

华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
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	67
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	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	70
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	73
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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强	
基金主代码	019923	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 12 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	847,243,107.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	019923	019924
报告期末下属分级 基金的份额总额	187,545,627.24 份	659,697,480.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	1、股票投资策略 本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。 2、债券投资策略 本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。 3、资产支持证券投资策略 资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。 4、衍生品投资策略 为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。 5、存托凭证投资策略 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略 本基金在参与融资及转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资及转融通证券出借业务。

业绩比较基准	中证 2000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂	任航
	联系电话	021-38601777	010-66060069
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95599
传真		021-38601799	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200135	100031
法定代表人		贾波	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 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 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	54,064,406.01	236,981,743.78
本期利润	54,321,982.06	187,638,846.28
加权平均基金份 额本期利润	0.2671	0.2145
本期加权平均净	13.18%	10.70%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	16. 57%	16. 34%
3. 1. 2 期末数据和指标	报告期末 (2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	196, 947, 911. 71	679, 702, 128. 60
期末可供分配基金份额利润	1. 0501	1. 0303
期末基金资产净值	393, 918, 072. 86	1, 372, 168, 909. 65
期末基金份额净值	2. 1004	2. 0800
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末 (2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	110. 04%	108. 00%

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

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

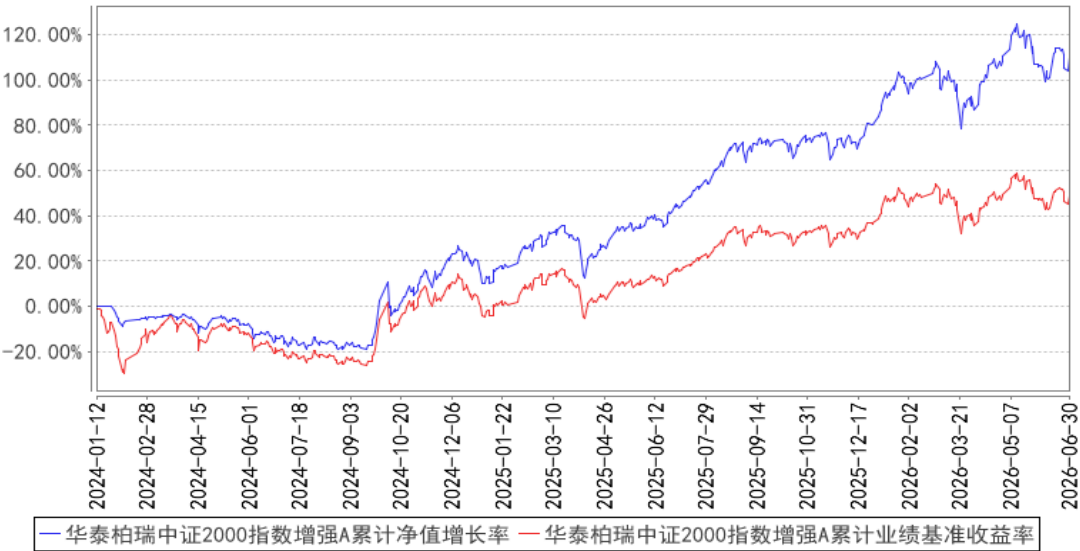
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11. 36%	1. 63%	7. 43%	1. 54%	3. 93%	0. 09%
过去六个月	16. 57%	1. 64%	8. 72%	1. 60%	7. 85%	0. 04%
过去一年	45. 93%	1. 39%	27. 67%	1. 35%	18. 26%	0. 04%
自基金合同生效起至今	110. 04%	1. 64%	48. 52%	1. 90%	61. 52%	-0. 26%

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

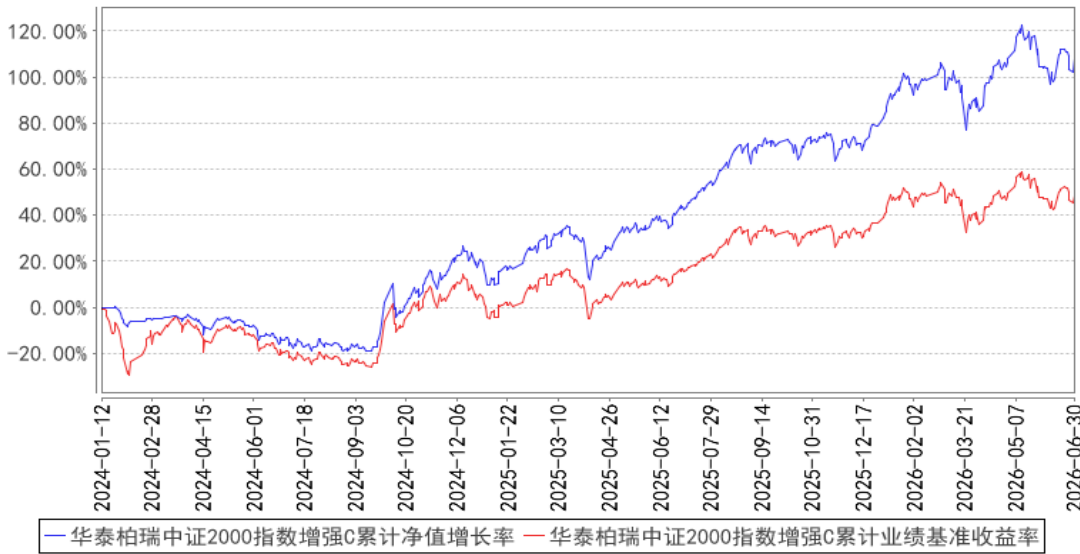
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.24%	1.63%	7.43%	1.54%	3.81%	0.09%
过去六个月	16.34%	1.64%	8.72%	1.60%	7.62%	0.04%
过去一年	45.35%	1.39%	27.67%	1.35%	17.68%	0.04%
自基金合同生效起至今	108.00%	1.64%	48.52%	1.90%	59.48%	-0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞中证2000指数增强A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



华泰柏瑞中证2000指数增强C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：A类图示日期为2024年1月12日至2026年6月30日。C类图示日期为2024年1月12日至2026年6月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、Heron View Partners LLC和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。截至2026年6月30日，公司旗下管理201只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔令焱	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2024年1月12日	—	11年	英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份公司高级分析师。2017年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022年8月至2026年6月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合

					型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
雷文渊	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	7 年	复旦大学数学专业本科、金融专业硕士。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2022 年 8 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。
盛豪	总经理助理、量化与海外投资部总监、本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	18 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。现任总经理助理兼量化与海外投资部总监。2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金。2015 年 10 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018

					年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2024 年 10 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 11 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2025 年 10 月任华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金经理。2026 年 5 月起任华泰柏瑞嘉锐量化选股混合型证券投资基金的基金经理
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
盛豪	公募基金	7	8,567,796,609.71	2015 年 10 月 13 日
	私募资产管理计划	3	4,895,106,552.45	2024 年 11 月 8 日

	其他组合	-	-	-
	合计	10	13,462,903,162.16	-

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《证券投资基金法》等有关法律法规及本基金的基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场整体呈震荡上行态势，指数重心稳步抬升，但板块间分化显著，市场结构轮动加快。年初，商业航天、有色金属、化工等板块领涨，市场风险偏好明显回升；此后受地缘冲突事件扰动，市场短期承压，但随着情绪修复，股指迅速反弹并创出阶段新高。进入二季度，伴随 AI 产业链一季报景气度验证，行情主线逐步向光通信、半导体等科技成长板块切换，算力、光模块等细分领域持续走强，推动创业板指与科创 50 大幅跑赢全市场。交易层面，市场日均成交额一度放大至历史新高，此后稳定维持在 3 万亿以上的较高水平，显示资金参与热情持续高涨，但板块间资金流向不平衡。AI 相关产业链持续获得增量资金青睐，而传统行业则面临明显资金流出，股价与流动性分化加剧，市场交易拥挤度亦呈结构性抬升。

本报告期，代表大盘价值风格的上证 50 小幅回调，下跌 1.38%；沪深 300 则在权重股支撑下上涨 7.55%。成长风格表现尤为突出，创业板指和科创 50 分别上涨 35.58%和 64.25%，显著领跑全市场。中小市值方面，中证 1000 和中证 2000 亦分别录得 15.99%和 9.10%的涨幅，呈现大中盘成长明显跑赢小盘与大盘价值、双创板块表现大幅优于全市场的格局。

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略，股票仓位保持在较高水平，超额收益受仓位影响相对较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 2.1004 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.57%，同期业绩比较基准收益率为 8.72%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 2.0800 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.34%，同期业绩比较基准收益率为 8.72%。

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 年三季度，我们认为短期市场乐观情绪和预期将随着中报验证逐步修正，板块间的极致分化将有一定程度修复，由乐观情绪驱动的跟风资金与被市场分化挤压的调仓资金将面临波动率扩大，前期持续上涨的高拥挤度板块将出现分化。随着改革政策变得更加积极，新兴产业稳步发展，在股票市场整体估值处在合理区间的前提下，市场中长期仍有上涨空间。从行情发展的历史经验总结来看，在流动性保持充裕的前提下，市场风格有可能从估值提升逐渐偏向盈利增长驱动，业绩兑现不达预期的板块可能出现一定波动，板块间分化可能较为显著。

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

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研

究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，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、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，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的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、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：华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	215,225,078.97	97,008,391.53
结算备付金		11,641,774.62	13,994,956.84
存出保证金		5,005,209.60	2,705,035.20
交易性金融资产	6.4.7.2	1,620,361,521.74	1,333,609,259.23
其中：股票投资		1,620,361,521.74	1,333,609,259.23
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,385,671.71	15,288,077.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,862,619,256.64	1,462,605,720.12
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		94,359,259.66	27,251,357.13
应付管理人报酬		1,329,855.38	992,512.24
应付托管费		166,231.91	124,064.03
应付销售服务费		526,826.08	390,554.69
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	22,121.12
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	150,101.10	174,266.91
负债合计		96,532,274.13	28,954,876.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	847,243,107.36	800,503,721.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	918,843,875.15	633,147,122.48
净资产合计		1,766,086,982.51	1,433,650,844.00
负债和净资产总计		1,862,619,256.64	1,462,605,720.12

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 847,243,107.36 份，其中华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金 A 类份额净值 2.1004 元，基金份额总额 187,545,627.24 份；华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金 C 类份额净值 2.0800 元，基金份额总额 659,697,480.12 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		255,196,171.81	52,638,971.49
1. 利息收入		240,463.84	43,073.86
其中：存款利息收入	6.4.7.13	240,463.84	43,073.86
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）		298,167,278.53	31,948,668.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	285,907,082.27	30,004,420.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	5,494,256.11	103,783.62
股利收益	6.4.7.19	6,765,940.15	1,840,464.85

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-49, 085, 321. 45	19, 340, 974. 17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	5, 873, 750. 89	1, 306, 254. 49
减：二、营业总支出		13, 235, 343. 47	1, 779, 519. 45
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	8, 580, 157. 17	1, 126, 146. 21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 072, 519. 61	140, 768. 34
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	3, 475, 264. 88	439, 569. 35
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		22, 529. 25	385. 49
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	84, 872. 56	72, 650. 06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		241, 960, 828. 34	50, 859, 452. 04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		241, 960, 828. 34	50, 859, 452. 04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		241, 960, 828. 34	50, 859, 452. 04

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	800, 503, 721. 52	-	633, 147, 122. 48	1, 433, 650, 844. 0 0

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	800,503,721.52	-	633,147,122.48	1,433,650,844.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	46,739,385.84	-	285,696,752.67	332,436,138.51
(一)、综合收益总额	-	-	241,960,828.34	241,960,828.34
(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)	46,739,385.84	-	43,735,924.33	90,475,310.17
其中：1. 基金申购款	1,866,038,487.44	-	1,868,316,180.97	3,734,354,668.41
2. 基金赎回款	-1,819,299,101.60	-	-1,824,580,256.64	-3,643,879,358.24
(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	847,243,107.36	-	918,843,875.15	1,766,086,982.51
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	146,324,238.50	-	24,019,689.18	170,343,927.68
加：会计政策变更	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	146,324,238.50	-	24,019,689.18	170,343,927.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	137,613,767.22	-	98,925,284.12	236,539,051.34
(一)、综合收益总额	-	-	50,859,452.04	50,859,452.04
(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)	137,613,767.22	-	48,065,832.08	185,679,599.30
其中：1. 基金申购款	621,404,912.02	-	191,335,665.18	812,740,577.20
2. 基金赎回款	- 483,791,144.80	-	- 143,269,833.10	-627,060,977.90
(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	283,938,005.72	-	122,944,973.30	406,882,979.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

崔春

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 2000 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

会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2362 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 432,911,777.68 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 433,027,203.26 份基金份额,其中认购资金利息折合 115,425.58 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)、货币市场工具(含同业存单)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为:投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率 $\times$ 95%+人民币活期存款税后利率 $\times$ 5%。

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 08 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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[2023]39 号《关于减半征收证券

交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易，以资管产品管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)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。

(3)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。

(4)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。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	215,225,078.97
等于：本金	215,213,781.01
加：应计利息	11,297.96
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	215,225,078.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,653,973,104.88	-	1,620,361,521.74	-33,611,583.14
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		1,653,973,104.88	-	1,620,361,521.74	-33,611,583.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	40,643,520.00	-	-	-
其中：股指期货投资	40,643,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	40,643,520.00	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IM2607	中证 1000 股指期货 2607	24.00	41,710,080.00	1,066,560.00
合计				1,066,560.00
减：可抵销期货暂收款				1,066,560.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股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。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37,420.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他应付款	28,378.05
合计	150,101.10

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	175,367,901.63	175,367,901.63
本期申购	165,470,328.82	165,470,328.82
本期赎回（以“-”号填列）	-153,292,603.21	-153,292,603.21

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	187,545,627.24	187,545,627.24

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	625,135,819.89	625,135,819.89
本期申购	1,700,568,158.62	1,700,568,158.62
本期赎回（以“-”号填列）	-1,666,006,498.39	-1,666,006,498.39
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	659,697,480.12	659,697,480.12

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	135,678,216.09	4,939,098.48	140,617,314.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	135,678,216.09	4,939,098.48	140,617,314.57
本期利润	54,064,406.01	257,576.05	54,321,982.06
本期基金份额交易产生的变动数	7,205,289.61	4,227,859.38	11,433,148.99
其中：基金申购款	156,368,731.66	12,683,311.34	169,052,043.00
基金赎回款	-149,163,442.05	-8,455,451.96	-157,618,894.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	196,947,911.71	9,424,533.91	206,372,445.62

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	475,188,250.66	17,341,557.25	492,529,807.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	475,188,250.66	17,341,557.25	492,529,807.91
本期利润	236,981,743.78	-49,342,897.50	187,638,846.28
本期基金份额交易产生的变动数	-32,467,865.84	64,770,641.18	32,302,775.34
其中：基金申购款	1,559,505,601.70	139,758,536.27	1,699,264,137.97
基金赎回款	-1,591,973,467.54	-74,987,895.09	-1,666,961,362.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	679,702,128.60	32,769,300.93	712,471,429.53

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	169,935.56
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	70,352.16
其他	176.12
合计	240,463.84

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	285,907,082.27
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	285,907,082.27

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,829,776,228.95
减：卖出股票成本总额	10,532,724,131.35
减：交易费用	11,145,015.33

买卖股票差价收入	285,907,082.27
----------	----------------

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	5,494,256.11

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,765,940.15
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	6,765,940.15

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-49,279,961.45
股票投资	-49,279,961.45
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	194,640.00
权证投资	-
期货投资	194,640.00
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	-49,085,321.45

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,718,258.44
基金转换费收入	155,492.45

合计	5,873,750.89
----	--------------

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	570.00
合计	84,872.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东的华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
华泰证券	21,694,654,595.52	100.00	2,799,608,527.98	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
华泰证券	4,338,906.71	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
华泰证券	559,995.87	100.00	-	-

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

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

务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,580,157.17	1,126,146.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,929,448.25	248,163.67
应支付基金管理人的净管理费	4,650,708.92	877,982.54

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 0.80%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,072,519.61	140,768.34

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	合计
中国农业银行股份有限公司	—	67,231.86	67,231.86
华泰证券股份有限公司	—	26,536.20	26,536.20
华泰柏瑞基金管理有限公司	—	26,080.20	26,080.20
合计	—	119,848.26	119,848.26

获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 2000 指 数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指 数增强 C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	140,716.40	140,716.40
华泰证券股份有限公司	-	18,917.34	18,917.34
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	4,016.22	4,016.22
合计	-	163,649.96	163,649.96

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.40 \% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人按照与基金管理人约定的时间从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券股份有限公司-券商保证金	153,955,563.43	64,346.49	20,123,278.78	9,475.04
中国农业银行股份有限公司	61,269,515.54	105,589.07	20,023,936.53	19,218.44

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金的券商保证金为存放在华泰证券基金专用账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	301458	钧崑电子	网下申购	3,082	32,052.80
华泰联合证券	603014	威高血净	网下申购	2,029	53,768.50

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩	2026 年 4	6 个月	新股	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

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

				期 内						
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-

603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯	2026 年 3 月	6 个月以上	新股	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-

	科技	月 18 日		锁 定 期 内						
688785	恒 运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂 瑞 微	2025 年 12 月 9 日	6 个月 以上	新 股 锁 定 期 内	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩 尔 线 程	2025 年 11 月 26 日	6 个月 以上	新 股 锁 定 期 内	114.28	676.94	5,562	635,625.36	3,765,140.28	-
688797	臻 宝 科 技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐 曦 股 份	2025 年 12 月 9 日	6 个月 以上	新 股 锁 定 期 内	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新 股 锁 定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

				期 内						
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易 思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电 科 蓝 天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 （ 股 ）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
----------	------------------	------------------	------------------	----------------------------	------------------	----------------------------	-----------------------	----------------------------	----------------------------	--------

688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	4,800	2,255,635.10	4,221,744.00	-
300332	天壕能源	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	4.30	2026 年 7 月 9 日	4.64	578,000	2,691,945.00	2,485,400.00	-

注：本基金截至 2026 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末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

本基金为股票指数增强型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和股指期货投资等。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，力争实现超越标的指数的投资收益，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

作的总结和披露。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)。

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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约

到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	215,225,078.97	-	-	-	-	-	215,225,078.97
结算备付金	11,641,774.62	-	-	-	-	-	11,641,774.62
存出保证金	-	-	-	-	-	5,005,209.60	5,005,209.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,620,361,521.74	1,620,361,521.74
应收申购款	-	-	-	-	-	10,385,671.71	10,385,671.71
资产总计	226,866,853.59	-	-	-	-	1,635,752,403.05	1,862,619,256.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	94,359,259.66	94,359,259.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,329,855.38	1,329,855.38
应付托管费	-	-	-	-	-	166,231.91	166,231.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	526,826.08	526,826.08
其他负债	-	-	-	-	-	150,101.10	150,101.10
负债总计	-	-	-	-	-	96,532,274.13	96,532,274.13
利率敏感度缺口	226,866,853.59	-	-	-	-	1,539,220,128.92	1,766,086,982.51
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	97,008,391.53	-	-	-	-	-	97,008,391.53
结算备付金	13,994,956.84	-	-	-	-	-	13,994,956.84
存出保证金	-	-	-	-	-	2,705,035.20	2,705,035.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,333,609,259.23	1,333,609,259.23
应收申购款	-	-	-	-	-	15,288,077.3	15,288,077.3

						. 32	2
资产总计	111, 003, 348.37	-	-	-	-	1, 351, 602, 371. 75	1, 462, 605, 720. 12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27, 251, 357. 13	27, 251, 357. 13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	992, 512. 24	992, 512. 24
应付托管费	-	-	-	-	-	124, 064. 03	124, 064. 03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	390, 554. 69	390, 554. 69
应交税费	-	-	-	-	-	22, 121. 12	22, 121. 12
其他负债	-	-	-	-	-	174, 266. 91	174, 266. 91
负债总计	-	-	-	-	-	28, 954, 876. 12	28, 954, 876. 12
利率敏感度缺口	111, 003, 348.37	-	-	-	-	1, 322, 647, 495. 63	1, 433, 650, 844. 00

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

6. 4. 13. 4. 1. 2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

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

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

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

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

6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1, 620, 361, 521. 74	91. 75	1, 333, 609, 259. 23	93. 02
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	—	—	—	—
合计	1, 620, 361, 521. 74	91. 75	1, 333, 609, 259. 23	93. 02

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6. 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。

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	84, 222, 495. 18	64, 962, 945. 49
	业绩比较基准下降 5%	-84, 222, 495. 18	-64, 962, 945. 49

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,603,258,849.22	1,328,171,778.66
第二层次	7,557,435.44	-
第三层次	9,545,237.08	5,437,480.57
合计	1,620,361,521.74	1,333,609,259.23

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,620,361,521.74	86.99
	其中：股票	1,620,361,521.74	86.99
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	226,866,853.59	12.18
8	其他各项资产	15,390,881.31	0.83
9	合计	1,862,619,256.64	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	6,403,500.40	0.36
B	采矿业	20,922,169.82	1.18
C	制造业	1,262,787,377.15	71.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,003,816.44	1.53
E	建筑业	24,375,410.00	1.38
F	批发和零售业	42,184,733.00	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	11,420,813.69	0.65
H	住宿和餐饮业	3,553,984.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,855,123.61	6.73
J	金融业	3,171,150.00	0.18
K	房地产业	15,151,673.00	0.86
L	租赁和商务服务业	15,098,622.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	37,256,877.60	2.11
N	水利、环境和公共设施管理业	18,450,853.03	1.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,669,333.00	0.15
Q	卫生和社会工作	572,460.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	9,700,999.00	0.55
S	综合	782,626.00	0.04
	合计	1,620,361,521.74	91.75

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002810	山东赫达	501,000	12,374,700.00	0.70
2	688103	国力电子	162,176	12,067,516.16	0.68
3	301307	美利信	151,300	11,391,377.00	0.65
4	301365	矩阵股份	291,700	11,058,347.00	0.63
5	300656	民德电子	269,300	10,257,637.00	0.58
6	688226	威腾电气	232,200	9,945,126.00	0.56
7	300681	英搏尔	339,200	9,707,904.00	0.55
8	688359	三孚新科	48,841	9,692,008.04	0.55
9	300731	科创新源	159,980	9,336,432.80	0.53
10	002990	盛视科技	115,300	9,108,700.00	0.52
11	001314	亿道信息	146,100	9,028,980.00	0.51
12	301326	捷邦科技	63,600	8,863,932.00	0.50
13	002645	华宏科技	319,300	8,783,943.00	0.50
14	300201	海伦哲	414,300	8,729,301.00	0.49
15	300943	春晖智控	192,350	8,646,132.50	0.49
16	001313	粤海饲料	1,204,600	8,540,614.00	0.48
17	300606	金太阳	196,000	8,341,760.00	0.47
18	300617	安靠智电	156,000	8,266,440.00	0.47
19	603061	金海通	16,300	8,186,186.00	0.46
20	300489	光智科技	26,200	8,173,090.00	0.46
21	002293	罗莱生活	824,300	8,152,327.00	0.46
22	300483	首华燃气	461,600	8,114,928.00	0.46
23	300720	海川智能	84,200	8,100,040.00	0.46
24	688202	美迪西	100,000	8,071,000.00	0.46
25	301128	强瑞技术	51,100	7,966,490.00	0.45
26	301285	鸿日达	71,800	7,921,694.00	0.45
27	300790	宇瞳光学	301,460	7,871,120.60	0.45
28	688307	中润光学	97,600	7,803,120.00	0.44
29	002284	亚太股份	793,000	7,525,570.00	0.43
30	688059	华锐精密	37,132	7,415,631.72	0.42
31	605289	罗曼股份	50,860	7,374,700.00	0.42
32	002787	华源控股	225,500	7,261,100.00	0.41
33	605208	永茂泰	447,700	7,140,815.00	0.40
34	301162	国能日新	163,020	7,132,125.00	0.40
35	300424	航新科技	448,400	7,057,816.00	0.40
36	001212	中旗新材	148,600	7,040,668.00	0.40
37	603186	华正新材	30,900	6,961,770.00	0.39
38	300840	酷特智能	330,000	6,807,900.00	0.39
39	301393	昊帆生物	105,100	6,807,327.00	0.39
40	002885	京泉华	164,200	6,709,212.00	0.38
41	300022	吉峰科技	863,000	6,705,510.00	0.38
42	301265	华新科技	243,200	6,700,160.00	0.38

43	300843	胜蓝股份	42,600	6,656,250.00	0.38
44	300786	国林科技	262,800	6,588,396.00	0.37
45	688518	联赢激光	212,600	6,569,340.00	0.37
46	603558	健盛集团	587,500	6,515,375.00	0.37
47	000782	恒申新材	805,100	6,505,208.00	0.37
48	688609	九联科技	582,200	6,410,022.00	0.36
49	600230	沧州大化	489,900	6,378,498.00	0.36
50	301479	弘景光电	103,860	6,252,372.00	0.35
51	002283	天润工业	646,700	6,240,655.00	0.35
52	301086	鸿富瀚	29,800	6,236,544.00	0.35
53	688035	德邦科技	67,714	6,216,145.20	0.35
54	300938	信测标准	123,520	6,161,177.60	0.35
55	688536	思瑞浦	16,899	6,152,756.91	0.35
56	300473	德尔股份	198,400	6,031,360.00	0.34
57	002034	旺能环境	397,000	6,014,550.00	0.34
58	300863	卡倍亿	78,256	5,996,757.28	0.34
59	301391	卡莱特	104,900	5,989,790.00	0.34
60	300696	爱乐达	229,300	5,968,679.00	0.34
61	605088	冠盛股份	208,100	5,864,258.00	0.33
62	301095	广立微	49,600	5,855,280.00	0.33
63	300596	利安隆	111,100	5,830,528.00	0.33
64	603016	新宏泰	172,700	5,830,352.00	0.33
65	301251	威尔高	108,920	5,803,257.60	0.33
66	300565	科信技术	568,700	5,789,366.00	0.33
67	688556	高测股份	432,000	5,736,960.00	0.32
68	002154	报喜鸟	1,600,900	5,699,204.00	0.32
69	301093	华兰股份	41,700	5,655,771.00	0.32
70	301188	力诺药包	84,000	5,619,600.00	0.32
71	603701	德宏股份	255,200	5,609,296.00	0.32
72	002685	华东重机	862,500	5,571,750.00	0.32
73	603867	新化股份	166,300	5,569,387.00	0.32
74	300612	宣亚国际	504,600	5,515,278.00	0.31
75	002796	世嘉科技	135,000	5,505,300.00	0.31
76	688678	福立旺	227,400	5,496,258.00	0.31
77	603660	苏州科达	448,100	5,489,225.00	0.31
78	002975	博杰股份	38,600	5,481,200.00	0.31
79	002970	锐明技术	102,300	5,465,889.00	0.31
80	300135	宝利国际	1,781,700	5,434,185.00	0.31
81	000036	华联控股	1,243,200	5,432,784.00	0.31
82	688090	瑞松科技	50,900	5,418,305.00	0.31
83	300746	汉嘉数智	499,200	5,396,352.00	0.31
84	300277	汽轮科技	358,700	5,394,848.00	0.31
85	002919	名臣健康	281,500	5,345,685.00	0.30

86	603826	坤彩科技	206,000	5,265,360.00	0.30
87	603270	金帝股份	157,000	5,261,070.00	0.30
88	002803	吉宏股份	203,400	5,255,856.00	0.30
89	600250	南京商旅	680,100	5,243,571.00	0.30
90	300905	宝丽迪	103,500	5,237,100.00	0.30
91	301566	达利凯普	140,400	5,206,032.00	0.29
92	301389	隆扬电子	58,700	5,094,573.00	0.29
93	002628	成都路桥	950,600	5,085,710.00	0.29
94	301248	杰创智能	60,150	5,048,389.50	0.29
95	300448	浩云科技	870,600	5,014,656.00	0.28
96	300426	华智数媒	988,400	5,001,304.00	0.28
97	688028	沃尔德	31,800	4,956,666.00	0.28
98	300745	欣锐科技	117,000	4,939,740.00	0.28
99	301122	采纳股份	167,800	4,934,998.00	0.28
100	300852	四会富仕	71,200	4,929,888.00	0.28
101	603416	信捷电气	93,200	4,927,484.00	0.28
102	605228	神通科技	366,100	4,916,723.00	0.28
103	301172	君逸数码	188,100	4,881,195.00	0.28
104	002870	香山股份	126,100	4,859,894.00	0.28
105	300191	潜能恒信	175,000	4,838,750.00	0.27
106	002943	宇晶股份	108,980	4,820,185.40	0.27
107	001389	广合科技	20,300	4,816,175.00	0.27
108	300903	科翔股份	47,300	4,791,963.00	0.27
109	603090	宏盛股份	93,400	4,769,004.00	0.27
110	600149	廊坊发展	1,054,600	4,735,154.00	0.27
111	300984	金沃股份	88,000	4,728,240.00	0.27
112	300836	佰奥智能	63,900	4,727,961.00	0.27
113	002025	航天电器	61,400	4,679,908.00	0.26
114	601218	吉鑫科技	1,076,300	4,628,090.00	0.26
115	688379	华光新材	54,887	4,612,154.61	0.26
116	002843	泰嘉股份	214,700	4,609,609.00	0.26
117	603158	腾龙股份	375,600	4,593,588.00	0.26
118	600020	中原高速	1,235,167	4,557,766.23	0.26
119	688345	博力威	77,200	4,483,776.00	0.25
120	300438	鹏辉能源	53,800	4,457,330.00	0.25
121	002886	沃特股份	158,500	4,452,265.00	0.25
122	000968	蓝焰控股	739,900	4,432,001.00	0.25
123	002824	和胜股份	128,000	4,426,240.00	0.25
124	600513	联环药业	303,200	4,408,528.00	0.25
125	000700	模塑科技	297,700	4,394,052.00	0.25
126	001339	智微智能	42,770	4,374,515.60	0.25
127	300486	东杰智能	204,500	4,366,075.00	0.25
128	002917	金奥博	413,700	4,360,398.00	0.25

129	301085	亚康股份	71,900	4,357,859.00	0.25
130	601677	明泰铝业	261,000	4,332,600.00	0.25
131	002671	龙泉股份	1,164,200	4,319,182.00	0.24
132	300953	震裕科技	32,300	4,318,510.00	0.24
133	600594	益佰制药	1,449,800	4,305,906.00	0.24
134	002866	传艺科技	260,300	4,255,905.00	0.24
135	600960	渤海汽车	1,052,600	4,241,978.00	0.24
136	688072	拓荆科技	4,800	4,221,744.00	0.24
137	688191	智洋创新	117,880	4,208,316.00	0.24
138	603985	恒润股份	174,400	4,189,088.00	0.24
139	300461	田中精机	112,100	4,152,184.00	0.24
140	605287	德才股份	99,700	4,136,553.00	0.23
141	002638	勤上股份	934,700	4,131,374.00	0.23
142	603150	万朗磁塑	58,100	4,113,480.00	0.23
143	000949	新乡化纤	648,200	4,109,588.00	0.23
144	000919	金陵药业	702,400	4,094,992.00	0.23
145	300890	翔丰华	122,200	4,053,374.00	0.23
146	002079	苏州固锟	268,200	4,031,046.00	0.23
147	002301	齐心集团	550,500	3,980,115.00	0.23
148	000989	九芝堂	511,700	3,975,909.00	0.23
149	603617	君禾股份	553,800	3,943,056.00	0.22
150	300523	辰安科技	212,000	3,896,560.00	0.22
151	301191	菲菱科思	34,040	3,865,242.00	0.22
152	600590	泰豪科技	382,000	3,858,200.00	0.22
153	002738	中矿资源	65,300	3,852,047.00	0.22
154	000863	三湘印象	912,000	3,830,400.00	0.22
155	603222	济民健康	451,400	3,814,330.00	0.22
156	300151	昌红科技	152,300	3,799,885.00	0.22
157	300858	科拓生物	249,600	3,791,424.00	0.21
158	605133	嵘泰股份	96,047	3,781,370.39	0.21
159	688795	摩尔线程	5,562	3,765,140.28	0.21
160	301529	福赛科技	38,940	3,752,258.40	0.21
161	300331	苏大维格	52,700	3,747,497.00	0.21
162	603285	键邦股份	83,300	3,732,673.00	0.21
163	300661	圣邦股份	26,000	3,730,480.00	0.21
164	300587	天铁科技	967,700	3,725,645.00	0.21
165	000819	岳阳兴长	328,100	3,717,373.00	0.21
166	300763	锦浪科技	41,114	3,714,649.90	0.21
167	301066	万事利	319,900	3,714,039.00	0.21
168	002802	洪汇新材	351,800	3,700,936.00	0.21
169	002479	富春环保	863,700	3,636,177.00	0.21
170	300740	水羊股份	197,100	3,628,611.00	0.21
171	300867	圣元环保	199,400	3,613,128.00	0.20

172	603031	安孚科技	67,800	3,610,350.00	0.20
173	600135	乐凯胶片	449,900	3,594,701.00	0.20
174	301111	粤万年青	137,800	3,566,264.00	0.20
175	300683	海特生物	141,900	3,548,919.00	0.20
176	688679	通源环境	83,807	3,527,436.63	0.20
177	000428	华天酒店	1,157,100	3,517,584.00	0.20
178	002150	正泰电源	139,000	3,515,310.00	0.20
179	300223	北京君正	14,100	3,509,490.00	0.20
180	688428	诺诚健华	123,129	3,505,482.63	0.20
181	301349	信德新材	47,600	3,503,360.00	0.20
182	688500	慧辰股份	77,200	3,499,476.00	0.20
183	301193	家联科技	188,081	3,487,021.74	0.20
184	603038	华立股份	221,000	3,447,600.00	0.20
185	603115	海星股份	28,100	3,441,407.00	0.19
186	002757	南兴股份	190,400	3,436,720.00	0.19
187	603977	国泰集团	205,300	3,389,503.00	0.19
188	688388	嘉元科技	77,000	3,388,000.00	0.19
189	002752	昇兴股份	613,600	3,387,072.00	0.19
190	688319	欧林生物	76,000	3,342,480.00	0.19
191	002384	东山精密	12,700	3,331,845.00	0.19
192	000593	德龙汇能	155,700	3,328,866.00	0.19
193	002111	威海广泰	368,800	3,319,200.00	0.19
194	688167	炬光科技	9,300	3,294,153.00	0.19
195	002246	北化股份	175,100	3,291,880.00	0.19
196	000510	新金路	131,700	3,271,428.00	0.19
197	301603	乔锋智能	22,700	3,264,260.00	0.18
198	300959	线上线下	22,000	3,251,820.00	0.18
199	603333	福华尚纬	401,600	3,236,896.00	0.18
200	301317	鑫磊股份	57,400	3,221,288.00	0.18
201	002793	罗欣药业	835,800	3,209,472.00	0.18
202	300619	金银河	102,830	3,199,041.30	0.18
203	301081	严牌股份	233,700	3,197,016.00	0.18
204	600727	鲁北化工	473,700	3,183,264.00	0.18
205	300756	金马游乐	96,232	3,180,467.60	0.18
206	300328	宜安科技	225,200	3,161,808.00	0.18
207	002916	深南电路	6,800	3,113,720.00	0.18
208	300788	中信出版	138,500	3,112,095.00	0.18
209	301468	博盈特焊	74,600	3,111,566.00	0.18
210	603126	中材节能	488,500	3,077,550.00	0.17
211	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.17
212	601579	会稽山	209,000	3,070,210.00	0.17
213	300511	雪榕生物	610,100	3,068,803.00	0.17
214	300862	蓝盾光电	145,540	3,033,053.60	0.17

215	000652	泰达股份	880,900	3,003,869.00	0.17
216	688097	博众精工	47,600	3,001,180.00	0.17
217	300986	志特新材	174,400	2,990,960.00	0.17
218	000501	武商集团	443,800	2,969,022.00	0.17
219	301321	翰博高新	67,100	2,962,465.00	0.17
220	301373	凌玮科技	19,000	2,954,500.00	0.17
221	601789	宁波建工	732,000	2,935,320.00	0.17
222	605168	三人行	57,900	2,932,056.00	0.17
223	002833	弘亚数控	151,058	2,913,908.82	0.16
224	300137	先河环保	166,500	2,903,760.00	0.16
225	301246	宏源药业	107,400	2,889,060.00	0.16
226	688717	艾罗能源	34,844	2,877,069.08	0.16
227	300853	申昊科技	92,800	2,866,592.00	0.16
228	688258	卓易信息	24,000	2,844,960.00	0.16
229	600506	统一股份	204,400	2,839,116.00	0.16
230	002274	华昌化工	612,300	2,834,949.00	0.16
231	688337	普源精电	37,800	2,832,354.00	0.16
232	600605	汇通能源	97,900	2,831,268.00	0.16
233	001376	百通能源	272,000	2,828,800.00	0.16
234	688691	灿芯股份	24,000	2,782,320.00	0.16
235	002107	沃华医药	486,000	2,765,340.00	0.16
236	300553	集智股份	44,900	2,756,411.00	0.16
237	002115	三维通信	267,400	2,754,220.00	0.16
238	688787	海天瑞声	20,400	2,742,780.00	0.16
239	300568	星源材质	146,300	2,738,736.00	0.16
240	600203	福日电子	223,600	2,716,740.00	0.15
241	603336	宏辉果蔬	339,200	2,686,464.00	0.15
242	600215	派斯林	462,600	2,683,080.00	0.15
243	603121	华培动力	227,600	2,674,300.00	0.15
244	600661	昂立教育	386,300	2,669,333.00	0.15
245	688253	英诺特	44,181	2,663,230.68	0.15
246	301012	扬电科技	112,700	2,647,323.00	0.15
247	002286	保龄宝	317,400	2,618,550.00	0.15
248	301382	蜂助手	56,800	2,612,800.00	0.15
249	603387	基蛋生物	343,900	2,599,884.00	0.15
250	002782	可立克	123,000	2,589,150.00	0.15
251	688275	万润新能	20,200	2,576,510.00	0.15
252	300121	阳谷华泰	204,300	2,574,180.00	0.15
253	603790	雅运股份	120,500	2,571,470.00	0.15
254	600489	中金黄金	142,300	2,568,515.00	0.15
255	002377	国创高新	1,016,400	2,561,328.00	0.15
256	603124	江南新材	13,600	2,542,928.00	0.14
257	688719	爱科赛博	33,000	2,541,000.00	0.14

258	688700	东威科技	28,400	2,538,960.00	0.14
259	002432	九安医疗	35,600	2,516,208.00	0.14
260	300429	强力新材	141,700	2,510,924.00	0.14
261	603538	美诺华	76,600	2,493,330.00	0.14
262	603585	苏利股份	182,300	2,492,041.00	0.14
263	300050	世纪鼎利	420,700	2,490,544.00	0.14
264	002730	电光科技	83,200	2,488,512.00	0.14
265	300332	天壕能源	578,000	2,485,400.00	0.14
266	300055	万邦达	382,800	2,461,404.00	0.14
267	000803	山高环能	361,380	2,450,156.40	0.14
268	002708	光洋股份	185,600	2,448,064.00	0.14
269	002982	湘佳股份	231,748	2,444,941.40	0.14
270	300898	熊猫乳品	134,300	2,433,516.00	0.14
271	301587	中瑞股份	110,600	2,427,670.00	0.14
272	002443	金洲管道	254,600	2,426,338.00	0.14
273	301205	联特科技	7,200	2,405,520.00	0.14
274	300073	当升科技	49,700	2,387,588.00	0.14
275	003019	宸展光电	72,900	2,372,895.00	0.13
276	301201	诚达药业	65,100	2,367,036.00	0.13
277	000822	山东海化	587,000	2,359,740.00	0.13
278	600829	人民同泰	304,000	2,359,040.00	0.13
279	300700	岱勒新材	109,700	2,334,416.00	0.13
280	688553	汇宇制药	216,704	2,303,563.52	0.13
281	301607	富特科技	44,016	2,299,836.00	0.13
282	300308	中际旭创	1,800	2,286,000.00	0.13
283	603969	银龙股份	312,100	2,268,967.00	0.13
284	600526	菲达环保	549,600	2,258,856.00	0.13
285	300501	海顺新材	177,700	2,256,790.00	0.13
286	603076	乐惠国际	108,200	2,241,904.00	0.13
287	301013	利和兴	31,000	2,239,750.00	0.13
288	688079	美迪凯	72,800	2,238,600.00	0.13
289	300987	川网传媒	181,200	2,228,760.00	0.13
290	688176	亚虹医药	224,400	2,226,048.00	0.13
291	603366	日出东方	305,500	2,220,985.00	0.13
292	300572	安车检测	78,000	2,212,860.00	0.13
293	300658	延江股份	192,900	2,204,847.00	0.12
294	300835	龙磁科技	9,600	2,203,104.00	0.12
295	301316	慧博云通	55,600	2,189,528.00	0.12
296	688312	燕麦科技	26,000	2,183,740.00	0.12
297	600976	健民集团	87,400	2,177,134.00	0.12
298	300690	双一科技	96,200	2,149,108.00	0.12
299	300240	飞力达	430,400	2,147,696.00	0.12
300	300508	维宏股份	37,300	2,142,139.00	0.12

301	600106	重庆路桥	467,000	2,138,860.00	0.12
302	002235	安妮股份	275,000	2,131,250.00	0.12
303	688182	灿勤科技	49,000	2,110,430.00	0.12
304	603931	格林达	35,400	2,102,760.00	0.12
305	688503	聚和材料	15,800	2,096,660.00	0.12
306	002379	宏桥控股	139,300	2,057,461.00	0.12
307	688720	艾森股份	20,200	2,040,200.00	0.12
308	002829	星网宇达	115,900	2,035,204.00	0.12
309	002264	新华都	355,500	2,005,020.00	0.11
310	688197	首药控股	60,000	2,004,600.00	0.11
311	002923	润都股份	210,900	1,995,114.00	0.11
312	002995	天地在线	112,700	1,992,536.00	0.11
313	688800	瑞可达	20,400	1,957,788.00	0.11
314	300254	仟源医药	239,500	1,918,395.00	0.11
315	603175	超颖电子	21,300	1,897,617.00	0.11
316	001316	润贝航科	56,800	1,873,264.00	0.11
317	688256	寒武纪	1,164	1,857,220.20	0.11
318	300569	天能重工	382,400	1,843,168.00	0.10
319	688328	深科达	18,800	1,799,160.00	0.10
320	688110	东芯股份	8,812	1,795,004.40	0.10
321	300975	商络电子	34,500	1,785,375.00	0.10
322	002460	赣锋锂业	27,200	1,778,880.00	0.10
323	002497	雅化集团	87,300	1,778,301.00	0.10
324	603626	科森科技	94,700	1,751,950.00	0.10
325	002695	煌上煌	171,700	1,742,755.00	0.10
326	601339	百隆东方	256,900	1,739,213.00	0.10
327	603421	鼎信通讯	282,200	1,735,530.00	0.10
328	688593	新相微	44,200	1,720,264.00	0.10
329	600962	国投中鲁	56,400	1,701,588.00	0.10
330	300539	横河精密	82,300	1,676,451.00	0.09
331	002545	东方铁塔	103,100	1,672,282.00	0.09
332	605056	咸亨国际	104,500	1,672,000.00	0.09
333	300757	罗博特科	2,700	1,671,300.00	0.09
334	300991	创益通	47,300	1,665,433.00	0.09
335	300267	尔康制药	503,800	1,662,540.00	0.09
336	600549	厦门钨业	19,500	1,661,400.00	0.09
337	603196	璞源材料	67,600	1,652,144.00	0.09
338	300952	恒辉安防	94,600	1,646,040.00	0.09
339	002169	智光电气	112,300	1,644,072.00	0.09
340	300748	金力永磁	53,100	1,638,135.00	0.09
341	000589	贵州轮胎	399,600	1,622,376.00	0.09
342	603615	茶花股份	100,200	1,618,230.00	0.09
343	603738	泰晶科技	26,900	1,615,345.00	0.09

344	301516	中远通	113,900	1,611,685.00	0.09
345	688181	八亿时空	25,600	1,602,560.00	0.09
346	002805	丰元股份	56,000	1,601,040.00	0.09
347	002905	金逸影视	235,200	1,587,600.00	0.09
348	002980	华盛昌	13,600	1,584,944.00	0.09
349	688291	金橙子	27,000	1,578,960.00	0.09
350	300798	锦鸡股份	241,800	1,578,954.00	0.09
351	002615	哈尔斯	228,100	1,573,890.00	0.09
352	002560	通达股份	211,000	1,569,840.00	0.09
353	688218	江苏北人	28,400	1,560,864.00	0.09
354	300951	博硕科技	30,800	1,555,400.00	0.09
355	688381	帝奥微	29,000	1,551,500.00	0.09
356	301302	华如科技	57,300	1,542,516.00	0.09
357	003023	彩虹集团	79,200	1,539,648.00	0.09
358	300842	帝科股份	17,100	1,524,807.00	0.09
359	300990	同飞股份	14,200	1,491,994.00	0.08
360	300400	劲拓股份	39,300	1,479,645.00	0.08
361	603085	天成自控	135,900	1,477,233.00	0.08
362	603590	康辰药业	50,800	1,473,708.00	0.08
363	001267	汇绿生态	27,500	1,471,250.00	0.08
364	300819	聚杰微纤	19,600	1,450,792.00	0.08
365	603960	克来机电	82,900	1,443,289.00	0.08
366	605376	博迁新材	5,300	1,437,890.00	0.08
367	001317	三羊马	36,200	1,432,796.00	0.08
368	000905	厦门港务	184,300	1,430,168.00	0.08
369	002238	天威视讯	264,300	1,427,220.00	0.08
370	300536	农尚环境	168,100	1,427,169.00	0.08
371	002627	三峡旅游	248,900	1,421,219.00	0.08
372	600641	先导基电	35,500	1,415,030.00	0.08
373	600838	上海九百	197,800	1,414,270.00	0.08
374	300381	溢多利	248,400	1,396,008.00	0.08
375	300404	博济医药	159,200	1,394,592.00	0.08
376	603777	来伊份	89,300	1,386,829.00	0.08
377	300351	永贵电器	82,700	1,364,550.00	0.08
378	688135	利扬芯片	32,200	1,354,976.00	0.08
379	300004	南风股份	132,900	1,342,290.00	0.08
380	300590	移为通信	93,100	1,335,985.00	0.08
381	300086	康芝药业	226,300	1,335,170.00	0.08
382	600288	大恒科技	100,200	1,332,660.00	0.08
383	603095	越剑智能	92,900	1,330,328.00	0.08
384	688255	凯尔达	47,400	1,317,720.00	0.07
385	002187	广百股份	281,500	1,317,420.00	0.07
386	301076	新瀚新材	49,430	1,294,077.40	0.07

387	605299	舒华体育	96,900	1,293,615.00	0.07
388	601700	风范股份	290,700	1,267,452.00	0.07
389	002166	莱茵生物	197,700	1,241,556.00	0.07
390	002250	联化科技	90,800	1,241,236.00	0.07
391	300222	科大智能	89,400	1,238,190.00	0.07
392	600468	百利电气	203,900	1,237,673.00	0.07
393	603665	康隆达	48,300	1,236,963.00	0.07
394	301226	祥明智能	37,200	1,234,668.00	0.07
395	002589	瑞康医药	501,700	1,234,182.00	0.07
396	603929	亚翔集成	4,500	1,224,090.00	0.07
397	688488	艾迪药业	94,800	1,218,180.00	0.07
398	688205	德科立	5,800	1,207,502.00	0.07
399	603315	福鞍股份	79,600	1,192,408.00	0.07
400	300828	锐新科技	58,400	1,179,096.00	0.07
401	300955	嘉亨家化	32,200	1,162,098.00	0.07
402	301387	光大同创	12,400	1,146,008.00	0.06
403	688369	致远互联	53,600	1,126,136.00	0.06
404	000570	苏常柴 A	234,800	1,096,516.00	0.06
405	300488	恒锋工具	23,100	1,081,773.00	0.06
406	002016	世荣兆业	269,000	1,076,000.00	0.06
407	002899	英派斯	49,300	1,074,740.00	0.06
408	600785	新华百货	109,600	1,074,080.00	0.06
409	600397	江钨装备	38,700	1,053,801.00	0.06
410	002218	拓日新能	273,600	1,050,624.00	0.06
411	603138	海量数据	74,500	1,046,725.00	0.06
412	603897	长城科技	32,000	1,038,720.00	0.06
413	300689	澄天伟业	14,800	1,038,664.00	0.06
414	603668	天马科技	80,400	1,017,864.00	0.06
415	688141	杰华特	6,600	1,013,100.00	0.06
416	603920	世运电路	21,000	1,008,840.00	0.06
417	601886	江河集团	125,200	1,005,356.00	0.06
418	002135	东南网架	147,800	1,003,562.00	0.06
419	300947	德必集团	78,300	998,325.00	0.06
420	002979	雷赛智能	17,800	992,884.00	0.06
421	000534	万泽股份	36,200	990,432.00	0.06
422	301220	亚香股份	30,700	989,154.00	0.06
423	300249	依米康	63,600	979,440.00	0.06
424	000717	中南股份	486,700	978,267.00	0.06
425	002947	恒铭达	12,800	973,440.00	0.06
426	002860	星帅尔	65,800	960,022.00	0.05
427	688095	福昕软件	16,000	950,880.00	0.05
428	300542	新晨科技	85,000	941,800.00	0.05
429	603980	吉华集团	140,900	935,576.00	0.05

430	603127	昭衍新药	24,400	932,568.00	0.05
431	002578	闽发铝业	288,900	910,035.00	0.05
432	600681	百川能源	275,700	890,511.00	0.05
433	301099	雅创电子	9,300	888,150.00	0.05
434	300358	楚天科技	110,800	886,400.00	0.05
435	000565	渝三峡 A	155,300	882,104.00	0.05
436	300107	建新股份	157,500	882,000.00	0.05
437	002369	卓翼科技	162,300	881,289.00	0.05
438	600626	申达股份	275,200	877,888.00	0.05
439	688376	美埃科技	7,400	860,620.00	0.05
440	300814	中富电路	4,200	858,900.00	0.05
441	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.05
442	301338	凯格精机	5,200	847,028.00	0.05
443	600152	维科技术	84,600	845,154.00	0.05
444	300622	博士眼镜	58,900	821,066.00	0.05
445	002788	鹭燕医药	81,300	815,439.00	0.05
446	688173	希荻微	42,000	803,880.00	0.05
447	300629	新劲刚	37,400	802,604.00	0.05
448	301252	同星科技	19,800	802,494.00	0.05
449	301117	佳缘科技	34,160	797,636.00	0.05
450	301032	新柴股份	84,300	783,990.00	0.04
451	600500	中化国际	100,000	783,000.00	0.04
452	600805	悦达投资	194,200	782,626.00	0.04
453	002228	合兴包装	262,300	771,162.00	0.04
454	002375	亚厦股份	225,600	762,528.00	0.04
455	688499	利元亨	14,400	756,720.00	0.04
456	002008	大族激光	5,000	750,550.00	0.04
457	600999	招商证券	35,300	744,830.00	0.04
458	002255	海陆重工	74,800	734,536.00	0.04
459	601616	广电电气	214,800	732,468.00	0.04
460	002876	三利谱	20,600	725,326.00	0.04
461	603051	鹿山新材	37,600	724,928.00	0.04
462	003018	金富科技	9,500	724,185.00	0.04
463	301018	申菱环境	6,200	716,782.00	0.04
464	002319	乐通股份	69,400	716,208.00	0.04
465	603507	振江股份	21,600	710,424.00	0.04
466	300578	会畅科技	40,700	707,773.00	0.04
467	000509	华塑控股	188,800	704,224.00	0.04
468	001301	尚太科技	7,400	691,974.00	0.04
469	002986	宇新股份	58,300	689,689.00	0.04
470	000554	泰山石油	122,800	688,908.00	0.04
471	300803	指南针	7,500	687,525.00	0.04
472	603122	合富中国	62,300	682,808.00	0.04

473	300128	锦富技术	109,800	650,016.00	0.04
474	688107	安路科技	14,200	647,520.00	0.04
475	603619	中曼石油	34,600	647,366.00	0.04
476	301489	思泉新材	3,920	645,153.60	0.04
477	605169	洪通燃气	70,800	629,412.00	0.04
478	603703	盛洋科技	56,600	628,260.00	0.04
479	301568	思泰克	5,600	624,960.00	0.04
480	301261	恒工精密	8,000	624,800.00	0.04
481	603933	睿能科技	27,700	624,635.00	0.04
482	000408	藏格矿业	8,800	610,016.00	0.03
483	301189	奥尼电子	10,300	606,979.00	0.03
484	301123	奕东电子	5,000	603,600.00	0.03
485	301281	科源制药	12,100	596,530.00	0.03
486	688372	伟测科技	3,200	595,200.00	0.03
487	301580	爱迪特	9,240	594,409.20	0.03
488	601988	中国银行	102,800	588,016.00	0.03
489	002875	安奈儿	38,900	578,054.00	0.03
490	301239	普瑞眼科	18,800	572,460.00	0.03
491	300589	江龙船艇	48,300	569,940.00	0.03
492	000753	漳州发展	126,000	565,740.00	0.03
493	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
494	603380	易德龙	12,500	563,625.00	0.03
495	002996	顺博合金	95,300	562,270.00	0.03
496	605136	丽人丽妆	77,700	554,001.00	0.03
497	000607	华媒控股	180,100	552,907.00	0.03
498	002245	蔚蓝锂芯	29,500	551,945.00	0.03
499	603063	禾望电气	10,400	550,056.00	0.03
500	301051	信濠光电	27,820	539,708.00	0.03
501	600558	大西洋	109,200	539,448.00	0.03
502	688677	海泰新光	5,200	525,876.00	0.03
503	600830	香溢融通	64,900	517,253.00	0.03
504	002562	兄弟科技	117,600	511,560.00	0.03
505	002948	青岛银行	100,000	508,000.00	0.03
506	605007	五洲特纸	37,800	506,142.00	0.03
507	688680	海优新材	11,800	495,600.00	0.03
508	600903	贵州燃气	74,600	495,344.00	0.03
509	600467	好当家	251,200	494,864.00	0.03
510	301232	飞沃科技	3,200	492,640.00	0.03
511	688390	固德威	4,518	490,248.18	0.03
512	300532	今天国际	77,600	483,448.00	0.03
513	002785	万里石	10,300	456,393.00	0.03
514	000792	盐湖股份	15,100	455,869.00	0.03
515	605162	新中港	58,900	454,119.00	0.03

516	688433	华曙高科	5,200	445,120.00	0.03
517	002682	龙洲股份	104,800	444,352.00	0.03
518	300286	安科瑞	18,200	439,530.00	0.02
519	301259	艾布鲁	16,700	438,375.00	0.02
520	301378	通达海	18,200	436,436.00	0.02
521	002348	高乐股份	41,300	435,302.00	0.02
522	002440	闰土股份	42,400	434,600.00	0.02
523	300440	运达科技	20,300	432,999.00	0.02
524	688320	禾川科技	10,400	431,080.00	0.02
525	301149	隆华新材	40,700	430,606.00	0.02
526	688339	亿华通	23,000	430,100.00	0.02
527	688233	神工股份	2,000	428,840.00	0.02
528	688416	恒烁股份	3,040	425,600.00	0.02
529	688682	霍莱沃	10,800	420,120.00	0.02
530	000886	海南高速	102,600	418,608.00	0.02
531	300452	山河药辅	35,200	411,136.00	0.02
532	002448	中原内配	32,900	404,670.00	0.02
533	300871	回盛生物	18,100	399,286.00	0.02
534	300382	斯莱克	17,000	392,870.00	0.02
535	300982	苏文电能	25,800	389,838.00	0.02
536	002849	威星智能	22,300	377,316.00	0.02
537	603319	美湖股份	11,300	375,273.00	0.02
538	002587	奥拓电子	47,200	368,632.00	0.02
539	002772	众兴菌业	32,400	368,064.00	0.02
540	300711	广哈通信	22,300	365,720.00	0.02
541	300571	平治信息	7,800	356,148.00	0.02
542	002328	新朋股份	48,300	354,522.00	0.02
543	301169	零点有数	5,000	353,300.00	0.02
544	002913	奥士康	5,500	351,670.00	0.02
545	300021	大禹节水	88,100	351,519.00	0.02
546	301159	三维天地	12,000	349,200.00	0.02
547	002969	嘉美包装	24,300	342,144.00	0.02
548	300491	通合科技	8,900	339,891.00	0.02
549	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
550	301198	喜悦智行	25,000	335,000.00	0.02
551	688087	英科再生	10,000	334,200.00	0.02
552	300817	双飞集团	21,300	332,280.00	0.02
553	300830	金现代	41,200	327,128.00	0.02
554	000407	胜利股份	86,500	320,050.00	0.02
555	000965	天保基建	108,700	317,404.00	0.02
556	002177	御银股份	55,700	315,262.00	0.02
557	002021	中捷资源	120,600	303,912.00	0.02
558	300672	国科微	1,000	295,000.00	0.02

559	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.02
560	688045	必易微	3,600	290,808.00	0.02
561	603334	丰倍生物	8,000	284,240.00	0.02
562	301536	星辰科技	2,200	283,162.00	0.02
563	301021	英诺激光	2,300	280,370.00	0.02
564	301396	宏景科技	840	278,544.00	0.02
565	603223	恒通股份	20,600	268,830.00	0.02
566	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
567	600449	宁夏建材	23,800	266,084.00	0.02
568	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
569	600520	三佳科技	6,500	258,115.00	0.01
570	002331	皖通科技	34,800	257,172.00	0.01
571	603083	剑桥科技	1,000	254,870.00	0.01
572	688293	奥浦迈	6,000	250,140.00	0.01
573	688628	优利德	2,400	237,456.00	0.01
574	301548	崇德科技	2,600	230,802.00	0.01
575	300885	海昌新材	9,600	228,192.00	0.01
576	603209	兴通股份	18,200	228,046.00	0.01
577	002108	沧州明珠	53,400	221,076.00	0.01
578	605222	起帆电缆	9,400	219,208.00	0.01
579	603239	浙江仙通	14,400	213,264.00	0.01
580	301148	嘉戎技术	4,000	213,040.00	0.01
581	002551	尚荣医疗	78,600	209,862.00	0.01
582	000096	广聚能源	29,600	206,312.00	0.01
583	301571	国科天成	2,900	189,022.00	0.01
584	002746	仙坛股份	36,400	185,640.00	0.01
585	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
586	000967	盈峰环境	16,700	175,851.00	0.01
587	603610	麒盛科技	9,600	172,416.00	0.01
588	300025	华星创业	40,900	171,780.00	0.01
589	301388	欣灵电气	7,200	167,904.00	0.01
590	301499	维科精密	5,400	157,572.00	0.01
591	301132	满坤科技	3,000	157,560.00	0.01
592	301048	金鹰重工	17,400	149,814.00	0.01
593	301256	华融化学	11,400	147,744.00	0.01
594	002090	金智科技	16,600	146,744.00	0.01
595	300293	蓝英装备	7,200	146,520.00	0.01
596	301306	西测测试	900	142,641.00	0.01
597	688365	光云科技	8,800	138,776.00	0.01
598	000426	兴业银锡	4,200	138,432.00	0.01
599	301017	漱玉平民	10,400	135,616.00	0.01
600	600638	新黄浦	30,100	131,537.00	0.01
601	000695	滨海能源	10,500	131,250.00	0.01

602	688221	前沿生物	5,400	120,960.00	0.01
603	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
604	603618	杭电股份	2,400	119,712.00	0.01
605	300693	盛弘股份	2,400	117,000.00	0.01
606	601699	潞安环能	8,100	115,668.00	0.01
607	601956	东贝集团	24,800	114,576.00	0.01
608	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
609	301323	新莱福	1,400	114,226.00	0.01
610	603912	佳力图	14,400	112,032.00	0.01
611	688179	阿拉丁	4,000	110,840.00	0.01
612	688093	世华科技	2,800	103,320.00	0.01
613	688697	纽威数控	7,600	103,284.00	0.01
614	600683	京投发展	8,800	101,200.00	0.01
615	600973	宝胜股份	14,000	99,260.00	0.01
616	000922	佳电股份	7,020	97,999.20	0.01
617	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
618	301003	江苏博云	1,800	96,300.00	0.01
619	300839	博汇股份	8,100	94,851.00	0.01
620	300475	香农芯创	300	90,000.00	0.01
621	002976	瑞玛精密	3,566	89,863.20	0.01
622	301517	陕西华达	1,800	89,334.00	0.01
623	002392	北京利尔	10,600	85,542.00	0.00
624	600336	澳柯玛	13,700	85,351.00	0.00
625	300818	耐普矿机	4,200	79,380.00	0.00
626	601163	三角轮胎	6,000	76,140.00	0.00
627	600318	新力金融	12,300	74,046.00	0.00
628	300921	南凌科技	3,600	73,116.00	0.00
629	603936	博敏电子	2,600	69,446.00	0.00
630	603458	勘设股份	4,600	66,470.00	0.00
631	002722	物产金轮	5,300	62,487.00	0.00
632	002394	联发股份	6,800	60,656.00	0.00
633	603211	晋拓股份	1,600	56,816.00	0.00
634	605100	华丰股份	1,400	56,588.00	0.00
635	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.00
636	603602	纵横通信	5,000	55,100.00	0.00
637	300611	美力科技	2,400	54,408.00	0.00
638	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
639	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
640	300335	迪森股份	11,000	53,570.00	0.00
641	301007	德迈仕	1,700	52,020.00	0.00
642	000776	广发证券	2,200	51,480.00	0.00
643	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
644	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00

645	603118	共进股份	3,100	37,541.00	0.00
646	002427	尤夫股份	7,400	37,296.00	0.00
647	688508	芯朋微	400	37,184.00	0.00
648	301073	君亭酒店	2,000	36,400.00	0.00
649	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
650	688171	纬德信息	800	35,168.00	0.00
651	002631	德尔未来	2,800	31,612.00	0.00
652	600971	恒源煤电	4,400	30,360.00	0.00
653	002040	南京港	4,000	29,800.00	0.00
654	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
655	002912	中新赛克	1,500	27,660.00	0.00
656	603217	元利科技	1,200	26,916.00	0.00
657	000798	中水渔业	3,800	26,828.00	0.00
658	603271	永杰新材	600	26,670.00	0.00
659	002380	科远智慧	700	23,926.00	0.00
660	603110	东方材料	1,000	23,170.00	0.00
661	300504	天邑股份	1,400	22,582.00	0.00
662	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
663	002940	昂利康	800	21,128.00	0.00
664	605366	宏柏新材	1,600	20,848.00	0.00
665	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
666	300946	恒而达	500	19,695.00	0.00
667	605389	长龄液压	200	19,200.00	0.00
668	002663	普邦股份	12,600	18,774.00	0.00
669	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
670	002862	实丰文化	1,400	17,962.00	0.00
671	301060	兰卫医学	2,100	17,157.00	0.00
672	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
673	600708	光明地产	5,000	16,050.00	0.00
674	301371	敷尔佳	600	15,600.00	0.00
675	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
676	605598	上海港湾	400	15,372.00	0.00
677	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
678	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
679	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
680	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
681	002083	孚日股份	1,300	13,637.00	0.00
682	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
683	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
684	601199	江南水务	2,300	12,742.00	0.00
685	688246	嘉和美康	620	12,741.00	0.00
686	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
687	688550	瑞联新材	200	11,570.00	0.00

688	600026	中远海能	600	10,764.00	0.00
689	601872	招商轮船	600	10,542.00	0.00
690	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
691	605388	均瑶健康	2,000	9,660.00	0.00
692	300937	药易购	400	7,716.00	0.00
693	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
694	002921	联诚精密	200	5,468.00	0.00
695	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
696	603880	南卫股份	600	4,236.00	0.00
697	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
698	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
699	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
700	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
701	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

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	000949	新乡化纤	30,699,763.20	2.14
2	300696	爱乐达	29,870,344.00	2.08
3	300731	科创新源	29,300,012.20	2.04
4	301382	蜂助手	29,198,875.16	2.04
5	688275	万润新能	27,216,189.37	1.90
6	300322	硕贝德	26,789,466.05	1.87
7	603977	国泰集团	25,791,966.80	1.80
8	603186	华正新材	25,134,212.73	1.75
9	000036	华联控股	25,021,577.40	1.75
10	002169	智光电气	24,961,002.00	1.74
11	002284	亚太股份	24,204,489.00	1.69
12	000803	山高环能	24,071,407.00	1.68
13	301391	卡莱特	23,979,843.40	1.67
14	300740	水羊股份	23,973,905.00	1.67
15	300240	飞力达	22,780,274.09	1.59
16	301021	英诺激光	22,770,900.44	1.59
17	002957	科瑞技术	22,672,317.13	1.58
18	600391	航发科技	22,608,133.00	1.58
19	301123	奕东电子	22,459,312.35	1.57
20	300508	维宏股份	22,204,048.00	1.55

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688275	万润新能	32,546,194.25	2.27
2	002957	科瑞技术	31,145,934.42	2.17
3	300806	斯迪克	29,606,525.00	2.07
4	000949	新乡化纤	29,305,086.90	2.04
5	301396	宏景科技	29,266,170.92	2.04
6	300322	硕贝德	27,125,535.00	1.89
7	002975	博杰股份	26,775,104.60	1.87
8	001267	汇绿生态	26,724,458.00	1.86
9	300835	龙磁科技	26,646,094.90	1.86
10	301382	蜂助手	25,807,905.56	1.80
11	603929	亚翔集成	25,323,044.24	1.77
12	300508	维宏股份	25,109,799.00	1.75
13	002169	智光电气	25,005,077.72	1.74
14	688531	日联科技	24,911,376.26	1.74
15	688388	嘉元科技	24,861,178.58	1.73
16	603507	振江股份	24,823,284.60	1.73
17	688308	欧科亿	24,662,732.83	1.72
18	605299	舒华体育	24,445,831.00	1.71
19	002054	德美化工	24,369,740.00	1.70
20	301021	英诺激光	24,102,793.61	1.68

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,868,756,355.31
卖出股票收入（成交）总额	10,829,776,228.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间因申赎、市场流动性或者股指期货贴水较大时，我们有使用股指期货套保调整或保持仓位。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,005,209.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,385,671.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,390,881.31

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
华泰柏瑞 中证 2000 指数增强 A	22,205	8,446.10	18,428,786.52	9.83	169,116,840.72	90.17
华泰柏瑞 中证 2000 指数增强 C	137,120	4,811.10	72,548,907.38	11.00	587,148,572.74	89.00
合计	157,686	5,372.98	90,977,693.90	10.74	756,265,413.46	89.26

注：分级基金机构/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）。

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	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	332,088.62	0.1771
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	178,381.46	0.0270
	合计	510,470.08	0.0603

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	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本 开放式基金	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	0~10
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 （2024 年 1 月 12 日）基金份额总额	218,645,473.34	214,381,729.92
本报告期期初基金 份额总额	175,367,901.63	625,135,819.89
本报告期基金总申 购份额	165,470,328.82	1,700,568,158.62
减：本报告期基金 总赎回份额	153,292,603.21	1,666,006,498.39
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	187,545,627.24	659,697,480.12

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

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 (%)	
华泰证券	3	21,694,654,595.52	100.00	4,338,906.71	100.00	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

- (1)具有相应的业务经营资格；
- (2)具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；
- (3)诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- (4)财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需
- (6)被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。
证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1) 公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回购成交 总额的比例 (%)	成交金额	占当期 权证成交总额 的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 12 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 06 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 10 日

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	2026 年 03 月 27 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	2026 年 03 月 05 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 27 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	2026 年 01 月 26 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日