

华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 08 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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 01 月 01 日起至 2026 年 06 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	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	11
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	14
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	14
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产变动表	18
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	42
7.1	期末基金资产组合情况	42
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	66
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12	投资组合报告附注	67

§ 8	基金份额持有人信息	69
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
§ 9	开放式基金份额变动	70
§ 10	重大事件揭示	71
10.1	基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4	基金投资策略的改变	71
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
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	71
10.8	其他重大事件	72
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 12	备查文件目录	75
12.1	备查文件目录	75
12.2	存放地点	75
12.3	查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰保兴中证全指指数增强	
基金主代码	025755	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 29 日	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,687,598.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴中证全指指数增强 A	华泰保兴中证全指指数增强 C
下属分级基金的交易代码	025755	025756
报告期末下属分级基金的份额总额	3,559,567.83 份	26,128,030.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过基本面及定量分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强投资策略，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，有限度地调整成份股或者各成份股在标的指数中权重的偏离，力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。 本基金可以将标的指数成份股及备选成份股之外的股票纳入基金股票池，并构建主动型投资组合。 在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，年跟踪误差不超过 8%。如因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和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为股票指数增强型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金若投资港股通标的股票，则还会面临港股交易失败风险、汇率风险、境外市场等特有风险。

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		华泰保兴基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王相国	潘琦
	联系电话	021-80299000	0755-22168257
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-632-9090	95511-3
传真		021-60756968	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道 88 号 3810 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200126	518001
法定代表人		杨平	谢永林

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰保兴基金管理有限公司	上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层

§ 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01月01日至2026年06月30日）	
	华泰保兴中证全指指数增强 A	华泰保兴中证全指指数增强 C
本期已实现收益	98,840.03	324,382.98
本期利润	315,988.25	1,810,657.46
加权平均基金份额本期利润	0.0357	0.0295
本期加权平均净值利润率	3.60%	2.98%
本期基金份额净值增长率	4.79%	4.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年06月30日）	
	华泰保兴中证全指指数增强 A	华泰保兴中证全指指数增强 C
期末可供分配利润	88,575.16	596,116.82
期末可供分配基金份额利润	0.0249	0.0228
期末基金资产净值	3,730,506.51	27,327,310.55
期末基金份额净值	1.0480	1.0459
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年06月30日）	
	华泰保兴中证全指指数增强 A	华泰保兴中证全指指数增强 C
基金份额累计净值增长率	4.80%	4.59%

注：1、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。

2、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、所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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴中证全指指数增强 A

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	12.42%	1.29%	11.53%	1.30%	0.89%	-0.01%
过去六个月	4.79%	1.23%	10.19%	1.26%	-5.40%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.80%	1.22%	9.85%	1.25%	-5.05%	-0.03%

华泰保兴中证全指指数增强 C

阶段	份额净值增	份额净值增长	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-------	--------	-------	--------	-----	-----

	长率①	率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	12.31%	1.29%	11.53%	1.30%	0.78%	-0.01%
过去六个月	4.59%	1.23%	10.19%	1.26%	-5.60%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.59%	1.22%	9.85%	1.25%	-5.26%	-0.03%

注：1、本基金合同于 2025 年 12 月 29 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

2、本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

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





注：1、本基金合同于 2025 年 12 月 29 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

2、按照本基金合同约定，建仓期为本基金合同生效之日起六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

华泰保兴基金管理有限公司（以下或简称“公司”或“本公司”）经中国证监会证监许可（2016）1309 号文核准，于 2016 年 07 月 26 日成立，公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司（以下简称“华泰保险集团”）、上海飞恒资产管理中心（有限合伙）（以下简称“飞恒资产”）、上海旷正资产管理中心（有限合伙）（以下简称“旷正资产”）、上海泰颐资产管理中心（有限合伙）（以下简称“泰颐资产”）、上海哲昌资产管理中心（有限合伙）（以下简称“哲昌资产”）、上海志庄资产管理中心（有限合伙）（以下简称“志庄资产”）。公司注册资本人民币 24,000 万元，其中，华泰保险集团持股比例为 85%，飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台，合计持股比例为 15%。2022 年 03 月 25 日，公司设立北京分公司。2024 年 12 月 27 日，公司设立华南分公司。目前，公司经营范围为基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。此外，公司还具有保险资金受托管理资格。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 37 只公募基金，公募基金资产管理总规模为 783.98 亿元人民币，包括货币型、债券型、混合型、股票型、指数型等类型。

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		
王恺钺	基金经理	2025 年 12 月 29 日	—	8 年	南开大学经济学硕士，CPA。历任民生证券股份有限公司研究员、投资经理。2024 年 12 月加入华泰保兴基金管理有限公司。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他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

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统内的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内，未发现各投资组合因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《异常交易监控与报告管理办法》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为，严格监控同一交易日内不同投资组合之间的反向交易。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内，未发生本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的情形，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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 A 股市场整体呈现震荡上行格局，年初在流动性宽松与风险偏好快速提升的带动下，市场成交明显放大，呈现“量价齐升”的特征，有色、AI 应用、商业航天等主题方向表现强势，带动指数快速上行。随后，随着监管层面对市场情绪进行适度引导，前期过热的交易有所降温，市场逐步进入震荡整理阶段。进入二季度，市场情绪阶段性修复，叠加部分外部扰动缓和，成交有所回暖，科技成长、部分资源品等方向表现活跃，带动指数企稳回升；随后，随着全球流动性预期反复及地缘政治不确定性再度升温，风险偏好出现波动，市场一度承压回调，进入存量资金博弈阶段。后期随着外部不确定性逐步落地，市场情绪修复，指数震荡回升。

在投资策略上，产品延续“总量+边际”的分析框架。一方面，从总量维度出发，重点关注企业盈利质量、估值水平与成长性的匹配度，在结构分化中优选具备中长期竞争力的标的；另一方面，从边际变化出发，强化对行业景气度、公司基本面趋势及资金行为的跟踪。在流动性整体充裕但边际收敛的环境下，市场对基本面边际改善的定价权重提升，对估值与短期瑕疵的容忍度有所提高，组合相应增强对边际改善方向的配置。

运作节奏上，季初在流动性宽松与风险偏好快速提升阶段，组合适度增加对中小市值及高弹性方向的配置，把握“量价齐升”带来的收益机会；随着监管引导加强及外部不确定性上升，杠杆资金逐步退潮，组合逐步降低对交易拥挤板块的暴露，转向盈利确定性更强、估值更具性价比的方向。进入二季度，在市场震荡上行与回撤反复的过程中，组合更加注重结构均衡，通过多策略分散单一风格波动带来的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴中证全指指数增强 A 的基金份额净值为 1.0480 元，本报告期内基金份额净值增长率为 4.79%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%；截至本报告期末华泰保兴中证全指指数增强 C 的基金份额净值为 1.0459 元，本报告期内基金份额净值增长率为 4.59%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观与市场环境来看，当前经济基本面呈现增长放缓与结构分化并存的特征。一线城市房地产价格出现止跌回稳迹象，但持续性仍需进一步观察；制造业 PMI 降至临界点附近，呈现供强需弱、价格高企的结构特征。工业企业利润增速延续上行，但内部 K 型分化明显，TMT、半导体及部分出口中高端制造维持较强景气，而消费与地产链仍处于磨底阶段。

流动性视角，国内整体维持稳中偏松但边际收敛的状态。海外方面，地缘政治冲突阶段性缓解

带动油价回落，同时美联储收紧预期有所缓和，但全球流动性仍存在反复不确定性。

从风格与行业角度看，当前科技板块交易热度已接近历史高位，叠加大型 IPO 带来的流动性分流预期以及算力供需变化对 AI 叙事的扰动，短期波动可能加大；与此同时，前期滞涨的价值板块在估值与持仓上均处于低位，市场具备一定再平衡基础。但短期内出现趋势性风格逆转的概率仍有限，基本面仍是核心变量。若海外 AI 资本开支逻辑未被证伪，科技成长仍是景气度最强的主线方向。

展望后续，随着中报季临近，市场定价将更加依赖业绩与景气验证，高景气成长方向有望相对占优。大盘股在盈利确定性提升背景下具备一定优势，但需警惕交易拥挤风险；小盘股在流动性扩散阶段仍具备阶段性机会。整体而言，市场仍以结构性机会为主，组合将继续坚持多策略融合框架，在控制风险与回撤的前提下，动态优化配置结构，力争实现持续稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由公司分管运营副总和投研部门、风险管理部、监察稽核部及运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

投研部门负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，提出适用的估值模型和参数；负责对第三方估值机构的估值质量进行定期评估。风险管理部负责对特殊投资品种的估值技术和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证投研部门提供的估值模型和参数并协助提供数据支持文件。监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核。运营保障部根据相关法规和公司估值管理办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的固定收益品种/在证券交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

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

本基金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的情形，自 2026 年 5 月 12 日至 2026 年 6 月 30 日存在基金资产净值连续二十个工作日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合规守信情况声明

本报告期，平安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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 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：华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	421,266.31	208,456,537.18
结算备付金		300,612.15	-
存出保证金		86,002.67	-
交易性金融资产	6.4.7.2	30,612,742.83	-
其中：股票投资		29,066,140.32	-
基金投资		-	-
债券投资		1,546,602.51	-
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	-	9,968,169.58
应收清算款		251,313.06	117,039,788.02
应收股利		-	-
应收申购款		2,649.26	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		31,674,586.28	335,464,494.78
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 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		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		293,222.46	-
应付赎回款		144,532.47	-
应付管理人报酬		20,291.11	14,703.92
应付托管费		3,804.56	2,756.99
应付销售服务费		8,921.34	7,129.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	2.91
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	145,997.28	-
负债合计		616,769.22	24,593.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	29,687,598.18	335,428,740.28
未分配利润	6.4.7.8	1,370,218.88	11,160.79
净资产合计		31,057,817.06	335,439,901.07
负债和净资产总计		31,674,586.28	335,464,494.78

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，华泰保兴中证全指指数增强 A 基金份额净值 1.0480 元，基金份额总额 3,559,567.83 份；华泰保兴中证全指指数增强 C 基金份额净值 1.0459 元，基金份额总额 26,128,030.35 份。华泰保兴中证全指指数增强份额总额合计为 29,687,598.18 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		2,687,394.94
1. 利息收入		137,002.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	85,667.03
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		51,335.77
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		844,420.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	578,073.16
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	11,073.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	255,274.47
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,703,422.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,548.56
减：二、营业总支出		560,749.23
1. 管理人报酬		292,748.56
2. 托管费		54,890.36
3. 销售服务费		128,799.97

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. 17	-
7. 税金及附加		2. 03
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	84, 308. 31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2, 126, 645. 71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2, 126, 645. 71
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2, 126, 645. 71

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	335, 428, 740. 28	11, 160. 79	335, 439, 901. 07
二、本期期初净资产	335, 428, 740. 28	11, 160. 79	335, 439, 901. 07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-305, 741, 142. 10	1, 359, 058. 09	-304, 382, 084. 01
（一）、综合收益总额	-	2, 126, 645. 71	2, 126, 645. 71
（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）	-305, 741, 142. 10	-767, 587. 62	-306, 508, 729. 72
其中：1. 基金申购款	47, 291, 314. 44	-64, 888. 16	47, 226, 426. 28
2. 基金赎回款	-353, 032, 456. 54	-702, 699. 46	-353, 735, 156. 00
（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、本期期末净资产	29, 687, 598. 18	1, 370, 218. 88	31, 057, 817. 06

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：

王现成

基金管理人负责人

赵俊

主管会计工作负责人

王云凌

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金(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〔2025〕2067 号《关于准予华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由华泰保兴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《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案,《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 335,428,740.28 份基金份额,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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 年上半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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或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，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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益默认以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该类基金份额净值自动转为该类基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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，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、市盈率法、现金流量折现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。

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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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。对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 06 月 30 日
活期存款	421,266.31
等于：本金	421,233.03
加：应计利息	33.28
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	421,266.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		27,373,229.46	-	29,066,140.32	1,692,910.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,517,445.00	18,645.67	1,546,602.51	10,511.84
	银行间市场	-	-	-	-
	小计	1,517,445.00	18,645.67	1,546,602.51	10,511.84
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		28,890,674.46	18,645.67	30,612,742.83	1,703,422.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

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

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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 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	61,694.72
其中：交易所市场	61,694.72
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	24,795.19
应付信息披露费	59,507.37
合计	145,997.28

6.4.7.7 实收基金

华泰保兴中证全指指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,131,982.10	10,131,982.10
本期申购	5,829,329.44	5,829,329.44
本期赎回（以“-”号填列）	-12,401,743.71	-12,401,743.71
本期末	3,559,567.83	3,559,567.83

华泰保兴中证全指指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	325,296,758.18	325,296,758.18
本期申购	41,461,985.00	41,461,985.00
本期赎回（以“-”号填列）	-340,630,712.83	-340,630,712.83
本期末	26,128,030.35	26,128,030.35

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2025 年 11 月 10 日至 2025 年 12 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 335,381,523.79 元，折算为 335,381,523.79 份基金份额（其中 A 类基金份额 10,129,026.96 份，C 类基金份额 325,252,496.83 份）。根据《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期间内认购资金产生的利息收入人民币 47,216.49 元在本基金成立后，折算为 47,216.49 份基金份额（其中 A 类基金份额 2,955.14 份，C 类基金份额 44,261.35 份），划入基金份额持有人账户。

3、根据《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》及《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2025 年 12 月 29 日（基金合同生效日）至 2026 年 01 月 05 日期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换和定期定额投资等业务自 2026 年 01 月 06 日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

华泰保兴中证全指指数增强 A

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	552.50	-	552.50
本期期初	552.50	-	552.50
本期利润	98,840.03	217,148.22	315,988.25
本期基金份额交易产生的变动数	-10,817.37	-134,784.70	-145,602.07
其中：基金申购款	-4,959.71	40,808.60	35,848.89
基金赎回款	-5,857.66	-175,593.30	-181,450.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,575.16	82,363.52	170,938.68

华泰保兴中证全指指数增强 C

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	10,608.29	-	10,608.29
本期期初	10,608.29	-	10,608.29
本期利润	324,382.98	1,486,274.48	1,810,657.46
本期基金份额交易产生的变动数	261,125.55	-883,111.10	-621,985.55
其中：基金申购款	-51,849.92	-48,887.13	-100,737.05
基金赎回款	312,975.47	-834,223.97	-521,248.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	596,116.82	603,163.38	1,199,280.20

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	84,294.47
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	1,284.24
其他	88.32
合计	85,667.03

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	288,373,848.89
减：卖出股票成本总额	287,551,206.64
减：交易费用	244,569.09
买卖股票差价收入	578,073.16

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	11,261.25
债券投资收益--买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-188.00
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	11,073.25

6.4.7.11.2 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01月01日至2026年06月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	2,128,117.72
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	2,100,241.00
减：应计利息总额	28,064.72
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-188.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	255,274.47
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	255,274.47

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,703,422.70
— 股票投资	1,692,910.86
— 债券投资	10,511.84
— 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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,703,422.70

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	2,548.56
合计	2,548.56

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	5.75
合计	84,308.31

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

截至财务报表批准报出日，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
华泰保兴基金管理有限公司（“华泰保兴基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的交易。

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01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	292,748.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	146,277.96
应支付基金管理人的净管理费	146,470.60

注：支付基金管理人华泰保兴基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 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01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	54,890.36

注：支付基金托管人平安银行的托管费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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴中证全指指数增强 A	华泰保兴中证全指指数增强 C	合计
平安银行	-	124,698.23	124,698.23
合计	-	124,698.23	124,698.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰保兴基金，再由华泰保兴基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 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

本基金本报告期内未与关联方进行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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本报告期内基金管理人未持有过本基金份额。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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01月01日至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	421,266.31	84,294.47

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2026 年 06 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：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（张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123274	维科转债	2026 年 06 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	23	2,300.00	2,300.05	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

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

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、董事会审计委员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，检查公司内部风险控制制度的执行情况，并对公司出现的风险问题和存在的风险隐患进行研究并提出处理意见；董事会下设审计委员会，负责检查公司财务，并对公司董事、高级管理人员执行职务的行为进行监督，如公司董事、高级管理人员的行为损害公司或股东的利益时，有权要求其予以纠正。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，其他高级管理人员负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，使得各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控

制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

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评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；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的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及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之内。

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平安银行，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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.9798%（2025 年 12 月 31 日：无）。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 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。

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 6.4.12。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%。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	421,266.31	-	-	-	-	421,266.31
结算备付金	300,612.15	-	-	-	-	300,612.15
存出保证金	86,002.67	-	-	-	-	86,002.67
交易性金融资产	1,518,938.22	27,664.29	-	-	29,066,140.32	30,612,742.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	251,313.06	251,313.06
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	2,649.26	2,649.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,326,819.35	27,664.29	-	-	29,320,102.64	31,674,586.28
负债						
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	293,222.46	293,222.46
应付赎回款	-	-	-	-	144,532.47	144,532.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	20,291.11	20,291.11
应付托管费	-	-	-	-	3,804.56	3,804.56
应付销售服务费	-	-	-	-	8,921.34	8,921.34
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	145,997.28	145,997.28
负债总计	-	-	-	-	616,769.22	616,769.22
利率敏感度缺口	2,326,819.35	27,664.29	-	-	28,703,333.42	31,057,817.06
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	208,456,537.18	-	-	-	-	208,456,537.18
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	9,968,169.58	-	-	-	-	9,968,169.58
应收清算款	-	-	-	-	117,039,788.02	117,039,788.02
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	218,424,706.76	-	-	-	117,039,788.02	335,464,494.78
负债						
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	14,703.92	14,703.92
应付托管费	-	-	-	-	2,756.99	2,756.99
应付销售服务费	-	-	-	-	7,129.89	7,129.89
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	2.91	2.91
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	24,593.71	24,593.71
利率敏感度缺口	218,424,706.76	-	-	-	117,015,194.31	335,439,901.07

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

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

4.9798%（2025 年 12 月 31 日：无），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证券投资品种，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例不低于 80%，其中投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 06 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	29,066,140.32	93.59	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	27,664.29	0.09	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,093,804.61	93.68	-	-

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,791,681.93	-
	业绩比较基准下降 5%	-1,791,681.93	-

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	29,091,504.56	-
第二层次	1,521,238.27	-
第三层次	-	-
合计	30,612,742.83	-

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证券，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证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，确定相关证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 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（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

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	29,066,140.32	91.76
	其中：股票	29,066,140.32	91.76
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,546,602.51	4.88
	其中：债券	1,546,602.51	4.88
	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	721,878.46	2.28
8	其他各项资产	339,964.99	1.07
9	合计	31,674,586.28	100.00

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	52,728.80	0.17
B	采矿业	817,676.00	2.63
C	制造业	20,788,975.30	66.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	893,626.00	2.88
E	建筑业	357,205.00	1.15
F	批发和零售业	488,985.00	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	339,845.72	1.09
H	住宿和餐饮业	58,146.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,909,548.10	6.15
J	金融业	2,000,379.00	6.44
K	房地产业	129,000.00	0.42
L	租赁和商务服务业	198,786.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	515,470.40	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	268,375.00	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	12,400.00	0.04
P	教育	32,496.00	0.10

Q	卫生和社会工作	9,961.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	178,317.00	0.57
S	综合	14,220.00	0.05
	合计	29,066,140.32	93.59

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

本基金本报告期末未持有境内积极投资股票。

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	300308	中际旭创	700	889,000.00	2.86
2	300502	新易盛	800	485,600.00	1.56
3	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.53
4	300750	宁德时代	1,200	471,612.00	1.52
5	688008	澜起科技	1,100	340,890.00	1.10
6	603986	兆易创新	400	326,000.00	1.05
7	300408	三环集团	1,600	267,040.00	0.86
8	600176	中国巨石	3,500	255,080.00	0.82
9	688981	中芯国际	1,500	238,230.00	0.77
10	600519	贵州茅台	200	237,098.00	0.76
11	688012	中微公司	500	234,250.00	0.75
12	601899	紫金矿业	9,200	231,288.00	0.74
13	000811	冰轮环境	3,700	208,014.00	0.67
14	603259	药明康德	1,600	199,216.00	0.64
15	600150	中国船舶	5,600	189,224.00	0.61
16	600030	中信证券	6,100	175,253.00	0.56
17	301045	天禄科技	1,900	169,252.00	0.54
18	600487	亨通光电	1,500	164,010.00	0.53
19	600900	长江电力	6,100	161,467.00	0.52
20	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.49
21	688368	晶丰明源	700	151,564.00	0.49
22	000333	美的集团	2,000	151,060.00	0.49
23	603124	江南新材	800	149,584.00	0.48
24	688041	海光信息	400	148,120.00	0.48
25	605117	德业股份	1,360	144,404.80	0.46
26	601601	中国太保	4,900	139,748.00	0.45
27	601939	建设银行	14,500	139,635.00	0.45

28	603931	格林达	2,300	136,620.00	0.44
29	688388	嘉元科技	3,000	132,000.00	0.43
30	000725	京东方 A	15,000	130,200.00	0.42
31	601988	中国银行	22,700	129,844.00	0.42
32	002049	紫光国微	1,400	124,250.00	0.40
33	688002	睿创微纳	800	123,752.00	0.40
34	300863	卡倍亿	1,600	122,608.00	0.39
35	600872	中炬高新	7,000	121,520.00	0.39
36	600999	招商证券	5,700	120,270.00	0.39
37	300475	香农芯创	400	120,000.00	0.39
38	002415	海康威视	3,500	119,700.00	0.39
39	601328	交通银行	18,600	119,598.00	0.39
40	301321	翰博高新	2,700	119,205.00	0.38
41	688396	华润微	1,200	117,060.00	0.38
42	301536	星辰科技	900	115,839.00	0.37
43	601398	工商银行	16,200	114,534.00	0.37
44	688519	南亚新材	300	114,012.00	0.37
45	688378	奥来德	1,800	111,600.00	0.36
46	603063	禾望电气	2,100	111,069.00	0.36
47	000951	中国重汽	5,600	109,256.00	0.35
48	002463	沪电股份	700	106,960.00	0.34
49	603031	安孚科技	2,000	106,500.00	0.34
50	300054	鼎龙股份	1,000	105,970.00	0.34
51	002384	东山精密	400	104,940.00	0.34
52	603990	麦迪科技	4,900	104,321.00	0.34
53	002803	吉宏股份	4,000	103,360.00	0.33
54	600887	伊利股份	4,300	103,028.00	0.33
55	000776	广发证券	4,400	102,960.00	0.33
56	600036	招商银行	2,900	102,950.00	0.33
57	300857	协创数据	300	101,970.00	0.33
58	600989	宝丰能源	5,000	101,650.00	0.33
59	688416	恒烁股份	700	98,000.00	0.32
60	000408	藏格矿业	1,400	97,048.00	0.31
61	000338	潍柴动力	3,500	95,375.00	0.31
62	001389	广合科技	400	94,900.00	0.31
63	002484	江海股份	900	94,500.00	0.30
64	001309	德明利	100	94,290.00	0.30
65	301371	敷尔佳	3,600	93,600.00	0.30
66	600497	驰宏锌锗	7,700	93,247.00	0.30
67	600885	宏发股份	2,700	93,123.00	0.30
68	000807	云铝股份	4,200	92,988.00	0.30

69	301358	湖南裕能	1,200	91,044.00	0.29
70	301502	华阳智能	1,300	90,376.00	0.29
71	300681	英搏尔	3,100	88,722.00	0.29
72	601126	四方股份	1,400	88,480.00	0.28
73	002371	北方华创	100	88,456.00	0.28
74	301086	鸿富瀚	420	87,897.60	0.28
75	002027	分众传媒	17,900	86,636.00	0.28
76	600886	国投电力	6,500	86,515.00	0.28
77	003816	中国广核	21,800	85,238.00	0.27
78	001359	平安电工	660	82,665.00	0.27
79	688337	普源精电	1,100	82,423.00	0.27
80	301093	华兰股份	600	81,378.00	0.26
81	002841	视源股份	2,300	79,419.00	0.26
82	000651	格力电器	2,100	78,750.00	0.25
83	300394	天孚通信	260	78,696.80	0.25
84	300843	胜蓝股份	500	78,125.00	0.25
85	600919	江苏银行	7,200	77,616.00	0.25
86	600489	中金黄金	4,300	77,615.00	0.25
87	000032	深桑达 A	3,100	77,345.00	0.25
88	603993	洛阳钼业	4,400	77,220.00	0.25
89	002281	光迅科技	300	77,082.00	0.25
90	300606	金太阳	1,800	76,608.00	0.25
91	000657	中钨高新	800	76,576.00	0.25
92	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.25
93	600938	中国海油	2,800	76,020.00	0.24
94	601995	中金公司	2,100	75,915.00	0.24
95	300201	海伦哲	3,600	75,852.00	0.24
96	301150	中一科技	1,200	75,732.00	0.24
97	603678	火炬电子	900	74,700.00	0.24
98	601319	中国人保	10,900	73,684.00	0.24
99	001259	利仁科技	1,100	73,667.00	0.24
100	603989	艾华集团	1,400	73,500.00	0.24
101	301021	英诺激光	600	73,140.00	0.24
102	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.23
103	605289	罗曼股份	500	72,500.00	0.23
104	601336	新华保险	1,200	71,592.00	0.23
105	300687	赛意信息	2,300	71,300.00	0.23
106	301280	珠城科技	1,400	70,798.00	0.23
107	601801	皖新传媒	14,200	70,006.00	0.23
108	301328	维峰电子	980	69,776.00	0.22
109	688628	优利德	700	69,258.00	0.22

110	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.22
111	600941	中国移动	800	68,904.00	0.22
112	601872	招商轮船	3,900	68,523.00	0.22
113	688479	友车科技	1,800	68,346.00	0.22
114	600549	厦门钨业	800	68,160.00	0.22
115	603588	高能环境	3,500	67,200.00	0.22
116	000933	神火股份	3,100	65,720.00	0.21
117	301072	中捷精工	1,600	65,616.00	0.21
118	605020	永和股份	1,600	65,152.00	0.21
119	601766	中国中车	12,500	65,000.00	0.21
120	600535	天士力	4,900	64,827.00	0.21
121	600961	株冶集团	2,000	64,780.00	0.21
122	002768	国恩股份	1,244	64,762.64	0.21
123	600104	上汽集团	6,600	64,416.00	0.21
124	603345	安井食品	800	64,152.00	0.21
125	300909	汇创达	1,100	64,042.00	0.21
126	688090	瑞松科技	600	63,870.00	0.21
127	002273	水晶光电	1,800	63,864.00	0.21
128	002938	鹏鼎控股	600	63,228.00	0.20
129	601916	浙商银行	23,900	62,857.00	0.20
130	601038	一拖股份	5,900	62,481.00	0.20
131	600674	川投能源	4,400	62,348.00	0.20
132	601985	中国核电	6,900	62,307.00	0.20
133	688677	海泰新光	600	60,678.00	0.20
134	605111	新洁能	600	59,484.00	0.19
135	002557	洽洽食品	3,300	59,268.00	0.19
136	300948	冠中生态	2,200	58,586.00	0.19
137	600642	申能股份	6,700	58,491.00	0.19
138	688619	罗普特	3,600	58,428.00	0.19
139	002399	海普瑞	6,500	58,370.00	0.19
140	600160	巨化股份	1,100	58,311.00	0.19
141	002913	奥士康	900	57,546.00	0.19
142	688246	嘉和美康	2,800	57,540.00	0.19
143	002534	西子洁能	3,100	57,505.00	0.19
144	301075	多瑞医药	1,000	57,010.00	0.18
145	605318	法狮龙	500	56,430.00	0.18
146	002475	立讯精密	800	56,320.00	0.18
147	002379	宏桥控股	3,800	56,126.00	0.18
148	301568	思泰克	500	55,800.00	0.18
149	600888	新疆众和	3,500	55,615.00	0.18
150	301285	鸿日达	500	55,165.00	0.18

151	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.18
152	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.18
153	603929	亚翔集成	200	54,404.00	0.18
154	300715	凯伦股份	3,300	54,318.00	0.17
155	688381	帝奥微	1,000	53,500.00	0.17
156	300656	民德电子	1,400	53,326.00	0.17
157	002947	恒铭达	700	53,235.00	0.17
158	300124	汇川技术	800	53,064.00	0.17
159	301122	采纳股份	1,800	52,938.00	0.17
160	300975	商络电子	1,000	51,750.00	0.17
161	601668	中国建筑	11,900	51,646.00	0.17
162	002458	益生股份	6,640	51,592.80	0.17
163	301295	美硕科技	1,200	50,616.00	0.16
164	600367	红星发展	800	50,344.00	0.16
165	002851	麦格米特	300	50,154.00	0.16
166	688301	奕瑞科技	400	49,600.00	0.16
167	300943	春晖智控	1,100	49,445.00	0.16
168	600482	中国动力	1,500	49,200.00	0.16
169	600186	莲花控股	3,500	49,000.00	0.16
170	300938	信测标准	980	48,882.40	0.16
171	300844	山水比德	2,200	48,862.00	0.16
172	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.16
173	600050	中国联通	12,200	48,800.00	0.16
174	603733	仙鹤股份	1,800	48,618.00	0.16
175	002364	中恒电气	900	48,420.00	0.16
176	300033	同花顺	200	48,200.00	0.16
177	600641	先导基电	1,200	47,832.00	0.15
178	301031	中熔电气	400	47,780.00	0.15
179	600233	圆通速递	3,000	47,250.00	0.15
180	603195	公牛集团	1,200	46,980.00	0.15
181	002034	旺能环境	3,100	46,965.00	0.15
182	000783	长江证券	4,800	46,800.00	0.15
183	002645	华宏科技	1,700	46,767.00	0.15
184	688266	泽璟制药	400	46,664.00	0.15
185	300037	新宙邦	500	46,425.00	0.15
186	301002	崧盛股份	1,200	46,320.00	0.15
187	603011	合锻智能	1,400	46,312.00	0.15
188	002033	丽江股份	5,600	46,256.00	0.15
189	688141	杰华特	300	46,050.00	0.15
190	002916	深南电路	100	45,790.00	0.15
191	002643	万润股份	2,100	43,995.00	0.14

192	601816	京沪高铁	9,700	43,941.00	0.14
193	002859	洁美科技	400	43,804.00	0.14
194	301389	隆扬电子	500	43,395.00	0.14
195	600875	东方电气	1,500	43,155.00	0.14
196	688111	金山办公	200	42,610.00	0.14
197	601998	中信银行	6,100	42,273.00	0.14
198	000782	恒申新材	5,200	42,016.00	0.14
199	603808	歌力思	5,500	41,635.00	0.13
200	300319	麦捷科技	1,400	41,482.00	0.13
201	301196	唯科科技	330	41,388.60	0.13
202	605016	百龙创园	1,600	41,360.00	0.13
203	300966	共同药业	1,500	41,265.00	0.13
204	301189	奥尼电子	700	41,251.00	0.13
205	300302	同有科技	800	40,936.00	0.13
206	001339	智微智能	400	40,912.00	0.13
207	000893	亚钾国际	1,000	40,890.00	0.13
208	600259	中稀有色	400	40,644.00	0.13
209	300903	科翔股份	400	40,524.00	0.13
210	605168	三人行	800	40,512.00	0.13
211	601117	中国化学	5,500	40,425.00	0.13
212	300478	杭州高新	1,100	40,359.00	0.13
213	300613	富瀚微	500	40,040.00	0.13
214	688359	三孚新科	200	39,688.00	0.13
215	300413	芒果超媒	2,700	39,501.00	0.13
216	300907	康平科技	700	39,200.00	0.13
217	300998	宁波方正	1,400	38,962.00	0.13
217	600346	恒力石化	2,200	38,962.00	0.13
219	300985	致远新能	1,000	38,500.00	0.12
220	301273	瑞晨环保	1,220	38,442.20	0.12
221	688275	万润新能	300	38,265.00	0.12
222	301055	张小泉	900	38,223.00	0.12
223	603127	昭衍新药	1,000	38,220.00	0.12
224	600563	法拉电子	200	38,160.00	0.12
225	300767	震安科技	1,700	37,893.00	0.12
226	002850	科达利	200	37,860.00	0.12
227	000166	申万宏源	8,600	37,840.00	0.12
228	301307	美利信	500	37,645.00	0.12
229	688383	新益昌	200	37,608.00	0.12
230	600141	兴发集团	800	37,576.00	0.12
231	002532	天山铝业	3,500	37,555.00	0.12
232	300357	我武生物	1,600	37,312.00	0.12

233	600258	首旅酒店	3,400	37,128.00	0.12
234	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.12
235	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.12
236	600869	远东股份	1,100	36,817.00	0.12
237	688035	德邦科技	400	36,720.00	0.12
238	603020	爱普股份	2,600	36,660.00	0.12
239	688398	赛特新材	1,400	36,274.00	0.12
240	603010	万盛股份	2,000	36,240.00	0.12
241	300820	英杰电气	400	36,092.00	0.12
242	688148	芳源股份	4,200	36,036.00	0.12
243	300602	飞荣达	700	35,840.00	0.12
244	601231	环旭电子	1,100	35,640.00	0.11
245	688531	日联科技	200	35,568.00	0.11
246	600566	济川药业	1,600	35,504.00	0.11
247	300497	富祥股份	1,600	35,456.00	0.11
248	301316	慧博云通	900	35,442.00	0.11
249	603150	万朗磁塑	500	35,400.00	0.11
250	600397	江钨装备	1,300	35,399.00	0.11
251	600008	首创环保	13,000	35,360.00	0.11
252	002167	东方锆业	1,600	35,312.00	0.11
253	000598	兴蓉环境	5,500	35,310.00	0.11
254	002648	卫星化学	1,500	35,235.00	0.11
255	301070	开勒股份	400	35,200.00	0.11
256	301286	侨源股份	600	34,794.00	0.11
257	600183	生益科技	200	34,680.00	0.11
258	600390	五矿资本	7,600	34,656.00	0.11
259	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.11
260	002028	思源电气	200	34,600.00	0.11
261	688182	灿勤科技	800	34,456.00	0.11
262	688321	微芯生物	1,300	34,229.00	0.11
263	300604	长川科技	100	34,142.00	0.11
264	688779	五矿新能	4,200	34,062.00	0.11
265	603868	飞科电器	1,100	33,880.00	0.11
266	600884	杉杉股份	2,500	33,875.00	0.11
267	603162	海通发展	3,776	33,870.72	0.11
268	002348	高乐股份	3,200	33,728.00	0.11
269	600595	中孚实业	6,000	33,720.00	0.11
270	300073	当升科技	700	33,628.00	0.11
271	002558	巨人网络	1,200	33,072.00	0.11
272	002142	宁波银行	1,100	32,659.00	0.11
273	300867	圣元环保	1,800	32,616.00	0.11

274	300416	苏试试验	1,600	32,608.00	0.10
275	601238	广汽集团	6,400	32,512.00	0.10
276	605098	行动教育	600	32,496.00	0.10
277	001286	陕西能源	3,200	32,448.00	0.10
278	002443	金洲管道	3,400	32,402.00	0.10
279	002821	凯莱英	200	32,400.00	0.10
280	002969	嘉美包装	2,300	32,384.00	0.10
281	300246	宝莱特	2,300	32,361.00	0.10
282	688247	宣泰医药	4,300	32,336.00	0.10
283	603558	健盛集团	2,900	32,161.00	0.10
284	000553	安道麦 A	6,000	32,100.00	0.10
285	002831	裕同科技	900	32,004.00	0.10
286	300976	达瑞电子	400	31,860.00	0.10
287	002903	宇环数控	700	31,794.00	0.10
288	300567	精测电子	100	31,760.00	0.10
289	601811	新华文轩	2,900	31,726.00	0.10
290	002079	苏州固锟	2,100	31,563.00	0.10
291	600305	恒顺醋业	5,000	31,550.00	0.10
292	300404	博济医药	3,600	31,536.00	0.10
293	300596	利安隆	600	31,488.00	0.10
294	002805	丰元股份	1,100	31,449.00	0.10
295	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.10
296	603285	键邦股份	700	31,367.00	0.10
297	601997	贵阳银行	6,100	31,293.00	0.10
298	301228	实朴检测	400	31,264.00	0.10
299	300855	图南股份	1,000	31,260.00	0.10
300	300489	光智科技	100	31,195.00	0.10
301	601000	唐山港	7,500	31,125.00	0.10
302	002824	和胜股份	900	31,122.00	0.10
303	301182	凯旺科技	300	30,981.00	0.10
304	688690	纳微科技	700	30,870.00	0.10
305	601579	会稽山	2,100	30,849.00	0.10
306	601009	南京银行	3,100	30,659.00	0.10
307	002025	航天电器	400	30,488.00	0.10
308	300490	华自科技	2,300	30,429.00	0.10
309	301219	腾远钴业	550	30,140.00	0.10
310	300400	劲拓股份	800	30,120.00	0.10
311	600803	新奥股份	1,900	30,020.00	0.10
312	301057	汇隆新材	1,300	29,900.00	0.10
313	000960	锡业股份	700	29,883.00	0.10
314	601166	兴业银行	1,800	29,808.00	0.10

315	301053	远信工业	800	29,520.00	0.10
315	600361	创新新材	8,200	29,520.00	0.10
317	600546	山煤国际	2,700	29,511.00	0.10
318	603719	良品铺子	3,400	29,410.00	0.09
319	002961	瑞达期货	1,500	29,370.00	0.09
320	300868	杰美特	200	29,342.00	0.09
321	002487	大金重工	500	28,985.00	0.09
322	300286	安科瑞	1,200	28,980.00	0.09
323	603663	三祥新材	300	28,890.00	0.09
324	601138	工业富联	400	28,860.00	0.09
325	688800	瑞可达	300	28,791.00	0.09
326	300508	维宏股份	500	28,715.00	0.09
327	002885	京泉华	700	28,602.00	0.09
328	000719	中原传媒	2,500	28,575.00	0.09
329	603701	德宏股份	1,300	28,574.00	0.09
330	688385	复旦微电	400	28,516.00	0.09
331	600007	中国国贸	1,500	28,470.00	0.09
332	000672	上峰材料	1,200	28,416.00	0.09
333	300709	精研科技	500	28,125.00	0.09
334	601958	金钼股份	1,000	28,110.00	0.09
335	300689	澄天伟业	400	28,072.00	0.09
336	300051	珩升科技	3,200	28,032.00	0.09
337	688456	有研粉材	200	27,920.00	0.09
338	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.09
339	600499	科达制造	2,000	27,600.00	0.09
340	688218	江苏北人	500	27,480.00	0.09
341	603223	恒通股份	2,100	27,405.00	0.09
342	301290	东星医疗	1,000	27,250.00	0.09
343	688593	新相微	700	27,244.00	0.09
344	300760	迈瑞医疗	200	27,166.00	0.09
345	300790	宇瞳光学	1,040	27,154.40	0.09
346	605376	博迁新材	100	27,130.00	0.09
347	002531	天顺风能	3,200	26,976.00	0.09
348	000151	中成股份	2,500	26,750.00	0.09
349	300491	通合科技	700	26,733.00	0.09
350	002970	锐明技术	500	26,715.00	0.09
351	603936	博敏电子	1,000	26,710.00	0.09
352	600025	华能水电	3,000	26,670.00	0.09
353	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.09
354	605189	富春染织	2,200	26,510.00	0.09
355	601225	陕西煤业	1,300	26,455.00	0.09

356	301571	国科天成	400	26,072.00	0.08
357	601699	潞安环能	1,800	25,704.00	0.08
358	002216	三全食品	2,200	25,366.00	0.08
359	301227	森鹰窗业	1,000	25,210.00	0.08
360	601857	中国石油	2,900	25,172.00	0.08
361	000922	佳电股份	1,800	25,128.00	0.08
362	002955	鸿合科技	700	25,025.00	0.08
363	300151	昌红科技	1,000	24,950.00	0.08
364	300854	中兰环保	1,300	24,804.00	0.08
365	300921	南凌科技	1,220	24,778.20	0.08
366	603156	养元饮品	500	24,535.00	0.08
367	301297	富乐德	400	24,496.00	0.08
368	688045	必易微	300	24,234.00	0.08
369	002602	世纪华通	1,700	23,970.00	0.08
370	600279	重庆港	6,500	23,725.00	0.08
371	605133	嵘泰股份	600	23,622.00	0.08
372	301172	君逸数码	900	23,355.00	0.08
373	688031	星环科技	200	23,036.00	0.07
374	301382	蜂助手	500	23,000.00	0.07
375	001360	南矿集团	1,300	22,997.00	0.07
376	300835	龙磁科技	100	22,949.00	0.07
377	002674	兴业科技	800	22,824.00	0.07
378	600019	宝钢股份	4,200	22,806.00	0.07
379	002001	新和成	800	22,736.00	0.07
380	603186	华正新材	100	22,530.00	0.07
381	002409	雅克科技	100	22,450.00	0.07
382	301349	信德新材	300	22,080.00	0.07
383	688575	亚辉龙	2,500	21,900.00	0.07
384	603823	百合花	400	21,828.00	0.07
385	600027	华电国际	4,900	21,805.00	0.07
386	600026	中远海能	1,200	21,528.00	0.07
387	002202	金风科技	900	21,510.00	0.07
388	300776	帝尔激光	100	21,496.00	0.07
389	603519	立霸股份	1,400	21,420.00	0.07
390	001914	招商积余	2,600	21,216.00	0.07
391	002876	三利谱	600	21,126.00	0.07
392	603233	大参林	1,400	21,042.00	0.07
393	301132	满坤科技	400	21,008.00	0.07
394	000977	浪潮信息	300	21,000.00	0.07
395	300999	金龙鱼	900	20,934.00	0.07
396	000802	北京文化	6,000	20,880.00	0.07

397	688548	广钢气体	400	20,840.00	0.07
398	688106	金宏气体	500	20,740.00	0.07
399	600584	长电科技	200	20,710.00	0.07
400	600011	华能国际	2,700	20,493.00	0.07
401	603826	坤彩科技	800	20,448.00	0.07
402	600055	万东医疗	2,000	20,440.00	0.07
403	605319	无锡振华	900	20,421.00	0.07
404	600585	海螺水泥	1,200	20,340.00	0.07
405	603927	中科软	1,600	20,336.00	0.07
406	600720	中交设计	4,200	20,244.00	0.07
407	688720	艾森股份	200	20,200.00	0.07
408	603679	华体科技	1,000	20,180.00	0.06
409	600716	凤凰股份	6,000	20,160.00	0.06
410	603699	纽威股份	400	20,120.00	0.06
411	300590	移为通信	1,400	20,090.00	0.06
412	603112	华翔股份	1,200	20,076.00	0.06
413	601677	明泰铝业	1,200	19,920.00	0.06
414	603181	皇马科技	1,200	19,464.00	0.06
415	300931	通用电梯	1,300	19,201.00	0.06
416	688328	深科达	200	19,140.00	0.06
417	301526	国际复材	400	18,668.00	0.06
418	002595	豪迈科技	400	18,640.00	0.06
419	300346	南大光电	200	18,530.00	0.06
420	301071	力量钻石	200	18,500.00	0.06
421	000988	华工科技	100	18,461.00	0.06
422	301362	民爆光电	100	18,392.00	0.06
423	601127	赛力斯	300	18,375.00	0.06
424	002134	天津普林	600	18,252.00	0.06
425	300696	爱乐达	700	18,221.00	0.06
426	301448	开创电气	400	18,152.00	0.06
427	000877	天山股份	5,000	18,150.00	0.06
427	688156	路德科技	600	18,150.00	0.06
429	300277	汽轮科技	1,200	18,048.00	0.06
430	600502	安徽建工	4,100	17,835.00	0.06
431	300592	华凯易佰	1,000	17,700.00	0.06
432	601949	中国出版	3,800	17,670.00	0.06
433	002328	新朋股份	2,400	17,616.00	0.06
434	000100	TCL 科技	3,000	17,460.00	0.06
435	000938	紫光股份	600	17,316.00	0.06
436	603609	禾丰股份	3,000	17,280.00	0.06
437	001289	龙源电力	1,100	17,193.00	0.06

438	600216	浙江医药	1,500	17,100.00	0.06
439	600123	兰花科创	3,200	17,088.00	0.06
440	605333	沪光股份	1,000	17,050.00	0.05
441	603338	浙江鼎力	400	17,000.00	0.05
442	002245	蔚蓝锂芯	896	16,764.16	0.05
443	603867	新化股份	500	16,745.00	0.05
444	688276	百克生物	1,200	16,728.00	0.05
445	600098	广州发展	2,800	16,548.00	0.05
446	603688	石英股份	200	16,522.00	0.05
447	600460	士兰微	300	16,398.00	0.05
448	000983	山西焦煤	2,800	16,240.00	0.05
449	002128	电投能源	700	16,184.00	0.05
450	600288	大恒科技	1,200	15,960.00	0.05
451	000630	铜陵有色	2,500	15,900.00	0.05
452	000415	渤海租赁	3,900	15,873.00	0.05
453	600548	深高速	1,900	15,447.00	0.05
454	688336	三生国健	290	15,399.00	0.05
455	301339	通行宝	1,500	15,345.00	0.05
456	603530	神马电力	300	15,270.00	0.05
457	003012	东鹏控股	3,500	15,260.00	0.05
458	300042	朗科科技	200	15,234.00	0.05
459	301608	博实结	300	15,078.00	0.05
460	603277	银都股份	1,500	14,970.00	0.05
461	603618	杭电股份	300	14,964.00	0.05
462	002747	埃斯顿	400	14,932.00	0.05
463	300959	线上线下	100	14,781.00	0.05
464	688549	中巨芯	400	14,724.00	0.05
465	600498	烽火通信	200	14,720.00	0.05
466	300633	开立医疗	800	14,712.00	0.05
467	603515	欧普照明	900	14,706.00	0.05
468	000636	风华高科	200	14,448.00	0.05
469	600909	华安证券	1,300	14,443.00	0.05
470	000683	博源化工	2,500	14,400.00	0.05
471	603071	物产环能	1,300	14,378.00	0.05
472	300661	圣邦股份	100	14,348.00	0.05
473	600620	天宸股份	3,600	14,220.00	0.05
474	002975	博杰股份	100	14,200.00	0.05
475	601991	大唐发电	2,000	14,160.00	0.05
476	601208	东材科技	200	14,158.00	0.05
477	300451	创业慧康	4,400	14,080.00	0.05
478	688551	科威尔	200	14,054.00	0.05

479	601077	渝农商行	2,300	14,053.00	0.05
480	603706	东方环宇	800	13,832.00	0.04
481	603225	新凤鸣	700	13,755.00	0.04
482	603681	永冠新材	600	13,710.00	0.04
483	000423	东阿阿胶	300	13,608.00	0.04
484	600105	永鼎股份	200	13,496.00	0.04
485	002240	盛新锂能	300	13,449.00	0.04
486	688757	胜科纳米	200	13,340.00	0.04
487	688556	高测股份	1,000	13,280.00	0.04
488	002937	兴瑞科技	300	13,179.00	0.04
489	600988	赤峰黄金	500	13,160.00	0.04
490	600345	长江通信	200	13,102.00	0.04
491	603992	松霖科技	400	12,960.00	0.04
492	688083	中望软件	200	12,950.00	0.04
493	301631	壹连科技	180	12,934.80	0.04
494	002373	千方科技	1,800	12,924.00	0.04
495	605167	利柏特	800	12,880.00	0.04
496	300130	新国都	600	12,624.00	0.04
497	688097	博众精工	200	12,610.00	0.04
498	300353	东土科技	600	12,468.00	0.04
499	603170	宝立食品	1,100	12,430.00	0.04
500	301376	致欧科技	700	12,404.00	0.04
501	300736	百邦科技	400	12,400.00	0.04
502	601688	华泰证券	600	12,372.00	0.04
503	002230	科大讯飞	300	12,252.00	0.04
504	600483	福能股份	1,200	12,228.00	0.04
505	300034	钢研高纳	700	11,998.00	0.04
506	002636	金安国纪	100	11,997.00	0.04
507	600469	风神股份	2,200	11,968.00	0.04
508	600372	中航机载	1,100	11,935.00	0.04
509	000975	山金国际	700	11,900.00	0.04
510	600054	黄山旅游	1,100	11,847.00	0.04
511	601088	中国神华	300	11,712.00	0.04
512	688291	金橙子	200	11,696.00	0.04
513	601187	厦门银行	1,700	11,611.00	0.04
514	600547	山东黄金	500	11,545.00	0.04
515	601788	光大证券	800	11,544.00	0.04
516	002120	韵达股份	1,800	11,448.00	0.04
517	301096	百诚医药	200	11,438.00	0.04
518	688323	瑞华泰	200	11,300.00	0.04
519	300908	仲景食品	500	11,020.00	0.04

520	000534	万泽股份	400	10,944.00	0.04
521	603848	好太太	800	10,928.00	0.04
522	603365	水星家纺	700	10,899.00	0.04
523	002091	江苏国泰	1,500	10,845.00	0.03
524	600755	厦门国贸	2,000	10,840.00	0.03
525	601233	桐昆股份	500	10,825.00	0.03
526	600754	锦江酒店	600	10,794.00	0.03
527	601888	中国中免	200	10,742.00	0.03
528	605300	佳禾食品	1,100	10,725.00	0.03
529	688096	京源环保	800	10,688.00	0.03
530	688580	伟思医疗	200	10,654.00	0.03
531	688007	光峰科技	800	10,640.00	0.03
532	002283	天润工业	1,100	10,615.00	0.03
533	301039	中集车辆	1,500	10,575.00	0.03
534	601886	江河集团	1,300	10,439.00	0.03
535	601001	晋控煤业	600	10,434.00	0.03
536	300017	网宿科技	800	10,408.00	0.03
537	002429	兆驰股份	1,000	10,390.00	0.03
538	603306	华懋科技	100	10,369.00	0.03
539	603187	海容冷链	900	10,341.00	0.03
540	002154	报喜鸟	2,900	10,324.00	0.03
541	603899	晨光股份	500	10,315.00	0.03
542	600153	建发股份	1,300	10,309.00	0.03
543	603726	朗迪集团	300	10,275.00	0.03
544	600059	古越龙山	1,400	10,248.00	0.03
545	605108	同庆楼	900	10,224.00	0.03
546	601500	通用股份	2,800	10,220.00	0.03
547	002436	兴森科技	200	10,190.00	0.03
548	600415	小商品城	1,000	10,160.00	0.03
549	002568	百润股份	600	10,152.00	0.03
550	600859	王府井	1,100	10,098.00	0.03
551	688410	山外山	700	10,052.00	0.03
552	300260	新莱应材	100	10,046.00	0.03
553	002867	周大生	900	10,035.00	0.03
554	300118	东方日升	800	9,960.00	0.03
555	000426	兴业银锡	300	9,888.00	0.03
556	600711	盛屯矿业	900	9,873.00	0.03
557	603507	振江股份	300	9,867.00	0.03
558	002972	科安达	500	9,780.00	0.03
559	603538	美诺华	300	9,765.00	0.03
560	300887	谱尼测试	1,400	9,744.00	0.03

560	601898	中煤能源	800	9,744.00	0.03
562	603059	倍加洁	400	9,700.00	0.03
563	002493	荣盛石化	900	9,675.00	0.03
564	300720	海川智能	100	9,620.00	0.03
565	300856	科思股份	900	9,594.00	0.03
566	600223	福瑞达	1,900	9,557.00	0.03
567	002155	湖南黄金	400	9,548.00	0.03
568	603501	豪威集团	100	9,485.00	0.03
569	002646	天佑德酒	1,500	9,465.00	0.03
570	605186	健麾信息	300	9,408.00	0.03
571	603619	中曼石油	500	9,355.00	0.03
572	605299	舒华体育	700	9,345.00	0.03
573	300731	科创新源	160	9,337.60	0.03
574	601107	四川成渝	1,900	9,272.00	0.03
575	003036	泰坦股份	100	9,249.00	0.03
576	002179	中航光电	200	9,240.00	0.03
577	688786	悦安新材	200	9,216.00	0.03
578	002791	坚朗五金	700	9,170.00	0.03
579	301239	普瑞眼科	300	9,135.00	0.03
580	603227	雪峰科技	1,300	9,126.00	0.03
581	603093	南华期货	500	9,075.00	0.03
582	000962	东方钨业	100	9,060.00	0.03
583	001203	大中矿业	300	8,985.00	0.03
584	601975	招商南油	2,400	8,952.00	0.03
585	600392	盛和资源	300	8,931.00	0.03
586	300842	帝科股份	100	8,917.00	0.03
587	603711	香飘飘	800	8,888.00	0.03
588	688626	翔宇医疗	200	8,852.00	0.03
589	601456	国联民生	1,000	8,840.00	0.03
590	300919	中伟新材	200	8,750.00	0.03
591	688517	金冠电气	500	8,740.00	0.03
592	600197	伊力特	900	8,640.00	0.03
593	300726	宏达电子	100	8,457.00	0.03
594	603139	康惠股份	200	8,422.00	0.03
595	301248	杰创智能	100	8,393.00	0.03
596	002074	国轩高科	300	8,253.00	0.03
597	002763	汇洁股份	1,200	8,148.00	0.03
598	603283	赛腾股份	100	8,098.00	0.03
599	000301	东方盛虹	700	8,015.00	0.03
600	605056	咸亨国际	500	8,000.00	0.03
601	002594	比亚迪	100	7,970.00	0.03

602	002414	高德红外	600	7,956.00	0.03
603	689009	九号公司	200	7,630.00	0.02
604	603379	三美股份	100	7,589.00	0.02
605	002156	通富微电	100	7,587.00	0.02
606	300001	特锐德	200	7,566.00	0.02
607	600378	昊华科技	100	7,538.00	0.02
608	301235	华康洁净	100	7,501.00	0.02
609	603296	华勤技术	100	7,427.00	0.02
610	603682	锦和商管	1,000	7,400.00	0.02
611	603409	汇通控股	400	7,340.00	0.02
612	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.02
613	600298	安琪酵母	200	7,240.00	0.02
614	688584	上海合晶	200	7,190.00	0.02
615	600726	华电能源	1,000	7,120.00	0.02
616	300331	苏大维格	100	7,111.00	0.02
617	002736	国信证券	700	6,993.00	0.02
618	600009	上海机场	300	6,930.00	0.02
619	300852	四会富仕	100	6,924.00	0.02
620	300939	秋田微	100	6,920.00	0.02
621	601658	邮储银行	1,400	6,902.00	0.02
622	688051	佳华科技	300	6,894.00	0.02
623	301360	荣旗科技	100	6,849.00	0.02
624	603116	红蜻蜓	1,200	6,816.00	0.02
625	688180	君实生物	200	6,764.00	0.02
626	605588	冠石科技	100	6,717.00	0.02
627	600226	亨通股份	700	6,713.00	0.02
628	002185	华天科技	300	6,693.00	0.02
629	301188	力诺药包	100	6,690.00	0.02
630	002976	瑞玛精密	260	6,552.00	0.02
631	300558	贝达药业	100	6,507.00	0.02
632	002787	华源控股	200	6,440.00	0.02
633	002963	豪尔赛	300	6,318.00	0.02
634	301439	泓淋电力	400	6,288.00	0.02
635	600801	华新建材	400	6,240.00	0.02
636	002733	雄韬股份	200	6,196.00	0.02
637	001314	亿道信息	100	6,180.00	0.02
638	300323	华灿光电	300	6,120.00	0.02
639	300432	富临精工	300	6,027.00	0.02
640	603833	欧派家居	200	6,022.00	0.02
641	301222	浙江恒威	200	5,992.00	0.02
642	603979	金诚信	100	5,903.00	0.02

643	302132	中航成飞	100	5,832.00	0.02
644	603087	甘李药业	100	5,676.00	0.02
645	688599	天合光能	400	5,648.00	0.02
646	600601	方正科技	400	5,536.00	0.02
647	002957	科瑞技术	100	5,484.00	0.02
648	600066	宇通客车	200	5,362.00	0.02
649	001267	汇绿生态	100	5,350.00	0.02
650	002951	金时科技	400	5,344.00	0.02
651	300789	唐源电气	300	5,331.00	0.02
652	300334	津膜科技	500	5,210.00	0.02
653	000848	承德露露	700	5,180.00	0.02
654	002965	祥鑫科技	100	5,095.00	0.02
655	000007	全新好	400	4,960.00	0.02
656	002727	一心堂	500	4,795.00	0.02
657	603766	隆鑫通用	400	4,772.00	0.02
658	300427	红相股份	700	4,697.00	0.02
659	002878	元隆雅图	400	4,620.00	0.01
660	600901	江苏金租	800	4,600.00	0.01
661	601021	春秋航空	100	4,558.00	0.01
662	600396	华电辽能	300	4,488.00	0.01
663	000895	双汇发展	200	4,480.00	0.01
664	605018	长华集团	300	4,473.00	0.01
665	300251	光线传媒	400	4,436.00	0.01
666	600828	茂业商业	1,200	4,296.00	0.01
667	301276	嘉曼服饰	200	4,264.00	0.01
668	002566	益盛药业	700	4,228.00	0.01
669	688728	格科微	200	4,208.00	0.01
670	603201	常润股份	300	4,188.00	0.01
671	300059	东方财富	200	4,076.00	0.01
672	603166	福达股份	300	4,011.00	0.01
673	000737	北方铜业	300	3,966.00	0.01
674	300458	全志科技	100	3,946.00	0.01
675	300106	西部牧业	400	3,936.00	0.01
676	300339	润和软件	100	3,851.00	0.01
677	003007	直真科技	100	3,760.00	0.01
678	001337	四川黄金	100	3,666.00	0.01
679	002396	星网锐捷	190	3,642.30	0.01
680	600461	洪城环境	400	3,624.00	0.01
681	600292	电投水电	300	3,612.00	0.01
682	603707	健友股份	500	3,535.00	0.01
683	300137	先河环保	200	3,488.00	0.01

684	688038	中科通达	200	3,364.00	0.01
685	000739	普洛药业	200	3,332.00	0.01
686	002370	亚太药业	600	3,282.00	0.01
687	002926	华西证券	400	3,268.00	0.01
688	300069	金利华电	100	3,183.00	0.01
689	000987	越秀资本	400	3,128.00	0.01
690	603885	吉祥航空	300	3,087.00	0.01
691	688057	金达莱	200	3,082.00	0.01
692	002056	横店东磁	100	3,048.00	0.01
693	000050	深天马 A	300	2,973.00	0.01
694	600816	建元信托	1,200	2,928.00	0.01
695	000963	华东医药	100	2,812.00	0.01
696	600060	海信视像	100	2,787.00	0.01
697	002801	微光股份	100	2,760.00	0.01
698	601236	红塔证券	400	2,728.00	0.01
699	002905	金逸影视	400	2,700.00	0.01
700	688219	会通股份	200	2,588.00	0.01
701	002402	和而泰	100	2,583.00	0.01
702	000823	超声电子	100	2,565.00	0.01
703	600685	中船防务	100	2,544.00	0.01
704	300144	宋城演艺	400	2,324.00	0.01
705	600089	特变电工	100	2,250.00	0.01
706	600906	财达证券	300	2,238.00	0.01
707	002670	国盛证券	200	2,200.00	0.01
708	001696	宗申动力	100	2,081.00	0.01
709	603967	中创物流	200	2,070.00	0.01
710	601636	旗滨集团	200	2,046.00	0.01
711	600690	海尔智家	100	2,041.00	0.01
712	603269	海鸥股份	120	1,976.40	0.01
713	601288	农业银行	300	1,821.00	0.01
714	000887	中鼎股份	100	1,789.00	0.01
715	601360	三六零	200	1,738.00	0.01
716	002600	领益智造	100	1,734.00	0.01
717	600031	三一重工	100	1,728.00	0.01
718	600000	浦发银行	200	1,722.00	0.01
719	002734	利民股份	100	1,717.00	0.01
720	002815	崇达技术	100	1,659.00	0.01
721	600458	时代新材	100	1,655.00	0.01
722	002236	大华股份	100	1,649.00	0.01
723	300363	博腾股份	100	1,624.00	0.01
724	300221	银禧科技	100	1,607.00	0.01

725	603013	亚普股份	100	1,579.00	0.01
726	600572	康恩贝	400	1,568.00	0.01
727	601311	骆驼股份	200	1,558.00	0.01
728	600741	华域汽车	100	1,552.00	0.00
729	002206	海利得	300	1,551.00	0.00
730	600143	金发科技	100	1,545.00	0.00
731	603637	镇海股份	100	1,526.00	0.00
732	002508	老板电器	100	1,462.00	0.00
733	600131	国网信通	100	1,460.00	0.00
734	000099	中信海直	100	1,456.00	0.00
735	600004	白云机场	200	1,452.00	0.00
736	600926	杭州银行	100	1,445.00	0.00
737	600966	博汇纸业	300	1,434.00	0.00
738	002690	美亚光电	100	1,433.00	0.00
739	002946	新乳业	100	1,408.00	0.00
740	601717	中创智领	100	1,391.00	0.00
741	300012	华测检测	100	1,386.00	0.00
742	002250	联化科技	100	1,367.00	0.00
743	603456	九洲药业	100	1,366.00	0.00
744	603025	大豪科技	100	1,364.00	0.00
745	601033	永兴股份	100	1,340.00	0.00
746	600028	中国石化	300	1,338.00	0.00
747	300797	钢研纳克	100	1,326.00	0.00
748	300341	麦克奥迪	100	1,325.00	0.00
749	601678	滨化股份	200	1,318.00	0.00
750	300515	三德科技	100	1,305.00	0.00
751	002023	海特高新	100	1,296.00	0.00
752	002527	新时达	100	1,283.00	0.00
753	300389	艾比森	100	1,282.00	0.00
754	300989	蕾奥规划	100	1,270.00	0.00
755	601163	三角轮胎	100	1,269.00	0.00
756	002745	木林森	100	1,255.00	0.00
757	603328	依顿电子	100	1,253.00	0.00
758	300741	华宝股份	100	1,252.00	0.00
759	002057	中钢天源	100	1,243.00	0.00
760	002624	完美世界	100	1,242.00	0.00
761	300772	运达股份	100	1,230.00	0.00
762	300206	理邦仪器	100	1,223.00	0.00
763	600352	浙江龙盛	100	1,211.00	0.00
764	600793	宜宾纸业	100	1,203.00	0.00
765	000830	鲁西化工	100	1,200.00	0.00

766	600201	生物股份	100	1,165.00	0.00
767	603500	祥和实业	100	1,162.00	0.00
768	300088	长信科技	100	1,160.00	0.00
769	300200	高盟新材	100	1,149.00	0.00
770	001219	青岛食品	100	1,146.00	0.00
771	002772	众兴菌业	100	1,136.00	0.00
772	603309	维力医疗	100	1,122.00	0.00
773	002811	郑中设计	100	1,119.00	0.00
774	000521	长虹美菱	200	1,086.00	0.00
775	601808	中海油服	100	1,081.00	0.00
776	601061	中信金属	100	1,077.00	0.00
777	002533	金杯电工	100	1,067.00	0.00
778	002011	盾安环境	100	1,061.00	0.00
779	002014	永新股份	100	1,056.00	0.00
780	601865	福莱特	100	1,051.00	0.00
781	601728	中国电信	200	1,038.00	0.00
782	000012	南玻 A	200	1,032.00	0.00
783	601155	新城控股	100	1,026.00	0.00
784	002440	闰土股份	100	1,025.00	0.00
785	601966	玲珑轮胎	100	1,019.00	0.00
786	600583	海油工程	200	1,006.00	0.00
787	601083	锦江航运	100	994.00	0.00
788	002061	浙江交科	300	990.00	0.00
789	002293	罗莱生活	100	989.00	0.00
790	600558	大西洋	200	988.00	0.00
791	600033	福建高速	300	966.00	0.00
792	603408	建霖家居	100	965.00	0.00
793	600567	山鹰国际	700	959.00	0.00
794	002101	广东鸿图	100	954.00	0.00
795	002284	亚太股份	100	949.00	0.00
796	601326	秦港股份	300	948.00	0.00
797	600704	物产中大	200	944.00	0.00
798	600380	健康元	100	942.00	0.00
799	000690	宝新能源	200	940.00	0.00
799	601669	中国电建	200	940.00	0.00
801	600998	九州通	200	938.00	0.00
802	600335	国机汽车	200	936.00	0.00
803	600048	保利发展	200	926.00	0.00
804	000591	太阳能	200	920.00	0.00
805	002060	广东建工	300	909.00	0.00
806	002035	华帝股份	200	904.00	0.00

806	300146	汤臣倍健	100	904.00	0.00
808	002632	道明光学	100	901.00	0.00
809	002248	华东数控	100	900.00	0.00
810	002010	传化智联	200	894.00	0.00
811	601216	君正集团	200	892.00	0.00
812	000002	万科 A	300	888.00	0.00
813	002573	清新环境	300	882.00	0.00
814	600236	桂冠电力	100	878.00	0.00
815	000600	建投能源	100	875.00	0.00
816	600166	福田汽车	300	873.00	0.00
817	601096	宏盛华源	200	868.00	0.00
818	000930	中粮科技	200	850.00	0.00
819	601518	吉林高速	300	840.00	0.00
820	001338	永顺泰	100	839.00	0.00
821	600787	中储股份	200	836.00	0.00
822	601390	中国中铁	200	834.00	0.00
823	600480	凌云股份	100	831.00	0.00
824	300015	爱尔眼科	100	826.00	0.00
825	002286	保龄宝	100	825.00	0.00
826	002372	伟星新材	100	819.00	0.00
827	000785	居然智家	400	800.00	0.00
828	600219	南山铝业	200	798.00	0.00
829	600266	城建发展	200	782.00	0.00
830	002441	众业达	100	780.00	0.00
831	000030	富奥股份	200	774.00	0.00
832	002249	大洋电机	100	750.00	0.00
833	601825	沪农商行	100	749.00	0.00
834	000006	深振业 A	100	748.00	0.00
835	300247	融捷健康	200	734.00	0.00
836	600742	富维股份	100	724.00	0.00
837	000402	金融街	300	723.00	0.00
838	300824	北鼎股份	100	718.00	0.00
839	600970	中材国际	100	713.00	0.00
840	002334	英威腾	100	709.00	0.00
841	601727	上海电气	100	700.00	0.00
842	000157	中联重科	100	697.00	0.00
842	002233	塔牌集团	100	697.00	0.00
844	600983	惠而浦	100	693.00	0.00
845	600382	广东明珠	100	673.00	0.00
846	000501	武商集团	100	669.00	0.00
847	600271	航天信息	100	658.00	0.00

848	600578	京能电力	100	645.00	0.00
849	600016	民生银行	200	644.00	0.00
850	002098	浔兴股份	100	640.00	0.00
851	600015	华夏银行	100	639.00	0.00
852	000031	大悦城	300	636.00	0.00
853	600383	金地集团	300	633.00	0.00
854	000156	华数传媒	100	631.00	0.00
855	002320	海峡股份	100	627.00	0.00
856	002550	千红制药	100	621.00	0.00
857	000027	深圳能源	100	620.00	0.00
857	600210	紫江企业	100	620.00	0.00
857	600496	精工钢构	200	620.00	0.00
860	600339	中油工程	200	614.00	0.00
861	601377	兴业证券	100	604.00	0.00
862	000800	一汽解放	100	595.00	0.00
863	601818	光大银行	200	578.00	0.00
864	002107	沃华医药	100	569.00	0.00
865	000019	深粮控股	100	567.00	0.00
866	603111	康尼机电	100	566.00	0.00
867	300296	利亚德	100	560.00	0.00
868	000726	鲁泰 A	100	543.00	0.00
869	301215	中汽股份	100	519.00	0.00
870	600682	南京新百	100	515.00	0.00
871	601169	北京银行	100	490.00	0.00
872	601218	吉鑫科技	100	430.00	0.00
873	601099	太平洋	100	337.00	0.00
873	601162	天风证券	100	337.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300308	中际旭创	2,501,293.00	0.75
2	600519	贵州茅台	1,965,283.00	0.59
3	300750	宁德时代	1,747,246.00	0.52
4	601899	紫金矿业	1,624,114.00	0.48
5	601601	中国太保	1,329,001.00	0.40

6	600989	宝丰能源	1,184,382.00	0.35
7	300502	新易盛	1,149,405.00	0.34
8	603259	药明康德	1,125,135.00	0.34
9	600036	招商银行	1,118,803.84	0.33
10	688008	澜起科技	1,104,355.76	0.33
11	300274	阳光电源	1,045,518.00	0.31
12	601336	新华保险	1,031,538.00	0.31
13	601398	工商银行	968,467.00	0.29
14	600150	中国船舶	914,189.98	0.27
15	000333	美的集团	913,275.00	0.27
16	601319	中国人保	904,818.00	0.27
17	301031	中熔电气	893,840.00	0.27
18	300033	同花顺	891,137.00	0.27
19	603993	洛阳钼业	880,375.00	0.26
20	600900	长江电力	875,088.00	0.26

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	300308	中际旭创	2,143,255.00	0.64
2	600519	贵州茅台	1,697,499.00	0.51
3	300750	宁德时代	1,438,879.00	0.43
4	601899	紫金矿业	1,191,392.00	0.36
5	600989	宝丰能源	1,188,601.00	0.35
6	601601	中国太保	1,046,193.00	0.31
7	603259	药明康德	1,019,944.00	0.30
8	600036	招商银行	1,001,617.00	0.30
9	300274	阳光电源	979,916.00	0.29
10	301031	中熔电气	909,526.00	0.27
11	300502	新易盛	905,732.00	0.27
12	600176	中国巨石	892,374.00	0.27
13	601398	工商银行	845,734.00	0.25
14	601336	新华保险	842,709.00	0.25
15	688008	澜起科技	842,539.84	0.25
16	601138	工业富联	832,315.00	0.25
17	300394	天孚通信	791,404.00	0.24
18	000333	美的集团	779,995.00	0.23
19	601166	兴业银行	773,136.00	0.23
20	300033	同花顺	766,850.20	0.23

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	314,924,436.10
卖出股票收入（成交）总额	288,373,848.89

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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	1,518,938.22	4.89
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）	27,664.29	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,546,602.51	4.98

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	019785	25 国债 13	15,000	1,518,938.22	4.89
2	127113	长高转债	148	25,364.24	0.08
3	123274	维科转债	23	2,300.05	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资决策程序符合法律法规及公司投资制度有关规定，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

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	86,002.67
2	应收清算款	251,313.06
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,649.26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	339,964.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末持有的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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中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

份额级别	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	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
华泰保兴中证全指 指数增强 A	148	24,051.13	-	-	3,559,567.83	100.00%
华泰保兴中证全指 指数增强 C	549	47,592.04	-	-	26,128,030.35	100.00%
合计	667	44,509.14	-	-	29,687,598.18	100.00%

注：1、机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华泰保兴中证全指指数增 强 A	9,903.92	0.28%
	华泰保兴中证全指指数增 强 C	1,011.83	0.00%
	合计	10,915.75	0.04%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万 份）
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责 人持有本开放式基金	华泰保兴中证全指指数增强 A	0
	华泰保兴中证全指指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本 开放式基金	华泰保兴中证全指指数增强 A	0
	华泰保兴中证全指指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴中证全指指数增强 A	华泰保兴中证全指指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 29 日） 基金份额总额	10,131,982.10	325,296,758.18
本报告期期初基金份额总额	10,131,982.10	325,296,758.18
本报告期基金总申购份额	5,829,329.44	41,461,985.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,401,743.71	340,630,712.83
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,559,567.83	26,128,030.35

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 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，本基金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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本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

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

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	603,298,284.99	100.00%	61,694.72	100.00%	-

注：1、基金管理人选择专用交易单元所属券商的标准如下：

- (1) 财务状况良好，经营行为规范；
- (2) 合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- (3) 内部管理规范、严谨，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

2、基金管理人选择专用交易单元所属券商的程序如下：

基金管理人按照上述选择标准，对交易单元所属券商进行综合评估，并按照规定与符合规定条件的券商签署交易单元租用协议。

3、本基金的股票交易佣金费率标准按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）的规定执行。

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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国联民生证券	4,200,639.00	100.00%	360,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026年01月05日
2	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2026年04月17日
3	华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年04月22日
4	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告	管理人网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2026年04月22日

5	华泰保兴基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露（2025 年度）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年04月30日
6	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加汇添富基金销售（上海）有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2026年06月18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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20260101-20260106	76,312,294.17	-	76,312,294.17	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件
- 2、《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

12.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站 www.ehuataifund.com 查阅
- 3、拨打基金管理人客服热线电话 400-632-9090（免长途话费）查询

华泰保兴基金管理有限公司

2026 年 08 月 29 日