

华泰柏瑞中证 1000 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62

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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强	
基金主代码	019240	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 19 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	745,592,200.13 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 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019240	019241
报告期末下属分级基金的份额总额	575,876,953.49 份	169,715,246.64 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 3、资产支持证券投资策略 4、衍生品投资策略 5、存托凭证投资策略 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略
业绩比较基准	中证 1000 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	康珂	张姗
	联系电话	021-38601777	400-61-95555
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	400-61-95555
传真		021-38601799	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄	深圳市深南大道 7088 号招商银

	证大五道口广场 1 号楼 17 层	行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	96,309,694.04	26,984,388.29
本期利润	136,326,748.08	35,141,034.35
加权平均基金份 额本期利润	0.2836	0.2696
本期加权平均净 值利润率	17.20%	16.48%
本期基金份额净 值增长率	20.39%	20.15%
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	406,401,764.67	116,575,486.12
期末可供分配基 金份额利润	0.7057	0.6869
期末基金资产净 值	1,028,035,850.12	299,626,524.20

期末基金份额净值	1.7852	1.7655
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	78.52%	76.55%

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 1000 指数增强 A

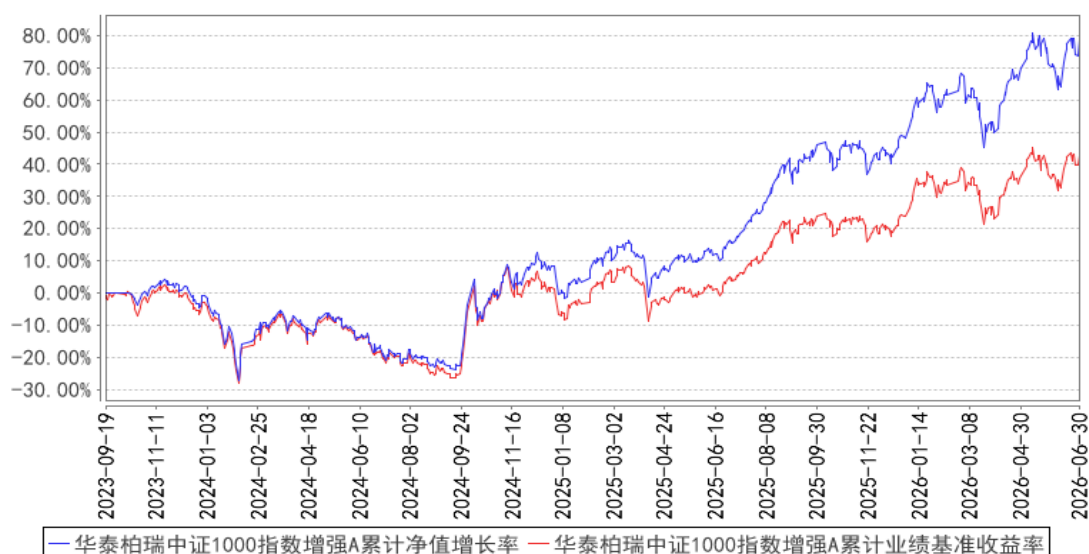
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18.59%	1.59%	14.83%	1.53%	3.76%	0.06%
过去六个月	20.39%	1.58%	15.23%	1.54%	5.16%	0.04%
过去一年	54.24%	1.35%	36.53%	1.31%	17.71%	0.04%
自基金合同生效起至今	78.52%	1.59%	42.87%	1.61%	35.65%	-0.02%

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

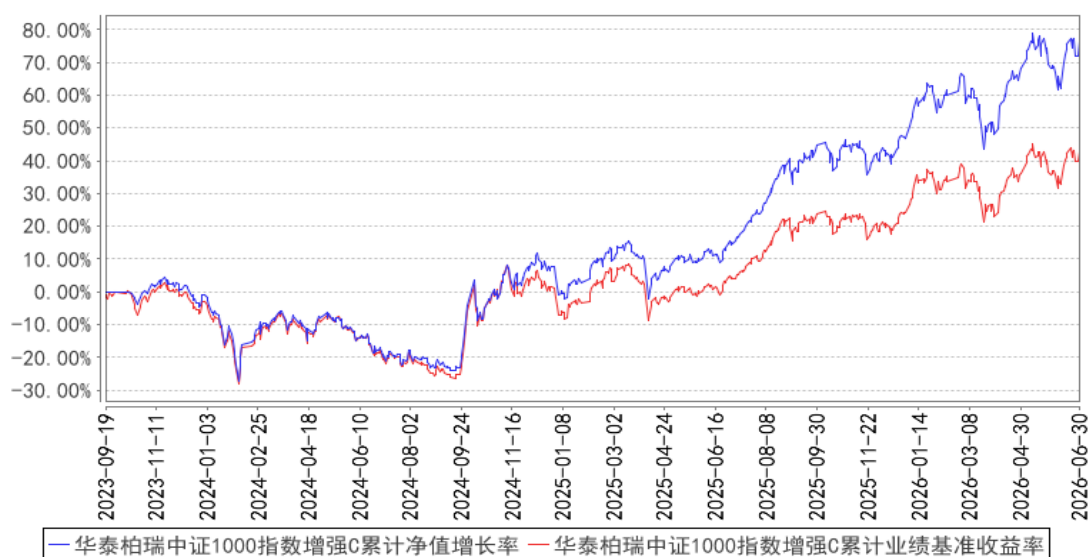
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18.47%	1.59%	14.83%	1.53%	3.64%	0.06%
过去六个月	20.15%	1.58%	15.23%	1.54%	4.92%	0.04%
过去一年	53.64%	1.35%	36.53%	1.31%	17.11%	0.04%
自基金合同生效起至今	76.55%	1.59%	42.87%	1.61%	33.68%	-0.02%

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1000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1000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2023年9月19日至2026年6月30日。C类图示日期为2023年9月19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		
笪篁	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 19 日	—	11 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 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。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈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智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞中证 A500 指数增强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

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理人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 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.7852 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.39%，同期业绩比较基准收益率为 15.23%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.7655 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.15%，同期业绩比较基准收益率为 15.23%。

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

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 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	134,258,091.36	53,149,777.75
结算备付金		9,360,163.12	4,753,056.50
存出保证金		9,176,217.60	3,425,928.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,184,916,913.98	458,709,898.41
其中：股票投资		1,164,787,275.62	458,709,898.41
基金投资		-	-

债券投资		20,129,638.36	-
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		8,966,589.27	39,060,970.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,346,677,975.33	559,099,631.44
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		17,716,215.52	34,301,946.09
应付管理人报酬		861,928.31	348,804.12
应付托管费		215,482.08	87,201.01
应付销售服务费		95,286.36	32,106.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,268.70	10,869.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	114,420.04	202,621.87
负债合计		19,015,601.01	34,983,548.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	745,592,200.13	354,034,654.90
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	582,070,174.19	170,081,428.44
净资产合计		1,327,662,374.32	524,116,083.34
负债和净资产总计		1,346,677,975.33	559,099,631.44

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 745,592,200.13 份，其中下属 A 类基金份额

净值 1.7852 元，基金份额总额 575,876,953.49 份；下属 C 类基金份额净值 1.7655 元，基金份额总额 169,715,246.64 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 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		176,970,271.53	13,342,299.41
1. 利息收入		116,972.35	16,556.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	116,972.35	16,556.08
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）		121,142,139.98	5,162,128.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	109,048,798.26	4,153,015.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	42,063.24	-
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	6,634,066.62	151,637.53
股利收益	6.4.7.19	5,417,211.86	857,475.41
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	48,173,700.10	7,926,648.96
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	7,537,459.10	236,965.77
减：二、营业总支出		5,502,489.10	719,159.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,980,007.50	456,461.21

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	995,001.77	114,115.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	420,579.57	73,298.72
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		24,089.07	784.73
8. 其他费用	6.4.7.23	82,811.19	74,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		171,467,782.43	12,623,139.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		171,467,782.43	12,623,139.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		171,467,782.43	12,623,139.52

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 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	354,034,654.90	-	170,081,428.44	524,116,083.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	354,034,654.90	-	170,081,428.44	524,116,083.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	391,557,545.23	-	411,988,745.75	803,546,290.98
（一）、综合收益总额	-	-	171,467,782.43	171,467,782.43
（二）、本期基金份额交易产生的	391,557,545.23	-	240,520,963.32	632,078,508.55

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	1,467,013,472. 81	-	964,736,607.47	2,431,750,080.2 8
2. 基金赎 回款	- 1,075,455,927. 58	-	- 724,215,644.15	- 1,799,671,571.7 3
(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	745,592,200.13	-	582,070,174.19	1,327,662,374.3 2
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	129,892,296.35	-	6,240,082.08	136,132,378.43
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	129,892,296.35	-	6,240,082.08	136,132,378.43
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-29,750,606.42	-	9,275,505.17	-20,475,101.25
(一)、综合收益 总额	-	-	12,623,139.52	12,623,139.52
(二)、本期基金 份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以	-29,750,606.42	-	-3,347,634.35	-33,098,240.77

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	75,091,779.69	-	7,187,262.95	82,279,042.64
2. 基金赎回款	- 104,842,386.11	-	-10,534,897.30	-115,377,283.41
(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	100,141,689.93	-	15,515,587.25	115,657,277.18

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 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[2023]1780 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 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 1000 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 347,748,610.52 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0486 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 347,898,709.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 150,099.06 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 1000 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、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 1000 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、可转换债券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：股票及存托凭证资产的投资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)的资产比例不低于非现金资产基金资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06

月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 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	134,258,091.36
等于: 本金	134,251,629.59
加: 应计利息	6,461.77
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	134,258,091.36

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		1,109,059,296.51	-	1,164,787,275.62	55,727,979.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	20,022,800.00	111,638.36	20,129,638.36	-4,800.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,022,800.00	111,638.36	20,129,638.36	-4,800.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,129,082,096.51	111,638.36	1,184,916,913.98	55,723,179.11

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	74,769,080.00	-	-	
其中：股指期货投资	74,769,080.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	74,769,080.00	-	-	

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	44.00	76,468,480.00	1,699,400.00
合计				1,699,400.00

减:可抵销期货 暂收款				1,699,400.00
净额				0.00

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

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	16,201.53
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	76,863.46
其他应付款	21,355.05
合计	114,420.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 1000 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	290,069,988.43	290,069,988.43
本期申购	1,149,832,117.45	1,149,832,117.45
本期赎回（以“-”号填列）	-864,025,152.39	-864,025,152.39
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	575,876,953.49	575,876,953.49

华泰柏瑞中证 1000 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	63,964,666.47	63,964,666.47
本期申购	317,181,355.36	317,181,355.36
本期赎回（以“-”号填列）	-211,430,775.19	-211,430,775.19
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	169,715,246.64	169,715,246.64

注：申购含转换入份额；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 1000 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	133,203,008.27	6,856,044.62	140,059,052.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	133,203,008.27	6,856,044.62	140,059,052.89
本期利润	96,309,694.04	40,017,054.04	136,326,748.08
本期基金份额交易产生的变动数	176,889,062.36	-1,115,966.70	175,773,095.66
其中：基金申购款	694,655,724.47	62,547,379.10	757,203,103.57
基金赎回款	-517,766,662.11	-63,663,345.80	-581,430,007.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	406,401,764.67	45,757,131.96	452,158,896.63

华泰柏瑞中证 1000 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	28,529,483.89	1,492,891.66	30,022,375.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	28,529,483.89	1,492,891.66	30,022,375.55
本期利润	26,984,388.29	8,156,646.06	35,141,034.35
本期基金份额交易产生的变动数	61,061,613.94	3,686,253.72	64,747,867.66
其中：基金申购款	190,848,567.66	16,684,936.24	207,533,503.90
基金赎回款	-129,786,953.72	-12,998,682.52	-142,785,636.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,575,486.12	13,335,791.44	129,911,277.56

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	77,069.32
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	39,902.93

其他	0.10
合计	116,972.35

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	109,048,798.26
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	109,048,798.26

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	4,182,666,309.73
减：卖出股票成本总额	4,069,299,059.10
减：交易费用	4,318,452.37
买卖股票差价收入	109,048,798.26

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	46,080.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,017.40
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	42,063.24
----	-----------

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	4,017.40
买卖债券差价收入	-4,017.40

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	6,634,066.62

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	5,417,211.86
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	5,417,211.86

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	47,689,633.43
股票投资	47,694,433.43
债券投资	-4,800.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	484,066.67
权证投资	-
期货投资	484,066.67
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	48,173,700.10

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	6,884,788.63
基金转换费收入	652,670.47
合计	7,537,459.10

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类基金份额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。C 类基金份额的赎回费全额计入基金财产。

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	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,947.73
合计	82,811.19

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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

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股票交易。

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

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支付关联方佣金。

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	3,980,007.50	456,461.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,594,812.80	180,301.84
应支付基金管理人的净管理费	2,385,194.70	276,159.37

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：

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

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	995,001.77	114,115.23

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20 %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 X 0.20 % / 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 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	合计
招商银行股份有限公司	-	71,746.30	71,746.30
华泰证券股份有限公司	-	15.80	15.80
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	360.19	360.19
合计	-	72,122.29	72,122.29
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 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	合计
招商银行股份有限公司	-	36,304.92	36,304.92
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	100.56	100.56
合计	-	36,405.48	36,405.48

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，逐日累计至每月月末，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
招商银行股份有限公司	26,683,008.13	58,761.79	3,454,656.54	6,574.00

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	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	总金额

				位：股/ 张)	
华泰联合证券 有限责任公司	301458	钧崑电子	网下申购	4,203	43,711.20

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	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

				内						
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	10.12	27.73	6,377	64,535.24	176,834.21	-
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	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	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	2026	6 个	新	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-

	德电材	年 2 月 27 日	月	股 锁 定 期 内						
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	423	4,729.14	7,440.57	-
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	-

		日		定期内						
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	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月以上	新股锁定期内	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	92.18	463.15	113	10,416.34	52,335.95	-

				内						
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	1,304	108,310.24	164,890.80	-
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	1,624	185,590.72	1,099,350.56	-
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	1,198	125,382.68	921,130.22	-
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	新股锁定期内	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
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	2026	6 个	新	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

	思维	年 2 月 4 日	月	股 锁 定 期 内						
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	9.47	70.14	1,607	15,218.29	112,714.98	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	19.68	141.49	1,646	32,393.28	232,892.54	-

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中需要限售的部分或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，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	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13	890.99	2,400	1,183,493.91	2,110,872.00	-

		29			日					
		日								

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2025 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

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	134,258,091.	-	-	-	-	-	134,258,091.

	36						36
结算备付金	9,360,163.12	-	-	-	-	-	9,360,163.12
存出保证金	-	-	-	-	-	9,176,217.60	9,176,217.60
交易性金融资产	-	-	20,129,638.36	-	-	1,164,787,275.62	1,184,916,913.98
应收申购款	-	-	-	-	-	8,966,589.27	8,966,589.27
资产总计	143,618,254.48	-	20,129,638.36	-	-	1,182,930,082.49	1,346,677,975.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,716,215.52	17,716,215.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	861,928.31	861,928.31
应付托管费	-	-	-	-	-	215,482.08	215,482.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	95,286.36	95,286.36
应交税费	-	-	-	-	-	12,268.70	12,268.70
其他负债	-	-	-	-	-	114,420.04	114,420.04
负债总计	-	-	-	-	-	19,015,601.01	19,015,601.01
利率敏感度缺口	143,618,254.48	-	20,129,638.36	-	-	1,163,914,481.48	1,327,662,374.32
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	53,149,777.75	-	-	-	-	-	53,149,777.75
结算备付金	4,753,056.50	-	-	-	-	-	4,753,056.50
存出保证金	-	-	-	-	-	3,425,928.00	3,425,928.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	458,709,898.41	458,709,898.41
应收申购款	-	-	-	-	-	39,060,970.78	39,060,970.78
资产总计	57,902,834.25	-	-	-	-	501,196,797.19	559,099,631.44
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,301,946.09	34,301,946.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	348,804.12	348,804.12

应付托管费	-	-	-	-	-	87,201.01	87,201.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	32,106.01	32,106.01
应交税费	-	-	-	-	-	10,869.00	10,869.00
其他负债	-	-	-	-	-	202,621.87	202,621.87
负债总计	-	-	-	-	-	34,983,548.10	34,983,548.10
利率敏感度缺口	57,902,834.25	-	-	-	-	466,213,249.09	524,116,083.34

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.52%(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	1,164,787,275.62	87.73	458,709,898.41	87.52
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	1,164,787,275.62	87.73	458,709,898.41	87.52

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%	62,623,501.54	23,915,142.02
	业绩比较基准下降 5%	-62,623,501.54	-23,915,142.02

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	1,158,212,963.57	456,801,858.45
第二层次	22,240,510.36	－
第三层次	4,463,440.05	1,908,039.96

合计	1,184,916,913.98	458,709,898.41
----	------------------	----------------

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	1,164,787,275.62	86.49
	其中：股票	1,164,787,275.62	86.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,129,638.36	1.49
	其中：债券	20,129,638.36	1.49
	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	143,618,254.48	10.66
8	其他各项资产	18,142,806.87	1.35
9	合计	1,346,677,975.33	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	5,082,597.17	0.38
B	采矿业	33,898,911.82	2.55
C	制造业	833,293,728.84	62.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,229,130.00	1.98
E	建筑业	22,892,397.00	1.72
F	批发和零售业	12,779,452.00	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	21,250,112.74	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	115,817,472.65	8.72
J	金融业	28,314,723.80	2.13
K	房地产业	16,494,305.00	1.24
L	租赁和商务服务业	7,627,172.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	28,151,043.80	2.12
N	水利、环境和公共设施管理业	3,261,851.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,236.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	9,668,141.80	0.73
S	综合	-	-
	合计	1,164,787,275.62	87.73

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	603083	剑桥科技	44,200	11,265,254.00	0.85
2	600641	先导基电	268,600	10,706,396.00	0.81
3	688503	聚和材料	80,255	10,649,838.50	0.80
4	688536	思瑞浦	28,453	10,359,452.77	0.78
5	002497	雅化集团	481,500	9,808,155.00	0.74
6	601677	明泰铝业	576,500	9,569,900.00	0.72
7	688372	伟测科技	51,000	9,486,000.00	0.71

8	688141	杰华特	60,471	9,282,298.50	0.70
9	002979	雷赛智能	158,100	8,818,818.00	0.66
10	688766	普冉股份	11,220	8,601,252.00	0.65
11	603826	坤彩科技	333,000	8,511,480.00	0.64
12	688110	东芯股份	41,747	8,503,863.90	0.64
13	688630	芯碁微装	15,422	8,472,692.58	0.64
14	605376	博迁新材	29,900	8,111,870.00	0.61
15	301396	宏景科技	23,960	7,945,136.00	0.60
16	688388	嘉元科技	179,050	7,878,200.00	0.59
17	300672	国科微	26,200	7,729,000.00	0.58
18	301018	申菱环境	66,240	7,658,006.40	0.58
19	688717	艾罗能源	91,860	7,584,880.20	0.57
20	603063	禾望电气	138,600	7,330,554.00	0.55
21	002245	蔚蓝锂芯	387,820	7,256,112.20	0.55
22	301205	联特科技	21,700	7,249,970.00	0.55
23	002518	科士达	135,100	7,240,009.00	0.55
24	300568	星源材质	385,600	7,218,432.00	0.54
25	002947	恒铭达	94,200	7,163,910.00	0.54
26	301217	铜冠铜箔	43,200	7,131,024.00	0.54
27	688097	博众精工	110,427	6,962,422.35	0.52
28	002948	青岛银行	1,311,800	6,663,944.00	0.50
29	001339	智微智能	65,000	6,648,200.00	0.50
30	300693	盛弘股份	136,100	6,634,875.00	0.50
31	002738	中矿资源	111,600	6,583,284.00	0.50
32	002484	江海股份	62,578	6,570,690.00	0.49
33	001301	尚太科技	70,000	6,545,700.00	0.49
34	688182	灿勤科技	150,800	6,494,956.00	0.49
35	688800	瑞可达	66,328	6,365,498.16	0.48
36	600667	太极实业	215,900	6,299,962.00	0.47
37	001267	汇绿生态	115,600	6,184,600.00	0.47
38	300398	飞凯材料	99,800	6,162,650.00	0.46
39	605111	新洁能	61,700	6,116,938.00	0.46
40	600331	宏达股份	543,300	5,970,867.00	0.45
41	000950	重药控股	1,185,500	5,939,355.00	0.45
42	002396	星网锐捷	309,090	5,925,255.30	0.45
43	300438	鹏辉能源	71,400	5,915,490.00	0.45
44	688200	华峰测控	11,248	5,906,324.80	0.44
45	688433	华曙高科	68,416	5,856,409.60	0.44
46	002545	东方铁塔	359,900	5,837,578.00	0.44
47	300814	中富电路	28,500	5,828,250.00	0.44
48	300323	华灿光电	280,800	5,728,320.00	0.43
49	301626	苏州天脉	14,800	5,682,608.00	0.43
50	688390	固德威	51,336	5,570,469.36	0.42

51	301571	国科天成	85,000	5,540,300.00	0.42
52	600509	天富能源	652,200	5,511,090.00	0.42
53	301095	广立微	45,900	5,418,495.00	0.41
54	000628	高新发展	113,600	5,384,640.00	0.41
55	301489	思泉新材	32,460	5,342,266.80	0.40
56	688107	安路科技	116,747	5,323,663.20	0.40
57	300257	开山股份	185,500	5,320,140.00	0.40
58	300133	华策影视	747,000	5,288,760.00	0.40
59	688158	优刻得	143,733	5,283,625.08	0.40
60	688700	东威科技	58,200	5,203,080.00	0.39
61	300613	富瀚微	64,300	5,149,144.00	0.39
62	603929	亚翔集成	18,600	5,059,572.00	0.38
63	300726	宏达电子	59,700	5,048,829.00	0.38
64	688131	皓元医药	53,251	5,037,544.60	0.38
65	000990	诚志股份	614,100	5,023,338.00	0.38
66	002246	北化股份	266,300	5,006,440.00	0.38
67	301510	固高科技	155,600	4,968,308.00	0.37
68	688691	灿芯股份	42,800	4,961,804.00	0.37
69	002025	航天电器	63,800	4,862,836.00	0.37
70	300049	福瑞医科	124,800	4,852,224.00	0.37
71	605020	永和股份	118,601	4,829,432.72	0.36
72	300260	新莱应材	47,600	4,781,896.00	0.36
73	688593	新相微	122,600	4,771,592.00	0.36
74	002174	游族网络	377,800	4,764,058.00	0.36
75	000534	万泽股份	170,000	4,651,200.00	0.35
76	002531	天顺风能	550,200	4,638,186.00	0.35
77	002636	金安国纪	38,000	4,558,860.00	0.34
78	003010	若羽臣	186,520	4,532,436.00	0.34
79	688321	微芯生物	171,000	4,502,430.00	0.34
80	688167	炬光科技	12,640	4,477,214.40	0.34
81	002317	众生药业	182,000	4,471,740.00	0.34
82	600971	恒源煤电	647,900	4,470,510.00	0.34
83	002432	九安医疗	63,000	4,452,840.00	0.34
84	002237	恒邦股份	300,846	4,419,427.74	0.33
85	002913	奥士康	67,800	4,335,132.00	0.33
86	000923	河钢资源	345,800	4,291,378.00	0.32
87	601208	东材科技	59,800	4,233,242.00	0.32
88	000636	风华高科	57,800	4,175,472.00	0.31
89	603505	金石资源	206,400	4,158,960.00	0.31
90	000935	四川双马	158,100	4,124,829.00	0.31
91	603283	赛腾股份	50,920	4,123,501.60	0.31
92	002668	TCL 智家	371,300	4,114,004.00	0.31
93	600123	兰花科创	758,800	4,051,992.00	0.31

94	688063	派能科技	75,400	4,016,558.00	0.30
95	301389	隆扬电子	46,200	4,009,698.00	0.30
96	600872	中炬高新	229,100	3,977,176.00	0.30
97	600353	旭光电子	87,100	3,971,760.00	0.30
98	600572	康恩贝	1,011,000	3,963,120.00	0.30
99	300990	同飞股份	37,500	3,940,125.00	0.30
100	688279	峰昭科技	17,525	3,933,311.00	0.30
101	002250	联化科技	287,400	3,928,758.00	0.30
102	002534	西子洁能	209,300	3,882,515.00	0.29
103	688127	蓝特光学	39,600	3,864,960.00	0.29
104	600246	万通发展	202,700	3,851,300.00	0.29
105	002458	益生股份	494,721	3,843,982.17	0.29
106	000543	皖能电力	507,300	3,840,261.00	0.29
107	300134	大富科技	446,500	3,817,575.00	0.29
108	688516	奥特维	66,400	3,810,696.00	0.29
109	002468	申通快递	254,900	3,711,344.00	0.28
110	603915	国茂股份	261,100	3,705,009.00	0.28
111	301127	武汉天源	177,400	3,675,728.00	0.28
112	300953	震裕科技	27,160	3,631,292.00	0.27
113	300593	新雷能	118,400	3,559,104.00	0.27
114	600226	亨通股份	369,800	3,546,382.00	0.27
115	301511	德福科技	24,500	3,524,325.00	0.27
116	601187	厦门银行	514,500	3,514,035.00	0.26
117	601969	海南矿业	437,800	3,462,998.00	0.26
118	301371	敷尔佳	132,160	3,436,160.00	0.26
119	002460	赣锋锂业	52,500	3,433,500.00	0.26
120	688275	万润新能	26,800	3,418,340.00	0.26
121	301316	慧博云通	85,300	3,359,114.00	0.25
122	300602	飞荣达	65,600	3,358,720.00	0.25
123	002373	千方科技	463,100	3,325,058.00	0.25
124	002929	润建股份	49,600	3,317,248.00	0.25
125	002216	三全食品	283,710	3,271,176.30	0.25
126	688146	中船特气	9,300	3,254,907.00	0.25
127	301031	中熔电气	27,044	3,230,405.80	0.24
128	601963	重庆银行	319,400	3,219,552.00	0.24
129	603127	昭衍新药	84,200	3,218,124.00	0.24
130	600428	中远海特	403,700	3,152,897.00	0.24
131	000811	冰轮环境	55,900	3,142,698.00	0.24
132	301219	腾远钴业	56,900	3,118,120.00	0.23
133	601858	中国科传	179,100	3,100,221.00	0.23
134	603118	共进股份	256,000	3,100,160.00	0.23
135	300483	首华燃气	175,600	3,087,048.00	0.23
136	002338	奥普光电	53,200	3,043,040.00	0.23

137	600928	西安银行	926,800	3,030,636.00	0.23
138	603319	美湖股份	91,000	3,022,110.00	0.23
139	002993	奥海科技	42,200	3,021,942.00	0.23
140	300113	顺网科技	165,000	3,004,650.00	0.23
141	300475	香农芯创	10,000	3,000,000.00	0.23
142	002541	鸿路钢构	172,500	2,987,700.00	0.23
143	688048	长光华芯	5,800	2,911,600.00	0.22
144	688120	华海清科	8,960	2,886,732.80	0.22
145	600361	创新新材	801,800	2,886,480.00	0.22
146	002405	四维图新	445,400	2,881,738.00	0.22
147	002859	洁美科技	26,200	2,869,162.00	0.22
148	600595	中孚实业	510,000	2,866,200.00	0.22
149	600389	江山股份	146,300	2,855,776.00	0.22
150	300773	拉卡拉	186,620	2,855,286.00	0.22
151	001389	广合科技	12,000	2,847,000.00	0.21
152	301071	力量钻石	30,500	2,821,250.00	0.21
153	002895	川恒股份	96,600	2,820,720.00	0.21
154	600269	赣粤高速	707,300	2,815,054.00	0.21
155	300870	欧陆通	8,120	2,807,002.80	0.21
156	688202	美迪西	34,600	2,792,566.00	0.21
157	002488	金固股份	312,100	2,780,811.00	0.21
158	300811	铂科新材	29,260	2,776,481.40	0.21
159	688668	鼎通科技	7,400	2,762,420.00	0.21
160	002099	海翔药业	518,400	2,737,152.00	0.21
161	002048	宁波华翔	118,700	2,730,100.00	0.21
162	002061	浙江交科	816,600	2,694,780.00	0.20
163	600623	华谊集团	330,800	2,669,556.00	0.20
164	301196	唯科科技	21,270	2,667,683.40	0.20
165	300681	英搏尔	92,200	2,638,764.00	0.20
166	002990	盛视科技	33,200	2,622,800.00	0.20
167	002745	木林森	207,400	2,602,870.00	0.20
168	002516	旷达科技	456,400	2,546,712.00	0.19
169	002408	齐翔腾达	541,300	2,538,697.00	0.19
170	002755	奥赛康	184,600	2,514,252.00	0.19
171	603093	南华期货	137,700	2,499,255.00	0.19
172	300661	圣邦股份	17,300	2,482,204.00	0.19
173	601126	四方股份	39,000	2,464,800.00	0.19
174	603876	鼎胜新材	94,700	2,463,147.00	0.19
175	000676	智度股份	480,900	2,457,399.00	0.19
176	300416	苏试试验	119,100	2,427,258.00	0.18
177	688596	正帆科技	29,987	2,370,772.22	0.18
178	300763	锦浪科技	26,000	2,349,100.00	0.18
179	603698	航天工程	60,800	2,344,448.00	0.18

180	002916	深南电路	5,100	2,335,290.00	0.18
181	688584	上海合晶	64,484	2,318,199.80	0.17
182	600201	生物股份	198,500	2,312,525.00	0.17
183	000962	东方钨业	25,500	2,310,300.00	0.17
184	002384	东山精密	8,800	2,308,680.00	0.17
185	000837	秦川机床	205,600	2,284,216.00	0.17
186	600651	飞乐音响	407,700	2,279,043.00	0.17
187	688559	海目星	27,000	2,265,840.00	0.17
188	002182	宝武镁业	145,500	2,265,435.00	0.17
189	002539	云图控股	199,700	2,260,604.00	0.17
190	301307	美利信	30,000	2,258,700.00	0.17
191	688368	晶丰明源	10,400	2,251,808.00	0.17
192	301365	矩阵股份	59,200	2,244,272.00	0.17
193	001337	四川黄金	61,100	2,239,926.00	0.17
194	300738	奥飞数据	107,200	2,167,584.00	0.16
195	002020	京新药业	172,400	2,153,276.00	0.16
196	688627	精智达	3,000	2,145,000.00	0.16
197	600771	广誉远	164,300	2,127,685.00	0.16
198	300137	先河环保	121,400	2,117,216.00	0.16
199	002635	安洁科技	103,400	2,114,530.00	0.16
200	688072	拓荆科技	2,400	2,110,872.00	0.16
201	688387	信科移动	106,080	2,104,627.20	0.16
202	002364	中恒电气	39,100	2,103,580.00	0.16
203	603219	富佳股份	135,000	2,103,300.00	0.16
204	600216	浙江医药	184,400	2,102,160.00	0.16
205	603678	火炬电子	25,100	2,083,300.00	0.16
206	600489	中金黄金	113,800	2,054,090.00	0.15
207	603162	海通发展	226,824	2,034,611.28	0.15
208	301658	首航新能	75,300	2,030,841.00	0.15
209	601107	四川成渝	415,200	2,026,176.00	0.15
210	600654	中安科	758,300	2,017,078.00	0.15
211	002802	洪汇新材	190,600	2,005,112.00	0.15
212	601375	中原证券	500,000	1,995,000.00	0.15
213	600149	廊坊发展	437,600	1,964,824.00	0.15
214	600502	安徽建工	450,900	1,961,415.00	0.15
215	605011	杭州热电	124,800	1,929,408.00	0.15
216	300806	斯迪克	17,100	1,915,200.00	0.14
217	300348	长亮科技	217,400	1,913,120.00	0.14
218	603950	长源东谷	22,500	1,899,675.00	0.14
219	601882	海天精工	93,400	1,889,482.00	0.14
220	000156	华数传媒	298,300	1,882,273.00	0.14
221	002897	意华股份	21,200	1,865,176.00	0.14
222	002138	顺络电子	25,300	1,849,430.00	0.14

223	601519	大智慧	214,200	1,848,546.00	0.14
224	300199	翰宇药业	82,500	1,821,600.00	0.14
225	603638	艾迪精密	77,200	1,810,340.00	0.14
226	688001	华兴源创	21,106	1,808,784.20	0.14
227	600323	瀚蓝环境	65,800	1,806,868.00	0.14
228	601975	招商南油	481,700	1,796,741.00	0.14
229	688652	京仪装备	8,963	1,794,123.71	0.14
230	002053	云南能投	182,000	1,789,060.00	0.13
231	603057	紫燕食品	79,500	1,772,850.00	0.13
232	000902	新洋丰	152,800	1,766,368.00	0.13
233	000581	威孚高科	103,600	1,763,272.00	0.13
234	301193	家联科技	95,000	1,761,300.00	0.13
235	300432	富临精工	86,600	1,739,794.00	0.13
236	300731	科创新源	29,740	1,735,626.40	0.13
237	601333	广深铁路	630,800	1,734,700.00	0.13
238	603317	天味食品	132,700	1,726,427.00	0.13
239	300943	春晖智控	38,400	1,726,080.00	0.13
240	600782	新钢股份	694,400	1,722,112.00	0.13
241	002281	光迅科技	6,700	1,721,498.00	0.13
242	002290	禾盛新材	18,700	1,717,969.00	0.13
243	688226	威腾电气	39,800	1,704,634.00	0.13
244	002727	一心堂	177,600	1,703,184.00	0.13
245	600167	联美控股	304,400	1,701,596.00	0.13
246	688091	上海谊众	42,282	1,699,736.40	0.13
247	000792	盐湖股份	56,300	1,699,697.00	0.13
248	002324	普利特	139,500	1,683,765.00	0.13
249	600575	淮河能源	527,500	1,682,725.00	0.13
250	600718	东软集团	229,500	1,661,580.00	0.13
251	600961	株冶集团	51,100	1,655,129.00	0.12
252	600963	岳阳林纸	543,900	1,653,456.00	0.12
253	600075	新疆天业	404,300	1,633,372.00	0.12
254	688352	顾中科技	67,480	1,631,666.40	0.12
255	600929	雪天盐业	359,000	1,629,860.00	0.12
256	600185	珠免集团	356,200	1,602,900.00	0.12
257	688025	杰普特	3,400	1,598,000.00	0.12
258	300725	药石科技	43,100	1,577,460.00	0.12
259	300223	北京君正	6,300	1,568,070.00	0.12
260	688658	悦康药业	119,251	1,533,567.86	0.12
261	301326	捷邦科技	11,000	1,533,070.00	0.12
262	300656	民德电子	39,700	1,512,173.00	0.11
263	601326	秦港股份	476,300	1,505,108.00	0.11
264	688256	寒武纪	940	1,499,817.00	0.11
265	002379	宏桥控股	100,900	1,490,293.00	0.11

266	600116	三峡水利	265,600	1,487,360.00	0.11
267	601777	千里科技	180,300	1,471,248.00	0.11
268	300682	朗新科技	148,500	1,470,150.00	0.11
269	002840	华统股份	200,800	1,463,832.00	0.11
270	002706	良信股份	134,100	1,463,031.00	0.11
271	605198	安德利	22,900	1,450,944.00	0.11
272	603175	超颖电子	16,200	1,443,258.00	0.11
273	600155	华创云信	260,300	1,436,856.00	0.11
274	688449	联芸科技	16,560	1,429,293.60	0.11
275	301081	严牌股份	104,480	1,429,286.40	0.11
276	688523	航天环宇	27,000	1,414,800.00	0.11
277	300580	贝斯特	70,100	1,409,711.00	0.11
278	301317	鑫磊股份	24,900	1,397,388.00	0.11
279	600643	爱建集团	374,700	1,390,137.00	0.10
280	600330	天通股份	45,000	1,387,800.00	0.10
281	600490	鹏欣资源	235,000	1,367,700.00	0.10
282	301297	富乐德	22,300	1,365,652.00	0.10
283	002163	海南发展	162,100	1,351,914.00	0.10
284	688082	盛美上海	3,105	1,341,360.00	0.10
285	002737	葵花药业	118,800	1,331,748.00	0.10
286	300457	赢合科技	63,000	1,328,040.00	0.10
287	600315	上海家化	78,900	1,327,098.00	0.10
288	600728	佳都科技	305,800	1,302,708.00	0.10
289	600746	江苏索普	246,800	1,290,764.00	0.10
290	600446	金证股份	126,300	1,270,578.00	0.10
291	300308	中际旭创	1,000	1,270,000.00	0.10
292	603033	三维股份	125,600	1,261,024.00	0.09
293	002319	乐通股份	121,500	1,253,880.00	0.09
294	002544	普天科技	68,500	1,248,070.00	0.09
295	601609	金田股份	115,100	1,243,080.00	0.09
296	605196	华通线缆	47,400	1,237,140.00	0.09
297	603992	松霖科技	37,900	1,227,960.00	0.09
298	603108	润达医疗	137,100	1,220,190.00	0.09
299	600409	三友化工	197,400	1,206,114.00	0.09
300	600206	有研新材	18,000	1,198,800.00	0.09
301	603588	高能环境	60,500	1,161,600.00	0.09
302	002716	湖南白银	143,000	1,156,870.00	0.09
303	600500	中化国际	147,100	1,151,793.00	0.09
304	002077	大港股份	58,700	1,132,323.00	0.09
305	002151	北斗星通	35,300	1,120,775.00	0.08
306	300548	长芯博创	4,000	1,112,000.00	0.08
307	002008	大族激光	7,400	1,110,814.00	0.08
308	603267	鸿远电子	14,300	1,107,964.00	0.08

309	002885	京泉华	27,000	1,103,220.00	0.08
310	688795	摩尔线程	1,624	1,099,350.56	0.08
311	002643	万润股份	52,100	1,091,495.00	0.08
312	002645	华宏科技	39,400	1,083,894.00	0.08
313	688329	艾隆科技	53,360	1,078,405.60	0.08
314	601918	新集能源	124,900	1,072,891.00	0.08
315	301262	海看股份	59,600	1,071,012.00	0.08
316	600888	新疆众和	67,000	1,064,630.00	0.08
317	300757	罗博特科	1,700	1,052,300.00	0.08
318	002536	飞龙股份	22,300	1,052,114.00	0.08
319	002810	山东赫达	42,200	1,042,340.00	0.08
320	603920	世运电路	21,600	1,037,664.00	0.08
321	300687	赛意信息	32,200	998,200.00	0.08
322	300779	惠城环保	19,740	990,948.00	0.07
323	300850	新强联	36,700	983,560.00	0.07
324	300169	天晟新材	197,100	983,529.00	0.07
325	300607	拓斯达	23,800	981,274.00	0.07
326	002978	安宁股份	38,200	979,066.00	0.07
327	688218	江苏北人	17,800	978,288.00	0.07
328	300678	中科信息	43,600	976,640.00	0.07
329	600257	大湖股份	223,200	966,456.00	0.07
330	300073	当升科技	20,100	965,604.00	0.07
331	688362	甬矽电子	10,000	964,000.00	0.07
332	300236	上海新阳	7,300	959,950.00	0.07
333	301550	斯菱智驱	10,360	947,214.80	0.07
334	688690	纳微科技	21,400	943,740.00	0.07
335	002537	海联金汇	177,300	937,917.00	0.07
336	600113	浙江东日	28,200	935,676.00	0.07
337	300456	赛微电子	22,000	934,340.00	0.07
338	688802	沐曦股份	1,198	921,130.22	0.07
339	600508	上海能源	122,780	904,888.60	0.07
340	000758	中色股份	137,700	904,689.00	0.07
341	301093	华兰股份	6,600	895,158.00	0.07
342	301529	福赛科技	9,200	886,512.00	0.07
343	000762	西藏矿业	32,942	879,551.40	0.07
344	600037	歌华有线	139,400	874,038.00	0.07
345	001212	中旗新材	18,300	867,054.00	0.07
346	600986	浙文互联	122,700	856,446.00	0.06
347	002017	东信和平	57,900	847,077.00	0.06
348	603799	华友钴业	17,500	844,550.00	0.06
349	300606	金太阳	19,800	842,688.00	0.06
350	600645	中源协和	48,700	833,257.00	0.06
351	600114	东睦股份	21,900	826,944.00	0.06

352	001236	弘业期货	118,000	820,100.00	0.06
353	601038	一拖股份	76,900	814,371.00	0.06
354	301487	盟固利	42,000	804,300.00	0.06
355	301238	瑞泰新材	32,300	788,120.00	0.06
356	300745	欣锐科技	18,600	785,292.00	0.06
357	000426	兴业银锡	23,800	784,448.00	0.06
358	002487	大金重工	13,400	776,798.00	0.06
359	001227	兰州银行	385,000	770,000.00	0.06
360	300872	天阳科技	48,300	763,140.00	0.06
361	301198	喜悦智行	56,400	755,760.00	0.06
362	300861	美畅股份	29,800	750,662.00	0.06
363	300684	中石科技	12,300	750,300.00	0.06
364	002283	天润工业	77,300	745,945.00	0.06
365	300775	三角防务	33,600	740,544.00	0.06
366	301087	可孚医疗	15,500	738,575.00	0.06
367	002353	杰瑞股份	4,800	732,000.00	0.06
368	300720	海川智能	7,600	731,120.00	0.06
369	688220	翱捷科技	5,880	731,001.60	0.06
370	688150	莱特光电	10,600	727,372.00	0.05
371	600267	海正药业	71,722	725,109.42	0.05
372	000029	深深房 A	32,600	718,830.00	0.05
373	000059	华锦股份	189,800	711,750.00	0.05
374	300696	爱乐达	27,000	702,810.00	0.05
375	688486	龙迅股份	10,839	689,143.62	0.05
376	600059	古越龙山	92,400	676,368.00	0.05
377	688359	三孚新科	3,400	674,696.00	0.05
378	601619	嘉泽新能	155,200	667,360.00	0.05
379	688545	兴福电子	5,000	665,300.00	0.05
380	600619	海立股份	41,800	662,530.00	0.05
381	600266	城建发展	168,700	659,617.00	0.05
382	688031	星环科技	5,600	645,008.00	0.05
383	000848	承德露露	86,400	639,360.00	0.05
384	000917	电广传媒	95,400	638,226.00	0.05
385	000089	深圳机场	104,900	632,547.00	0.05
386	000408	藏格矿业	9,000	623,880.00	0.05
387	600933	爱柯迪	42,100	622,238.00	0.05
388	000680	山推股份	61,500	618,075.00	0.05
389	601949	中国出版	132,000	613,800.00	0.05
390	002378	章源钨业	18,300	612,684.00	0.05
391	300765	石药创新	21,600	588,168.00	0.04
392	600686	金龙汽车	51,400	580,306.00	0.04
393	002796	世嘉科技	14,000	570,920.00	0.04
394	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04

395	600739	辽宁成大	54,700	553,017.00	0.04
396	600063	皖维高新	72,500	551,000.00	0.04
397	300473	德尔股份	18,100	550,240.00	0.04
398	300128	锦富技术	86,100	509,712.00	0.04
399	002832	比音勒芬	24,500	505,680.00	0.04
400	000927	中国铁物	221,500	502,805.00	0.04
401	688307	中润光学	6,200	495,690.00	0.04
402	002093	国脉科技	77,900	490,770.00	0.04
403	300428	立中集团	26,000	472,680.00	0.04
404	002906	华阳集团	18,800	469,248.00	0.04
405	002563	森马服饰	89,900	453,096.00	0.03
406	002003	伟星股份	53,100	447,102.00	0.03
407	600388	龙净环保	30,300	440,865.00	0.03
408	300617	安靠智电	8,200	434,518.00	0.03
409	002104	恒宝股份	42,100	434,051.00	0.03
410	600507	方大特钢	106,100	429,705.00	0.03
411	600783	鲁信创投	21,400	426,288.00	0.03
412	688123	聚辰股份	1,882	400,113.20	0.03
413	688177	百奥泰	23,400	393,588.00	0.03
414	605118	力鼎光电	11,200	390,768.00	0.03
415	301128	强瑞技术	2,400	374,160.00	0.03
416	603188	亚邦股份	93,000	368,280.00	0.03
417	000719	中原传媒	31,960	365,302.80	0.03
418	301536	星辰科技	2,800	360,388.00	0.03
419	603009	北特科技	7,500	359,775.00	0.03
420	600773	西藏城投	27,000	347,490.00	0.03
421	600618	氯碱化工	34,200	343,710.00	0.03
422	300489	光智科技	1,100	343,145.00	0.03
423	002045	国光电器	40,900	321,065.00	0.02
424	603323	苏农银行	82,940	320,977.80	0.02
425	601636	旗滨集团	30,800	315,084.00	0.02
426	688548	广钢气体	6,000	312,600.00	0.02
427	002838	道恩股份	10,000	306,200.00	0.02
428	000550	江铃汽车	18,500	300,070.00	0.02
429	300426	华智数媒	59,300	300,058.00	0.02
430	301363	美好医疗	16,140	295,846.20	0.02
431	002268	电科网安	22,900	295,410.00	0.02
432	603599	广信股份	29,600	283,568.00	0.02
433	688103	国力电子	3,800	282,758.00	0.02
434	000612	焦作万方	26,600	281,694.00	0.02
435	300378	鼎捷数智	7,800	281,580.00	0.02
436	603880	南卫股份	39,400	278,164.00	0.02
437	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02

438	300761	立华股份	16,000	262,560.00	0.02
439	603533	掌阅科技	12,800	259,712.00	0.02
440	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
441	300984	金沃股份	4,800	257,904.00	0.02
442	000776	广发证券	10,900	255,060.00	0.02
443	600480	凌云股份	30,600	254,286.00	0.02
444	002903	宇环数控	5,400	245,268.00	0.02
445	000035	中国天楹	50,100	241,983.00	0.02
446	300085	银之杰	6,800	237,796.00	0.02
447	688820	盛合晶微	1,646	232,892.54	0.02
448	600657	信达地产	91,200	210,672.00	0.02
449	002221	东华能源	39,800	209,348.00	0.02
450	300835	龙磁科技	900	206,541.00	0.02
451	301189	奥尼电子	3,440	202,719.20	0.02
452	300246	宝莱特	13,300	187,131.00	0.01
453	000813	德展健康	61,400	186,042.00	0.01
454	000967	盈峰环境	17,600	185,328.00	0.01
455	001399	惠科股份	6,377	176,834.21	0.01
456	600640	国脉文化	18,000	174,060.00	0.01
457	603619	中曼石油	9,300	174,003.00	0.01
458	688006	杭可科技	4,758	173,904.90	0.01
459	000506	招金黄金	14,500	169,940.00	0.01
460	301061	匠心家居	4,820	169,037.40	0.01
461	300337	银邦股份	14,300	166,738.00	0.01
462	688790	昂瑞微	1,304	164,890.80	0.01
463	002004	华邦健康	41,100	161,523.00	0.01
464	300166	东方国信	9,100	161,161.00	0.01
465	002284	亚太股份	16,900	160,381.00	0.01
466	002176	江特电机	15,600	156,156.00	0.01
467	300026	红日药业	53,600	155,440.00	0.01
468	688328	深科达	1,600	153,120.00	0.01
469	603305	旭升集团	12,500	151,500.00	0.01
470	000688	国城矿业	4,300	147,189.00	0.01
471	003023	彩虹集团	7,300	141,912.00	0.01
472	603707	健友股份	19,600	138,572.00	0.01
473	002079	苏州固锝	9,000	135,270.00	0.01
474	001314	亿道信息	2,100	129,780.00	0.01
475	600750	华润江中	5,800	128,006.00	0.01
476	002761	浙江建投	19,200	127,296.00	0.01
477	603026	石大胜华	1,400	125,118.00	0.01
478	000810	创维数字	9,100	120,575.00	0.01
479	300468	四方精创	5,700	119,757.00	0.01
480	600577	精达股份	11,700	114,426.00	0.01

481	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
482	688818	电科蓝天	1,607	112,714.98	0.01
483	300254	仟源医药	13,200	105,732.00	0.01
484	301589	诺瓦星云	700	104,286.00	0.01
485	000933	神火股份	4,700	99,640.00	0.01
486	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
487	605117	德业股份	900	95,562.00	0.01
488	300047	天源迪科	10,500	93,240.00	0.01
489	000899	赣能股份	9,600	92,736.00	0.01
490	301248	杰创智能	1,100	92,323.00	0.01
491	603308	应流股份	1,500	90,600.00	0.01
492	300461	田中精机	2,400	88,896.00	0.01
493	688686	奥普特	525	88,404.75	0.01
494	301285	鸿日达	800	88,264.00	0.01
495	688779	五矿新能	10,600	85,966.00	0.01
496	002158	汉钟精机	2,300	85,284.00	0.01
497	301382	蜂助手	1,800	82,800.00	0.01
498	300769	德方纳米	1,200	79,800.00	0.01
499	605599	菜百股份	5,800	79,460.00	0.01
500	300790	宇瞳光学	3,000	78,330.00	0.01
501	002787	华源控股	2,400	77,280.00	0.01
502	601872	招商轮船	4,100	72,037.00	0.01
503	601003	柳钢股份	21,200	71,444.00	0.01
504	600299	安迪苏	8,700	68,295.00	0.01
505	688313	仕佳光子	360	66,474.00	0.01
506	688232	新点软件	3,736	66,426.08	0.01
507	002270	华明装备	3,500	65,975.00	0.00
508	600993	马应龙	3,000	64,860.00	0.00
509	601988	中国银行	11,000	62,920.00	0.00
510	688090	瑞松科技	572	60,889.40	0.00
511	002110	三钢闽光	20,100	57,888.00	0.00
512	603567	珍宝岛	12,900	56,502.00	0.00
513	605168	三人行	1,100	55,704.00	0.00
514	002712	思美传媒	13,400	55,610.00	0.00
515	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
516	600999	招商证券	2,500	52,750.00	0.00
517	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
518	688785	恒运昌	113	52,335.95	0.00
519	300031	宝通科技	1,800	51,426.00	0.00
520	300961	深水海纳	4,000	51,400.00	0.00
521	603337	杰克科技	1,300	47,099.00	0.00
522	600761	安徽合力	2,800	45,808.00	0.00
523	603297	永新光学	300	44,085.00	0.00

524	600058	五矿发展	3,800	43,890.00	0.00
525	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
526	300748	金力永磁	1,300	40,105.00	0.00
527	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
528	000702	正虹科技	7,900	39,184.00	0.00
529	600026	中远海能	2,100	37,674.00	0.00
530	603228	景旺电子	500	36,205.00	0.00
531	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
532	300820	英杰电气	400	36,092.00	0.00
533	002921	联诚精密	1,300	35,542.00	0.00
534	600682	南京新百	6,700	34,505.00	0.00
535	300077	国民技术	1,100	34,485.00	0.00
536	688400	凌云光	476	31,511.20	0.00
537	002803	吉宏股份	1,200	31,008.00	0.00
538	301358	湖南裕能	400	30,348.00	0.00
539	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
540	605507	国邦医药	1,820	26,936.00	0.00
541	300244	迪安诊断	1,400	26,236.00	0.00
542	600179	安通控股	5,800	25,520.00	0.00
543	600452	涪陵电力	2,500	23,325.00	0.00
544	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
545	002101	广东鸿图	2,300	21,942.00	0.00
546	600717	天津港	5,500	21,395.00	0.00
547	002782	可立克	1,000	21,050.00	0.00
548	603132	金徽股份	1,300	20,254.00	0.00
549	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
550	688759	必贝特	600	19,188.00	0.00
551	000672	上峰材料	800	18,944.00	0.00
552	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
553	301162	国能日新	400	17,500.00	0.00
554	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
555	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
556	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
557	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
558	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
559	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
560	603220	中贝通信	600	12,822.00	0.00
561	600159	大龙地产	5,800	12,818.00	0.00
562	600320	振华重工	2,880	11,894.40	0.00
563	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
564	002011	盾安环境	1,000	10,610.00	0.00
565	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
566	300151	昌红科技	400	9,980.00	0.00

567	300351	永贵电器	600	9,900.00	0.00
568	600540	新赛股份	2,900	9,599.00	0.00
569	002591	恒大高新	1,500	9,180.00	0.00
570	002192	融捷股份	100	8,940.00	0.00
571	601939	建设银行	900	8,667.00	0.00
572	601112	振石股份	423	7,440.57	0.00
573	002273	水晶光电	200	7,096.00	0.00
574	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
575	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
576	300448	浩云科技	800	4,608.00	0.00
577	600366	宁波韵升	300	4,404.00	0.00
578	301667	纳百川	51	3,688.32	0.00
579	603248	锡华科技	160	3,374.40	0.00
580	688805	健信超导	65	3,053.05	0.00
581	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
582	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
583	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
584	301449	天溯计量	56	2,167.20	0.00
585	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
586	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	688372	伟测科技	16,670,194.64	3.18
2	688717	艾罗能源	16,600,206.80	3.17
3	688097	博众精工	15,625,619.95	2.98
4	300666	江丰电子	15,512,530.57	2.96
5	601677	明泰铝业	15,366,894.00	2.93
6	688516	奥特维	15,208,469.53	2.90
7	601858	中国科传	14,599,792.00	2.79
8	001339	智微智能	14,425,320.00	2.75
9	002545	东方铁塔	14,306,830.01	2.73
10	300738	奥飞数据	14,254,821.35	2.72
11	301018	申菱环境	14,129,024.20	2.70
12	002497	雅化集团	13,839,709.42	2.64
13	300672	国科微	13,792,453.00	2.63
14	601208	东材科技	13,745,452.00	2.62
15	000603	盛达资源	13,646,873.00	2.60
16	000923	河钢资源	13,551,611.00	2.59
17	688001	华兴源创	13,487,313.17	2.57
18	600961	株冶集团	13,478,421.00	2.57

19	600428	中远海特	13,374,157.00	2.55
20	600641	先导基电	13,359,026.00	2.55
21	688141	杰华特	13,157,128.19	2.51
22	688158	优刻得	13,089,439.94	2.50
23	300049	福瑞医科	12,841,572.00	2.45
24	300624	万兴科技	12,796,495.87	2.44
25	300953	震裕科技	12,765,479.00	2.44
26	000950	重药控股	12,623,176.00	2.41
27	002237	恒邦股份	12,622,986.86	2.41
28	301205	联特科技	12,588,596.00	2.40
29	688433	华曙高科	12,538,600.99	2.39
30	002151	北斗星通	12,359,236.34	2.36
31	688362	甬矽电子	12,304,419.35	2.35
32	688536	思瑞浦	12,117,402.21	2.31
33	300170	汉得信息	12,097,342.00	2.31
34	605376	博迁新材	12,047,009.00	2.30
35	688700	东威科技	12,039,197.98	2.30
36	688006	杭可科技	11,987,390.62	2.29
37	600338	西藏珠峰	11,975,031.80	2.28
38	688127	蓝特光学	11,926,479.41	2.28
39	002948	青岛银行	11,645,396.00	2.22
40	301626	苏州天脉	11,560,938.00	2.21
41	600452	涪陵电力	11,288,105.00	2.15
42	002245	蔚蓝锂芯	11,236,776.58	2.14
43	603496	恒为科技	11,180,633.00	2.13
44	301371	敷尔佳	11,156,764.50	2.13
45	301511	德福科技	11,108,037.00	2.12
46	300045	华力创通	11,068,823.00	2.11
47	000628	高新发展	11,027,326.00	2.10
48	300548	长芯博创	11,026,708.00	2.10
49	688766	普冉股份	11,012,895.46	2.10
50	601975	招商南油	11,002,723.00	2.10
51	000420	吉林化纤	10,951,370.00	2.09
52	688390	固德威	10,862,012.14	2.07
53	002400	省广集团	10,786,001.00	2.06
54	603826	坤彩科技	10,780,536.00	2.06
55	603162	海通发展	10,765,840.82	2.05
56	300602	飞荣达	10,762,129.00	2.05
57	688800	瑞可达	10,728,982.26	2.05
58	603283	赛腾股份	10,697,650.60	2.04
59	300438	鹏辉能源	10,684,220.00	2.04
60	688131	皓元医药	10,628,885.94	2.03
61	600773	西藏城投	10,613,608.50	2.03

62	002458	益生股份	10,574,707.27	2.02
63	600575	淮河能源	10,564,706.00	2.02

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	688498	源杰科技	21,546,909.89	4.11
2	300666	江丰电子	16,882,379.40	3.22
3	000603	盛达资源	16,618,514.00	3.17
4	600961	株冶集团	16,119,026.00	3.08
5	300548	长芯博创	15,738,787.00	3.00
6	688001	华兴源创	15,708,851.74	3.00
7	001309	德明利	15,637,462.00	2.98
8	002192	融捷股份	14,748,593.50	2.81
9	300624	万兴科技	14,573,285.00	2.78
10	601069	西部黄金	14,327,720.00	2.73
11	603496	恒为科技	14,211,087.00	2.71
12	600773	西藏城投	14,184,908.00	2.71
13	600338	西藏珠峰	13,897,958.00	2.65
14	688146	中船特气	13,343,647.78	2.55
15	688372	伟测科技	13,317,147.64	2.54
16	603358	华达科技	12,656,846.00	2.41
17	688006	杭可科技	12,517,707.33	2.39
18	002151	北斗星通	12,318,328.00	2.35
19	300861	美畅股份	12,216,407.00	2.33
20	300409	道氏技术	12,106,294.00	2.31
21	601126	四方股份	12,058,000.00	2.30
22	300775	三角防务	11,994,985.00	2.29
23	603283	赛腾股份	11,964,828.00	2.28
24	002487	大金重工	11,958,657.46	2.28
25	300738	奥飞数据	11,894,130.00	2.27
26	600452	涪陵电力	11,888,242.22	2.27
27	000420	吉林化纤	11,454,495.00	2.19
28	603306	华懋科技	11,447,088.00	2.18
29	688362	甬矽电子	11,423,316.39	2.18
30	300811	铂科新材	11,420,294.20	2.18
31	001339	智微智能	11,419,353.00	2.18
32	688127	蓝特光学	11,395,130.83	2.17
33	688409	富创精密	11,354,066.15	2.17
34	300475	香农芯创	11,255,952.03	2.15
35	300170	汉得信息	11,242,270.00	2.14
36	301171	易点天下	11,110,287.28	2.12

37	603533	掌阅科技	11,087,288.00	2.12
38	001203	大中矿业	11,066,210.30	2.11
39	601858	中国科传	10,906,503.00	2.08
40	300747	锐科激光	10,858,449.70	2.07
41	300045	华力创通	10,597,586.40	2.02
42	300438	鹏辉能源	10,563,578.00	2.02
43	688205	德科立	10,539,936.72	2.01
44	601208	东材科技	10,487,236.00	2.00

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	4,727,682,002.88
卖出股票收入（成交）总额	4,182,666,309.73

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,129,638.36	1.52
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	20,129,638.36	1.52

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	019827	26 国债 01	200,000	20,129,638.36	1.52

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	9,176,217.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,966,589.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,142,806.87

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 1000 指数增强 A	5,186	111,044.53	12,162,243.75	2.11	563,714,709.74	97.89
华泰柏瑞 中证 1000 指数增强 C	4,473	37,942.15	18,829,542.05	11.09	150,885,704.59	88.91
合计	9,500	78,483.39	30,991,785.80	4.16	714,600,414.33	95.84

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 1000 指数增强 A	7,701,827.90	1.3374
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	1,644.86	0.0010
	合计	7,703,472.76	1.0332

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 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 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 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 （2023 年 9 月 19 日）基金份额总额	237,197,469.05	110,701,240.53
本报告期期初基金 份额总额	290,069,988.43	63,964,666.47
本报告期基金总申 购份额	1,149,832,117.45	317,181,355.36
减：本报告期基金 总赎回份额	864,025,152.39	211,430,775.19
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	575,876,953.49	169,715,246.64

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人重大人事变动：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

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 (%)	
中金财富证券	3	8,907,763,687.00	100.00	1,659,968.59	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，本基金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 (%)
中金财富证券	20,022,800.00	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	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 10 日

	券的公告		
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