642.75	2,174,732.11
加：应计利息	127.01	231.44
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	1,193,769.76	2,174,963.55

#### 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	56,925,582.00	-	66,861,666.32	9,936,084.32
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	56,925,582.00	-	66,861,666.32	9,936,084.32
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	75,908,747.98	-	74,873,654.09	-1,035,093.89
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	75,908,747.98	-	74,873,654.09	-1,035,093.89

#### 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	5,426,220.00	-	-	
其中：股指期货投资	5,426,220.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	5,426,220.00	-	-	
项目	上年度末 2024 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	7,038,600.00	-	-	
其中：股指期货投资	7,038,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	7,038,600.00	-	-	

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	108,200.00
IF2603	沪深 300 股指期货 2603	3.00	4,133,880.00	72,780.00
合计				180,980.00
减：可抵销期货暂收款				180,980.00

净额					-
----	--	--	--	--	---

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。

##### 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。

#### 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	967.23	982.93
其中：交易所市场	967.23	982.93
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	120,000.00	261,559.50
应退退补款	-	110,462.56
合计	120,967.23	373,004.99

#### 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	69,056,394.00	69,056,394.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
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	51,056,394.00	51,056,394.00

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。

#### 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	3,593,908.72	9,642,787.60	13,236,696.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,593,908.72	9,642,787.60	13,236,696.32
本期利润	3,070,765.45	11,194,998.21	14,265,763.66

本期基金份额交易产生的变动数	-1,186,217.61	-3,871,630.78	-5,057,848.39
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,186,217.61	-3,871,630.78	-5,057,848.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,478,456.56	16,966,155.03	22,444,611.59

#### 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	5,237.57	8,355.03
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	60,074.33	68,577.99
其他	7.42	33.68
合计	65,319.32	76,966.70

#### 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	-849,525.27	-8,467,395.30
股票投资收益——赎回 差价收入	831,471.42	-970,162.49
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	-18,053.85	-9,437,557.79

##### 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	12,954,227.00	17,758,723.11
减：卖出股票成本总额	13,791,924.44	26,201,828.26
减：交易费用	11,827.83	24,290.15
买卖股票差价收入	-849,525.27	-8,467,395.30

#### 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	23,057,848.39	30,042,535.61
减：现金支付赎回款总额	8,978,753.39	11,539,194.61
减：赎回股票成本总额	13,247,623.58	19,473,503.49
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	831,471.42	-970,162.49

#### 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	1.58	1.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,696.55	3,053.53
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	4,698.13	3,054.65

#### 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	23,999.08	12,555.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,300.00	9,500.00
减：应计利息总额	1.58	1.12
减：交易费用	0.95	0.50
买卖债券差价收入	4,696.55	3,053.53

#### 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	1,494,522.79	942,831.64

#### 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	1,820,681.25	2,254,683.02
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	1,820,681.25	2,254,683.02

#### 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	10,971,178.21	19,203,564.40
股票投资	10,971,178.21	19,203,564.40
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	223,820.00	-40,320.00
权证投资	-	-
期货投资	223,820.00	-40,320.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-

合计	11,194,998.21	19,163,244.40
----	---------------	---------------

#### 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	7,160.47	-24,101.62
其他收入	395.82	1,481.36
合计	7,556.29	-22,620.26

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	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	26,895.27	272,953.22
银行划款手续费	265.00	275.00
合计	147,160.27	393,228.22

注：1、指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度伍(5)千美元或等值人民币(即不足 5 千美元部分按照 5 千美元或等值人民币收取)。

2、根据《关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担，并相应修订本基金基金合同，标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支。

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 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（“华泰柏瑞 MSCIETF 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	-	-	5,619,535.76	20.89

### 7.4.10.1.2 债券交易

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	-	-	10,377.30	82.65

### 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均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 (%)
-	-	-	-	-
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 (%)
华泰证券	2,948.40	21.54	58.33	5.93

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	113,559.03	131,014.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,675.14	5,750.83
应支付基金管理人的净管理费	106,883.89	125,263.72

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 0.15% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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	37,852.96	43,671.56

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 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。

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 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	8,766,541.00	17.1703	12,606,441.00	18.2553
华泰证券股 份有限公司	2,008,892.00	3.9347	1,679,339.00	2.4318

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
中国建设银行股 份有限公司	1,193,769.76	5,237.57	2,174,963.55	8,355.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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	127110	广核转债	网上配售	32	3,200.00
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

-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 30,436.00 股建设银行的普通股，成本总额为人民币 250,126.12 元，估值总额为人民币 282,446.08 元，占基金净资产的比例为 0.38%（于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 18,336.00 股建设银行的普通股，成本总额为人民币 114,596.03 元，估值总额为人民币 161,173.44 元，占基金净资产的比例为 0.20%）。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 10,400.00 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 161,868.87 元，估值总额为人民币 245,336.00 元，占基金净资产的比例为 0.33%（于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 13,900.00 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 213,731.28 元，估值总额为人民币 244,501.00 元，占基金净资产的比例为 0.30%）。

#### 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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
688012	中微公司	2025 年 12 月 19 日	拟筹划重大资产重组	272.72	2026 年 1 月 5 日	278.00	893	126,396.44	243,538.96	-
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	1,100	115,516.44	86,691.00	-

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或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。

### 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期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	1,193,769.76	-	-	-	-	-	1,193,769.76
结算备付金	4,904,768.52	-	-	-	-	-	4,904,768.52
存出保证金	2,431.89	-	-	-	-	672,864.00	675,295.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	66,861,666.32	66,861,666.32
资产总计	6,100,970.17	-	-	-	-	67,534,530.32	73,635,500.49
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,253.09	9,253.09
应付托管费	-	-	-	-	-	3,084.39	3,084.39
应交税费	-	-	-	-	-	1,190.19	1,190.19
其他负债	-	-	-	-	-	120,967.23	120,967.23
负债总计	-	-	-	-	-	134,494.90	134,494.90

利率敏感度缺口	6,100,970.17	-	-	-	-	67,400,035.42	73,501,005.59
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	2,174,963.55	-	-	-	-	-	2,174,963.55
结算备付金	4,927,253.03	-	-	-	-	-	4,927,253.03
存出保证金	1,598.45	-	-	-	-	839,491.20	841,089.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	74,873,654.09	74,873,654.09
应收清算款	-	-	-	-	-	8,842.39	8,842.39
资产总计	7,103,815.03	-	-	-	-	75,721,987.68	82,825,802.71
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	433.20	433.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,999.62	10,999.62
应付托管费	-	-	-	-	-	3,666.55	3,666.55
应付清算款	-	-	-	-	-	119,444.55	119,444.55
应交税费	-	-	-	-	-	25,163.48	25,163.48
其他负债	-	-	-	-	-	373,004.99	373,004.99
负债总计	-	-	-	-	-	532,712.39	532,712.39
利率敏感度缺口	7,103,815.03	-	-	-	-	75,189,275.29	82,293,090.32

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。

#### 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	66,861,666.32	90.97	74,873,654.09	90.98
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	-	-	-433.20	-0.00
合计	66,861,666.32	90.97	74,873,220.89	90.98

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(附注 7.4.7.3)。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%	3,661,563.87	3,920,690.58
业绩比较基准下降5%	-3,661,563.87	-3,920,690.58	

## 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	66,531,436.36	74,777,628.09
第二层次	330,229.96	96,026.00
第三层次	-	-
合计	66,861,666.32	74,873,654.09

#### 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		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-
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	-	113,189.87	113,189.87
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	91,205.47	91,205.47
当期利得或损失总额	-	-21,984.40	-21,984.40
其中：计入损益的利得或损失	-	-21,984.40	-21,984.40
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

#### 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 0.00 元 (2024 年度：3,152,736.64 元)，其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 0.00 元 (2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 1,934,501.00 元和以现金支付的申购款 1,218,235.64 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	66,861,666.32	90.80
	其中：股票	66,861,666.32	90.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,098,538.28	8.28
8	其他各项资产	675,295.89	0.92
9	合计	73,635,500.49	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	559,843.24	0.76
B	采矿业	3,988,780.03	5.43

C	制造业	36,672,256.31	49.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,408,107.38	3.28
E	建筑业	941,655.11	1.28
F	批发和零售业	285,676.80	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	2,062,895.44	2.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,178,997.05	4.33
J	金融业	14,978,407.80	20.38
K	房地产业	464,054.97	0.63
L	租赁和商务服务业	542,809.98	0.74
M	科学研究和技术服务业	423,341.15	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	57,866.40	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	146,220.66	0.20
R	文化、体育和娱乐业	65,520.00	0.09
S	综合	85,234.00	0.12
	合计	66,861,666.32	90.97

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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	1,849	2,546,405.82	3.46
2	300750	宁德时代	6,460	2,372,499.60	3.23

3	600036	招商银行	30,354	1,277,903.40	1.74
4	601138	工业富联	19,800	1,228,590.00	1.67
5	601318	中国平安	15,644	1,070,049.60	1.46
6	601899	紫金矿业	30,256	1,042,924.32	1.42
7	300308	中际旭创	1,640	1,000,400.00	1.36
8	688256	寒武纪	733	993,618.15	1.35
9	600900	长江电力	36,050	980,199.50	1.33
10	601288	农业银行	125,277	962,127.36	1.31
11	002594	比亚迪	8,013	783,030.36	1.07
12	688041	海光信息	3,420	767,482.20	1.04
13	601398	工商银行	92,417	732,866.81	1.00
14	601166	兴业银行	30,982	652,480.92	0.89
15	300502	新易盛	1,480	637,702.40	0.87
16	000858	五粮液	5,706	604,493.64	0.82
17	002475	立讯精密	10,585	600,275.35	0.82
18	600000	浦发银行	46,089	573,347.16	0.78
19	601328	交通银行	77,564	562,339.00	0.77
20	600276	恒瑞医药	9,314	554,834.98	0.75
21	300059	东方财富	23,122	535,967.96	0.73
22	600030	中信证券	17,869	513,018.99	0.70
23	603993	洛阳钼业	25,282	505,640.00	0.69
24	300274	阳光电源	2,940	502,857.60	0.68
25	002371	北方华创	1,050	482,034.00	0.66
26	601211	国泰海通	20,504	421,357.20	0.57
27	601601	中国太保	9,900	414,909.00	0.56
28	000333	美的集团	5,100	398,565.00	0.54
29	002714	牧原股份	7,858	397,457.64	0.54
30	601088	中国神华	9,600	388,800.00	0.53
31	601816	京沪高铁	70,400	362,560.00	0.49
32	600150	中国船舶	10,900	362,534.00	0.49
33	300476	胜宏科技	1,200	345,096.00	0.47
34	600309	万华化学	4,500	345,060.00	0.47
35	603259	药明康德	3,660	331,742.40	0.45
36	601988	中国银行	57,295	328,300.35	0.45
37	300760	迈瑞医疗	1,700	323,765.00	0.44
38	601857	中国石油	31,083	323,574.03	0.44
39	000001	平安银行	27,929	318,669.89	0.43
40	600809	山西汾酒	1,800	309,060.00	0.42
41	601668	中国建筑	59,404	304,742.52	0.41
42	601225	陕西煤业	13,989	298,245.48	0.41
43	601127	赛力斯	2,400	290,304.00	0.39
44	600028	中国石化	46,730	288,791.40	0.39
45	601939	建设银行	30,436	282,446.08	0.38

46	601919	中远海控	18,152	275,547.36	0.37
47	600919	江苏银行	26,379	274,341.60	0.37
48	002142	宁波银行	9,537	267,894.33	0.36
49	601888	中国中免	2,799	264,673.44	0.36
50	002352	顺丰控股	6,867	263,143.44	0.36
51	600887	伊利股份	9,124	260,946.40	0.36
52	300033	同花顺	800	257,744.00	0.35
53	600031	三一重工	12,137	256,454.81	0.35
54	600406	国电南瑞	11,390	256,047.20	0.35
55	601985	中国核电	29,600	256,040.00	0.35
56	000568	泸州老窖	2,187	254,173.14	0.35
57	600183	生益科技	3,500	249,935.00	0.34
58	603288	海天味业	6,691	247,700.82	0.34
59	601688	华泰证券	10,400	245,336.00	0.33
60	688012	中微公司	893	243,538.96	0.33
61	600111	北方稀土	5,267	242,914.04	0.33
62	601766	中国中车	34,900	238,018.00	0.32
63	601658	邮储银行	43,300	235,985.00	0.32
64	600019	宝钢股份	31,470	234,451.50	0.32
65	601818	光大银行	66,927	233,575.23	0.32
66	600690	海尔智家	8,902	232,253.18	0.32
67	600050	中国联通	45,000	229,950.00	0.31
68	300394	天孚通信	1,128	229,017.84	0.31
69	601600	中国铝业	18,700	228,514.00	0.31
70	600346	恒力石化	9,980	224,849.40	0.31
71	000725	京东方 A	52,996	223,113.16	0.30
72	002916	深南电路	948	220,210.92	0.30
73	605499	东鹏饮料	810	216,585.90	0.29
74	000063	中兴通讯	5,700	215,688.00	0.29
75	300433	蓝思科技	7,100	214,917.00	0.29
76	603501	豪威集团	1,703	214,407.70	0.29
77	000792	盐湖股份	7,600	214,016.00	0.29
78	601100	恒立液压	1,928	211,906.48	0.29
79	002384	东山精密	2,500	211,625.00	0.29
80	601229	上海银行	20,469	206,736.90	0.28
81	600989	宝丰能源	10,500	206,115.00	0.28
82	601336	新华保险	2,900	202,130.00	0.28
83	600547	山东黄金	5,191	200,943.61	0.27
84	688111	金山办公	654	200,823.78	0.27
85	601009	南京银行	17,564	200,756.52	0.27
86	603986	兆易创新	936	200,538.00	0.27
87	601012	隆基绿能	10,888	198,161.60	0.27
88	000425	徐工机械	17,000	196,860.00	0.27

89	688008	澜起科技	1,662	195,783.60	0.27
90	600016	民生银行	51,056	195,544.48	0.27
91	002463	沪电股份	2,660	194,366.20	0.26
92	000408	藏格矿业	2,300	194,120.00	0.26
93	300014	亿纬锂能	2,925	192,348.00	0.26
94	601689	拓普集团	2,435	187,933.30	0.26
95	000776	广发证券	8,366	184,219.32	0.25
96	600660	福耀玻璃	2,841	184,011.57	0.25
97	601628	中国人寿	3,918	178,269.00	0.24
98	603799	华友钴业	2,602	177,612.52	0.24
99	600999	招商证券	10,640	177,049.60	0.24
100	000166	申万宏源	32,411	170,805.97	0.23
101	002493	荣盛石化	14,578	170,708.38	0.23
102	601111	中国国航	18,100	169,597.00	0.23
103	600104	上汽集团	11,129	169,383.38	0.23
104	600905	三峡能源	41,100	168,099.00	0.23
105	000338	潍柴动力	9,761	167,889.20	0.23
106	002938	鹏鼎控股	3,300	166,914.00	0.23
107	601169	北京银行	30,355	166,345.40	0.23
108	002230	科大讯飞	3,272	164,548.88	0.22
109	601066	中信建投	6,100	163,297.00	0.22
110	300498	温氏股份	9,620	162,385.60	0.22
111	601881	中国银河	10,300	161,916.00	0.22
112	688072	拓荆科技	489	161,370.00	0.22
113	000807	云铝股份	4,900	160,916.00	0.22
114	601390	中国中铁	29,600	160,136.00	0.22
115	002600	领益智造	10,200	158,508.00	0.22
116	600926	杭州银行	10,302	157,414.56	0.21
117	000651	格力电器	3,900	156,858.00	0.21
118	600362	江西铜业	2,855	156,796.60	0.21
119	600089	特变电工	7,040	156,428.80	0.21
120	600893	航发动力	3,905	156,317.15	0.21
121	600489	中金黄金	6,600	154,176.00	0.21
122	600418	江淮汽车	3,100	153,450.00	0.21
123	601727	上海电气	17,800	153,258.00	0.21
124	600010	包钢股份	63,944	152,186.72	0.21
125	002027	分众传媒	20,642	152,131.54	0.21
126	600436	片仔癀	900	151,902.00	0.21
127	002625	光启技术	3,100	151,156.00	0.21
128	688271	联影医疗	1,201	150,725.50	0.21
129	600886	国投电力	11,400	149,568.00	0.20
130	601006	大秦铁路	28,900	149,124.00	0.20
131	300124	汇川技术	1,950	146,893.50	0.20

132	300015	爱尔眼科	13,317	146,220.66	0.20
133	600115	中国东航	24,110	144,660.00	0.20
134	002050	三花智控	2,600	143,806.00	0.20
135	601995	中金公司	4,100	143,500.00	0.20
136	600160	巨化股份	3,700	142,154.00	0.19
137	000977	浪潮信息	2,128	141,724.80	0.19
138	002460	赣锋锂业	2,253	141,691.17	0.19
139	000625	长安汽车	11,792	139,853.12	0.19
140	002241	歌尔股份	4,852	139,397.96	0.19
141	000538	云南白药	2,411	136,848.36	0.19
142	000100	TCL 科技	29,934	135,900.36	0.18
143	601998	中信银行	17,600	135,520.00	0.18
144	002304	洋河股份	2,200	133,628.00	0.18
145	600015	华夏银行	19,177	131,745.99	0.18
146	600438	通威股份	6,400	131,328.00	0.18
147	601669	中国电建	24,747	128,684.40	0.18
148	002837	英维克	1,200	128,268.00	0.17
149	000895	双汇发展	4,837	128,035.39	0.17
150	002311	海大集团	2,300	127,374.00	0.17
151	601825	沪农商行	13,600	126,344.00	0.17
152	600415	小商品城	7,900	126,005.00	0.17
153	600795	国电电力	25,000	126,000.00	0.17
154	600029	南方航空	15,700	125,757.00	0.17
155	002736	国信证券	9,525	124,968.00	0.17
156	600585	海螺水泥	5,686	124,295.96	0.17
157	300408	三环集团	2,700	123,525.00	0.17
158	002466	天齐锂业	2,200	121,836.00	0.17
159	601319	中国人保	13,300	119,035.00	0.16
160	002709	天赐材料	2,560	118,604.80	0.16
161	300803	指南针	900	117,783.00	0.16
162	002558	巨人网络	2,700	116,883.00	0.16
163	600958	东方证券	10,495	114,395.50	0.16
164	000617	中油资本	11,800	113,280.00	0.15
165	600188	兖矿能源	8,505	111,840.75	0.15
166	001979	招商蛇口	12,858	111,093.12	0.15
167	000988	华工科技	1,400	111,062.00	0.15
168	688521	芯原股份	800	109,576.00	0.15
169	688036	传音控股	1,654	109,428.64	0.15
170	600221	海航控股	60,400	109,324.00	0.15
171	601360	三六零	9,700	108,349.00	0.15
172	002920	德赛西威	900	108,270.00	0.15
173	000630	铜陵有色	18,000	108,180.00	0.15
174	601868	中国能建	45,800	107,630.00	0.15

175	002001	新和成	4,252	107,107.88	0.15
176	603893	瑞芯微	600	106,968.00	0.15
177	300442	润泽科技	2,000	105,600.00	0.14
178	002532	天山铝业	6,500	105,170.00	0.14
179	600048	保利发展	16,910	103,151.00	0.14
180	600580	卧龙电驱	2,100	103,110.00	0.14
181	600039	四川路桥	10,319	102,674.05	0.14
182	688396	华润微	1,934	102,231.24	0.14
183	600875	东方电气	4,200	101,976.00	0.14
184	601872	招商轮船	11,300	101,474.00	0.14
185	605117	德业股份	1,176	101,371.20	0.14
186	600066	宇通客车	3,100	101,370.00	0.14
187	000301	东方盛虹	9,300	101,277.00	0.14
188	600895	张江高科	2,300	100,970.00	0.14
189	603296	华勤技术	1,100	99,814.00	0.14
190	002202	金风科技	4,883	99,613.20	0.14
191	002353	杰瑞股份	1,400	99,162.00	0.13
192	301308	江波龙	400	97,936.00	0.13
193	002074	国轩高科	2,500	97,775.00	0.13
194	600703	三安光电	6,900	97,497.00	0.13
195	688506	百利天恒	300	96,930.00	0.13
196	000938	紫光股份	3,936	96,825.60	0.13
197	600674	川投能源	6,900	95,910.00	0.13
198	600011	华能国际	12,778	95,323.88	0.13
199	601838	成都银行	5,900	95,108.00	0.13
200	603228	景旺电子	1,300	95,017.00	0.13
201	601788	光大证券	5,400	94,770.00	0.13
202	000963	华东医药	2,396	94,522.20	0.13
203	600549	厦门钨业	2,300	94,438.00	0.13
204	601168	西部矿业	3,400	93,976.00	0.13
205	600176	中国巨石	5,494	93,947.40	0.13
206	600426	华鲁恒升	2,960	93,032.80	0.13
207	002595	豪迈科技	1,100	92,961.00	0.13
208	688047	龙芯中科	700	92,477.00	0.13
209	601916	浙商银行	30,360	92,294.40	0.13
210	600584	长电科技	2,500	91,950.00	0.13
211	300604	长川科技	900	91,179.00	0.12
212	000975	山金国际	3,720	90,507.60	0.12
213	601901	方正证券	11,500	89,700.00	0.12
214	601377	兴业证券	12,083	89,655.86	0.12
215	688249	晶合集成	2,700	89,613.00	0.12
216	600741	华域汽车	4,420	88,400.00	0.12
217	300866	安克创新	770	88,080.30	0.12

218	000933	神火股份	3,200	87,904.00	0.12
219	600219	南山铝业	16,300	87,694.00	0.12
220	002236	大华股份	4,600	87,124.00	0.12
221	600522	中天科技	4,800	86,976.00	0.12
222	002049	紫光国微	1,100	86,691.00	0.12
223	600487	亨通光电	3,500	86,555.00	0.12
224	002128	电投能源	3,100	86,521.00	0.12
225	002414	高德红外	5,880	86,259.60	0.12
226	688183	生益电子	900	86,121.00	0.12
227	601633	长城汽车	3,796	85,903.48	0.12
228	600515	海南机场	16,000	85,280.00	0.12
229	600673	东阳光	3,800	85,234.00	0.12
230	000157	中联重科	9,810	84,660.30	0.12
231	002648	卫星化学	4,774	84,404.32	0.11
232	601877	正泰电器	3,000	83,670.00	0.11
233	600096	云天化	2,500	83,525.00	0.11
234	688126	沪硅产业	3,850	83,314.00	0.11
235	003816	中国广核	22,100	83,096.00	0.11
236	002156	通富微电	2,200	82,940.00	0.11
237	001965	招商公路	8,100	81,648.00	0.11
238	688303	大全能源	3,040	81,532.80	0.11
239	601077	渝农商行	12,500	80,750.00	0.11
240	688223	晶科能源	14,185	80,003.40	0.11
241	603659	璞泰来	2,916	79,723.44	0.11
242	002294	信立泰	1,607	79,626.85	0.11
243	000596	古井贡酒	600	79,560.00	0.11
244	300115	长盈精密	1,700	79,050.00	0.11
245	688472	阿特斯	5,300	79,023.00	0.11
246	600570	恒生电子	2,616	78,872.40	0.11
247	600196	复星医药	2,977	78,860.73	0.11
248	600233	圆通速递	4,800	78,816.00	0.11
249	000426	兴业银锡	2,200	78,320.00	0.11
250	600023	浙能电力	15,800	78,210.00	0.11
251	601021	春秋航空	1,300	77,350.00	0.11
252	002281	光迅科技	1,100	76,945.00	0.10
253	000708	中信特钢	4,700	76,939.00	0.10
254	600803	新奥股份	3,700	76,812.00	0.10
255	688120	华海清科	511	76,690.88	0.10
256	002080	中材科技	2,100	76,314.00	0.10
257	300418	昆仑万维	1,800	75,060.00	0.10
258	002064	华峰化学	6,800	74,800.00	0.10
259	301269	华大九天	700	74,431.00	0.10
260	601058	赛轮轮胎	4,600	74,428.00	0.10

261	601618	中国中冶	25,000	74,250.00	0.10
262	300223	北京君正	700	74,228.00	0.10
263	603260	合盛硅业	1,400	73,780.00	0.10
264	300765	新诺威	2,040	73,582.80	0.10
265	688469	芯联集成	10,980	73,456.20	0.10
266	002555	三七互娱	3,100	73,160.00	0.10
267	688578	艾力斯	700	72,905.00	0.10
268	603486	科沃斯	900	72,612.00	0.10
269	600021	上海电力	3,600	72,072.00	0.10
270	300896	爱美客	500	70,860.00	0.10
271	300782	卓胜微	868	70,724.64	0.10
272	688617	惠泰医疗	290	70,548.30	0.10
273	688122	西部超导	941	70,179.78	0.10
274	601238	广汽集团	8,600	70,176.00	0.10
275	601958	金钼股份	4,500	70,110.00	0.10
276	300316	晶盛机电	1,900	69,825.00	0.09
277	000831	中国稀土	1,500	69,660.00	0.09
278	601878	浙商证券	6,400	69,184.00	0.09
279	600061	国投资本	9,000	68,850.00	0.09
280	600988	赤峰黄金	2,200	68,728.00	0.09
281	002422	科伦药业	2,332	68,444.20	0.09
282	600026	中远海能	5,800	67,744.00	0.09
283	300857	协创数据	400	67,472.00	0.09
284	601607	上海医药	3,760	67,153.60	0.09
285	300661	圣邦股份	973	66,786.72	0.09
286	002653	海思科	1,300	66,716.00	0.09
287	002601	龙佰集团	3,400	66,572.00	0.09
288	600143	金发科技	3,400	66,436.00	0.09
289	603392	万泰生物	1,472	66,151.68	0.09
290	000999	华润三九	2,311	65,771.06	0.09
291	300251	光线传媒	4,000	65,520.00	0.09
292	300207	欣旺达	2,500	65,375.00	0.09
293	600027	华电国际	13,100	64,976.00	0.09
294	688187	时代电气	1,266	64,933.14	0.09
295	000066	中国长城	4,500	64,845.00	0.09
296	601179	中国西电	7,100	64,610.00	0.09
297	600085	同仁堂	2,000	64,520.00	0.09
298	600588	用友网络	4,864	64,496.64	0.09
299	301236	软通动力	1,350	64,030.50	0.09
300	688169	石头科技	420	63,865.20	0.09
301	300628	亿联网络	1,790	63,813.50	0.09
302	000783	长江证券	7,800	63,570.00	0.09
303	000002	万科 A	13,669	63,560.85	0.09

304	688608	恒玄科技	280	63,543.20	0.09
305	601117	中国化学	8,438	63,538.14	0.09
306	000564	供销大集	25,400	63,500.00	0.09
307	600733	北汽蓝谷	7,900	63,437.00	0.09
308	600745	闻泰科技	1,700	63,376.00	0.09
309	300122	智飞生物	3,350	63,214.50	0.09
310	600845	宝信软件	3,039	62,937.69	0.09
311	603369	今世缘	1,800	62,604.00	0.09
312	300413	芒果超媒	2,560	62,515.20	0.09
313	600460	士兰微	2,200	62,502.00	0.09
314	600918	中泰证券	9,600	62,400.00	0.08
315	601198	东兴证券	4,494	62,376.72	0.08
316	601456	国联民生	6,100	62,037.00	0.08
317	300832	新产业	1,100	61,875.00	0.08
318	601555	东吴证券	6,825	61,834.50	0.08
319	601777	千里科技	5,800	61,654.00	0.08
320	688082	盛美上海	349	61,441.45	0.08
321	600600	青岛啤酒	1,000	61,200.00	0.08
322	600536	中国软件	1,310	60,653.00	0.08
323	601933	永辉超市	12,900	60,501.00	0.08
324	300759	康龙化成	2,125	60,413.75	0.08
325	601991	大唐发电	17,300	60,377.00	0.08
326	601162	天风证券	14,400	59,904.00	0.08
327	002078	太阳纸业	3,800	59,850.00	0.08
328	603606	东方电缆	1,000	59,750.00	0.08
329	002252	上海莱士	9,400	59,596.00	0.08
330	002340	格林美	7,100	59,356.00	0.08
331	300919	中伟新材	1,280	59,302.40	0.08
332	600839	四川长虹	6,500	59,150.00	0.08
333	000876	新希望	6,407	59,072.54	0.08
334	002517	恺英网络	2,700	59,049.00	0.08
335	601696	中银证券	3,900	58,461.00	0.08
336	603568	伟明环保	2,280	57,866.40	0.08
337	002939	长城证券	5,600	57,120.00	0.08
338	688188	柏楚电子	420	57,073.80	0.08
339	688777	中控技术	1,153	56,889.02	0.08
340	601216	君正集团	11,800	56,876.00	0.08
341	601108	财通证券	6,510	56,767.20	0.08
342	600009	上海机场	1,714	56,150.64	0.08
343	000661	长春高新	600	55,530.00	0.08
344	603160	汇顶科技	700	55,300.00	0.08
345	000786	北新建材	2,200	54,934.00	0.07
346	688009	中国通号	9,990	54,645.30	0.07

347	000932	华菱钢铁	9,700	54,514.00	0.07
348	300339	润和软件	1,100	54,450.00	0.07
349	601577	长沙银行	5,600	54,320.00	0.07
350	600332	白云山	2,079	53,513.46	0.07
351	002459	晶澳科技	4,616	52,853.20	0.07
352	603806	福斯特	3,781	52,782.76	0.07
353	600298	安琪酵母	1,200	52,488.00	0.07
354	002966	苏州银行	6,300	52,227.00	0.07
355	600642	申能股份	6,700	52,126.00	0.07
356	603195	公牛集团	1,270	51,854.10	0.07
357	688538	和辉光电	19,400	51,604.00	0.07
358	000983	山西焦煤	8,002	51,372.84	0.07
359	000728	国元证券	6,140	51,269.00	0.07
360	688099	晶晨股份	573	49,982.79	0.07
361	002456	欧菲光	4,700	49,914.00	0.07
362	002673	西部证券	6,300	49,707.00	0.07
363	002223	鱼跃医疗	1,300	49,673.00	0.07
364	600177	雅戈尔	6,500	49,400.00	0.07
365	002185	华天科技	4,500	49,365.00	0.07
366	601799	星宇股份	400	49,348.00	0.07
367	600157	永泰能源	31,400	49,298.00	0.07
368	600109	国金证券	5,300	49,290.00	0.07
369	688599	天合光能	2,968	49,120.40	0.07
370	600352	浙江龙盛	4,600	49,036.00	0.07
371	601699	潞安环能	4,115	48,557.00	0.07
372	688347	华虹公司	450	48,541.50	0.07
373	601567	三星医疗	2,100	48,342.00	0.07
374	300748	金力永磁	1,400	47,754.00	0.06
375	002129	TCL 中环	5,550	47,563.50	0.06
376	002085	万丰奥威	2,900	46,429.00	0.06
377	600256	广汇能源	9,300	45,756.00	0.06
378	601136	首创证券	2,400	45,096.00	0.06
379	688728	格科微	2,977	44,476.38	0.06
380	600161	天坛生物	2,680	43,791.20	0.06
381	000729	燕京啤酒	3,800	42,674.00	0.06
382	601865	福莱特	2,600	40,742.00	0.06
383	600985	淮北矿业	3,600	39,996.00	0.05
384	300347	泰格医药	550	31,185.00	0.04

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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	601211	国泰海通	429,936.04	0.52
2	601328	交通银行	231,244.00	0.28
3	600150	中国船舶	206,571.00	0.25
4	601939	建设银行	201,722.00	0.25
5	300803	指南针	164,421.00	0.20
6	601998	中信银行	159,186.00	0.19
7	300750	宁德时代	157,349.00	0.19
8	002594	比亚迪	145,995.00	0.18
9	600036	招商银行	116,522.00	0.14
10	000564	供销大集	101,530.00	0.12
11	600900	长江电力	99,555.00	0.12
12	000858	五粮液	99,190.00	0.12
13	002558	巨人网络	98,379.00	0.12
14	600436	片仔癀	97,646.00	0.12
15	600839	四川长虹	95,874.00	0.12
16	301308	江波龙	94,800.00	0.12
17	300251	光线传媒	92,031.00	0.11
18	603228	景旺电子	91,507.00	0.11
19	601933	永辉超市	90,742.00	0.11
20	688249	晶合集成	89,401.71	0.11

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	745,865.00	0.91
2	601211	国泰海通	381,428.04	0.46
3	002594	比亚迪	369,236.00	0.45
4	000858	五粮液	310,683.00	0.38
5	300059	东方财富	219,780.00	0.27
6	002371	北方华创	210,082.00	0.26
7	002475	立讯精密	195,188.00	0.24
8	688111	金山办公	148,593.23	0.18
9	300308	中际旭创	148,115.00	0.18
10	300760	迈瑞医疗	140,068.00	0.17
11	002714	牧原股份	135,916.00	0.17
12	300033	同花顺	133,476.00	0.16

13	000333	美的集团	132,462.00	0.16
14	300502	新易盛	130,638.00	0.16
15	688256	寒武纪	127,874.08	0.16
16	000001	平安银行	124,776.00	0.15
17	002028	思源电气	124,365.00	0.15
18	300274	阳光电源	120,162.00	0.15
19	002352	顺丰控股	117,266.00	0.14
20	300999	金龙鱼	112,894.00	0.14

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	8,056,382.04
卖出股票收入（成交）总额	12,954,227.00

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，农业银行（601288）在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚；招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到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	675,295.89
2	应收清算款	-
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	675,295.89

### 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的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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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 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	
		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 (%)
1,195	42,725.02	5,453,511.00	10.68	36,836,342.00	72.15	8,766,541.00	17.17

### 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	广发证券股份有限公司	2,308,330.00	4.52
2	华泰证券股份有限公司	2,008,892.00	3.93
3	王丹红	1,172,900.00	2.30
4	徐红	1,031,100.00	2.02
5	中信证券股份有限公司	947,331.00	1.86
6	郑晓星	750,000.00	1.47
7	欧阳明贵	649,700.00	1.27
8	迟志均	500,000.00	0.98
9	焦吉元	500,000.00	0.98
10	林子仁	490,000.00	0.96
11	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	8,766,541.00	17.17

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、基金投资和研部	0

门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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 4 月 26 日） 基金份额总额	1,547,056,394.00
本报告期期初基金份额总额	69,056,394.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	51,056,394.00

## § 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的重大人事变动：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

### 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 (%)	
粤开证券	1	4,574,526.19	22.18	914.93	22.18	-

江海证券	2	4,156,595.43	20.16	831.82	20.16	-
国信证券	2	3,520,389.00	17.07	704.29	17.07	-
国联民生 证券	5	2,939,641.00	14.26	588.01	14.25	-
华宝证券	1	2,321,465.68	11.26	464.39	11.26	-
东北证券	2	1,703,939.66	8.26	340.77	8.26	-
金融街证 券	1	1,070,182.00	5.19	213.99	5.19	-
华金证券	2	296,766.00	1.44	59.36	1.44	-
国泰海通 证券	3	37,928.00	0.18	7.59	0.18	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-

银泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-

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、国联证券股份有限公司与民生证券股份有限公司因重大资产重组。根据《国联民生证券股份有限公司关于公司名称及注册资本完成工商变更登记的公告》，自 2025 年 2 月 7 日起，国联证券股份有限公司中文名称变更为“国联民生证券股份有限公司”。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”。

4、本报告期内，退租东方财富证券、东亚前海证券、宏信证券和西南证券的交易单元。

### 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 (%)
粤开证券	17,495.08	72.90	-	-	-	-
江海证券	6,504.00	27.10	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 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
8	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 07 月 11 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 06 月 04 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 05 月 24 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 14 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 10 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 01 日
14	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 03 月 20 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

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。

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日