

# 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 2026 年第 2 季度报告

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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华泰柏瑞中证 1000 增强策略 ETF                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 场内简称       | 1000 增强（扩位证券简称：中证 1000 增强 ETF 华泰柏瑞）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金主代码      | 561590                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2022 年 11 月 23 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 报告期末基金份额总额 | 73,999,645.00 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 投资目标       | 在力求有效跟踪标的指数的基础上，利用定量投资模型，力争实现超越标的指数的投资回报，追求基金资产的长期增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资策略       | 1、股票的投资策略<br>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制相对业绩基准指数跟踪误差的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。<br>本基金运用的量化投资模型主要包括：<br>（1）多因子 alpha 模型——股票超额回报预测<br>多因子 alpha 模型以中国股票市场较长期的回溯研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。<br>多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>要性做出具有一定前瞻性的判断, 适合调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>(2) 风险估测模型——有效控制预期风险</p> <p>本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施, 有效控制投资组合的预期投资风险, 并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。</p> <p>(3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩</p> <p>本基金的交易成本模型既考虑固定成本, 也考虑交易的市场冲击效应, 以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上, 进行投资收益的优化。</p> <p>(4) 投资组合的优化和调整</p> <p>本基金将综合考虑预期回报, 风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。投资组合构建完成后, 本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况, 对投资组合进行相应调整, 并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。</p> <p>本基金对标的指数的跟踪目标是力争使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 0.35%, 年化跟踪误差不超过 6.5%。</p> <p>本基金以 T-1 日优化投资组合为基础, 考虑 T 日将会发生的成份股公司变动等情况, 设计 T 日申购、赎回清单并公告。</p> <p>2、存托凭证投资策略; 3、债券投资策略;</p> <p>4、衍生品投资策略: (1) 股指期货投资策略 (2) 股票期权投资策略 (3) 国债期货投资策略;</p> <p>5、资产支持证券的投资策略; 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金, 其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金; 本基金同时是指数型基金, 具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金管理人  | 华泰柏瑞基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

| 主要财务指标          | 报告期 (2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日) |
|-----------------|----------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 7,798,898.16                           |
| 2. 本期利润         | 14,641,917.56                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2864                                 |
| 4. 期末基金资产净值     | 126,874,620.95                         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.7145                                 |

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。

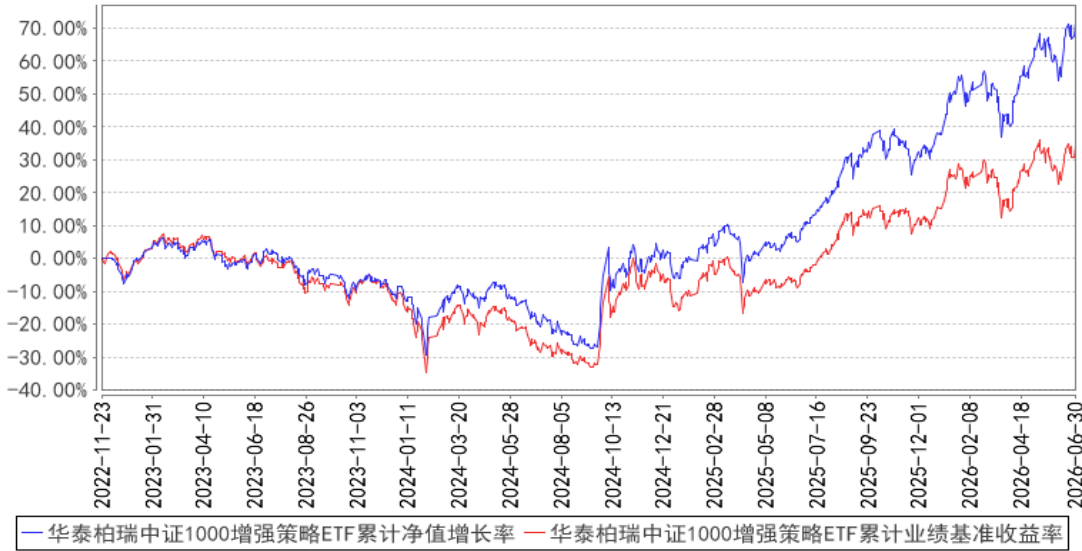
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 21.62%     | 1.63%         | 15.62%         | 1.61%                 | 6.00%  | 0.02%  |
| 过去六个月          | 24.37%     | 1.65%         | 15.99%         | 1.62%                 | 8.38%  | 0.03%  |
| 过去一年           | 54.68%     | 1.42%         | 38.60%         | 1.38%                 | 16.08% | 0.04%  |
| 过去三年           | 67.96%     | 1.63%         | 33.44%         | 1.65%                 | 34.52% | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 71.45%     | 1.53%         | 33.82%         | 1.55%                 | 37.63% | -0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2022 年 11 月 23 日至 2026 年 6 月 30 日。

§4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务            | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----|---------------|------------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |               | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 柳军 | 副总经理、本基金的基金经理 | 2022 年 11 月 23 日 | -    | 24 年   | 副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理，兼任华泰盈科资产管理有限公司证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科 |

|    |                           |                     |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|----|---------------------------|---------------------|---|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                           |                     |   |      | 技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 |
| 笪篁 | 量化与海外投资部<br>总监助理、本基金的基金经理 | 2022 年 11 月<br>23 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。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

**4.1.1 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**

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

**4.3 公平交易专项说明**

**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 4 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 报告期内基金的投资策略和运作分析**

2026 年二季度，A 股先升后落，上证指数跨越 4200 点关口，主要指数均创出多年新高。季初，美伊战事边际缓和，对全球能源体系威胁边际下降，市场风险偏好逐渐好转，结束三月初以来跌

势。进入财报季，市场对业绩较好的上市公司正反馈明显上升，市场进入普涨行情。五月中旬之后，市场进入结构性分化行情。海外人工智能相关资本开支增加，半导体硬件产业链提价预期上升，相关板块连创新高，结构化行情持续到季末。整体看，以涨价逻辑为主线的 AI 相关硬件，以及产业链上游的新材料和有色等表现较为活跃，而金融和消费相关行业表现相对稳健。

本报告期，代表大市值公司的沪深 300 上涨 11.9%；代表中小市值公司的中证 500、中证 1000 同期涨幅分别为 18.56%、15.62%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数下跌 10.74%。横向比较来看，股价弹性较大的中小市值公司，在本季度跑赢资源品占比较高的高股息类上市公司和大市值类上市公司。

本报告期内，我们坚持多因子模型的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

展望未来几个季度，A 股市场面临的国内外环境相对友好。2026 年以来，尽管美伊冲突威胁全球能源供应链，得益于能源安全体系构建，以及新能源转型的成果，国内经济韧性再一次得到验证。我们预计今后一段时间，能源安全将位于更加突出的位置，新能源转型升级也将更加深入推进。同时我们预期财政发力，消费补贴等扩内需政策将延续，并加强对人工智能等产业方向的引导。海外，美国的对外政策给全球经济发展带来不确定性，但中长期我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力。2026 年是“十五五”规划开局之年，从能源到 AI 基础设施等领域的投资预计将靠前发力，也将进一步增强市场对于中国经济的信心。在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的上升区间。

量化策略方面，在经历年初以来风险偏好的波动，以及大资金深度参与稳定市场预期之后，未来股票市场的不确定性在下降。随着半年度财报季临近，我们预计投资人将更加关注上市公司业绩展望的边际变化。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的成长和量价类因子近期表现较好，我们认为其趋势仍将延续。价值和质量类因子表现相对稳健，预计后续将有更好的表现。同时，我们认为在后市当中，大小市值、各行业股票均有机会，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，对于专注于捕捉边际变化逻辑的量化投资，超额收益或将得到进一步提高，是很不错的配置风格均衡的多因子量化基金的机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7145 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.62%，业绩比较基准收益率为 15.62%。



#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 122,447,897.35 | 96.43        |
|    | 其中：股票             | 122,447,897.35 | 96.43        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 97,702.14      | 0.08         |
|    | 其中：债券             | 97,702.14      | 0.08         |
|    | 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      | 4,007,682.08   | 3.16         |
| 8  | 其他资产              | 426,396.03     | 0.34         |
| 9  | 合计                | 126,979,677.60 | 100.00       |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 137,844.00    | 0.11         |
| B  | 采矿业              | 3,099,427.20  | 2.44         |
| C  | 制造业              | 91,071,615.20 | 71.78        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,328,041.00  | 1.05         |
| E  | 建筑业              | 729,330.00    | 0.57         |
| F  | 批发和零售业           | 2,357,481.00  | 1.86         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,365,241.04  | 1.86         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 92,820.00     | 0.07         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 12,039,831.71 | 9.49         |
| J  | 金融业              | 1,906,713.60  | 1.50         |
| K  | 房地产业             | 1,155,871.00  | 0.91         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 623,799.00     | 0.49  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 2,748,474.60   | 2.17  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,239,428.00   | 0.98  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —              | —     |
| P | 教育            | 206,100.00     | 0.16  |
| Q | 卫生和社会工作       | 586,562.00     | 0.46  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 759,318.00     | 0.60  |
| S | 综合            | —              | —     |
|   | 合计            | 122,447,897.35 | 96.51 |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

## 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 688630 | 芯碁微装 | 5,200  | 2,856,828.00 | 2.25         |
| 2  | 688519 | 南亚新材 | 5,800  | 2,204,232.00 | 1.74         |
| 3  | 301031 | 中熔电气 | 17,269 | 2,062,782.05 | 1.63         |
| 4  | 688536 | 思瑞浦  | 5,500  | 2,002,495.00 | 1.58         |
| 5  | 300438 | 鹏辉能源 | 23,500 | 1,946,975.00 | 1.53         |
| 6  | 688409 | 富创精密 | 5,660  | 1,733,375.00 | 1.37         |
| 7  | 301095 | 广立微  | 11,900 | 1,404,795.00 | 1.11         |
| 8  | 688123 | 聚辰股份 | 6,384  | 1,357,238.40 | 1.07         |
| 9  | 300990 | 同飞股份 | 11,400 | 1,197,798.00 | 0.94         |
| 10 | 688372 | 伟测科技 | 6,400  | 1,190,400.00 | 0.94         |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

|    |           |           |      |
|----|-----------|-----------|------|
| 1  | 国家债券      | -         | -    |
| 2  | 央行票据      | -         | -    |
| 3  | 金融债券      | -         | -    |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -    |
| 4  | 企业债券      | -         | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -    |
| 6  | 中期票据      | -         | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 97,702.14 | 0.08 |
| 8  | 同业存单      | -         | -    |
| 9  | 其他        | -         | -    |
| 10 | 合计        | 97,702.14 | 0.08 |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 127114 | 宣化转债 | 977   | 97,702.14 | 0.08         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称                | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元）      | 公允价值变动（元） | 风险说明       |
|-------------------|-------------------|----------|--------------|-----------|------------|
| IM2609            | 中证 1000 股指期货 2609 | 2        | 3,394,000.00 | 76,200.00 | -          |
| 公允价值变动总额合计（元）     |                   |          |              |           | 76,200.00  |
| 股指期货投资本期收益（元）     |                   |          |              |           | 255,184.56 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |                   |          |              |           | 275,600.00 |

##### 5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 426,396.03 |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | —          |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 其他      | —          |
| 8  | 合计      | 426,396.03 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金未持有积极投资的股票。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 41,499,645.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 45,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 12,500,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 73,999,645.00 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 序号 | 报告期内持有基金份额变化情况                       |      |               | 报告期末持有基金情况    |                        |
|--------|----|--------------------------------------|------|---------------|---------------|------------------------|
|        |    | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间              | 期初份额 | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额<br>份额占比(%)        |
| 个人     | 1  | 20260527-20260610;20260615-20260630; | -    | 34,809,000.00 | 11,000,000.00 | 23,809,000.00<br>32.17 |
| 产品特有风险 |    |                                      |      |               |               |                        |

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20% 的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 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

### 9.3 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 7 月 21 日