# 华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金
# 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 ..... 6
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7

**§4 管理人报告 ..... 9**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 10
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 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
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 ..... 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 13

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 13**

6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 14
6.3 净资产变动表 ..... 16
6.4 报表附注 ..... 18

**§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 ..... 51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 54
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 ..... 54
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 ..... 54
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 ..... 54

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 ..... 54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 54
7.12 投资组合报告附注 ..... 54
**§8 基金份额持有人信息 ..... 55**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 55
8.2 盈利投资者数量占比 ..... 56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 56
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 56
**§9 开放式基金份额变动 ..... 56**
**§10 重大事件揭示 ..... 57**
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 57
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 ..... 57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 57
10.4 基金投资策略的改变 ..... 57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 57
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 ..... 58
10.8 其他重大事件 ..... 61
**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 61**
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 ..... 61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 61
**§12 备查文件目录 ..... 62**
12.1 备查文件目录 ..... 62
12.2 存放地点 ..... 62
12.3 查阅方式 ..... 62

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华泰柏瑞研究精选 | |
| 基金主代码 | 007968 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 11 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 | 202,737,463.27 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 007968 | 010291 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 197,313,449.36 份 | 5,424,013.91 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金通过深入的基本面研究把握投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | 1、大类资产配置：本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。<br>2、股票投资策略：本基金主要采用“自下而上”的深度基本面研究策略，主要从公司主营业务、公司商业模式、公司财务状况、公司治理结构情况、公司所处行业和公司估值方面进行深度研究从而精选个股。<br>3、债券组合投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。<br>4、资产支持证券投资策略：在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。<br>5、股指期货投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。 |

| | |
|---|---|
| | 6、融资业务的投资策略：本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。 |

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C |
| 本期已实现收益 | 43,631,272.92 | 1,046,476.69 |
| 本期利润 | 40,280,398.49 | 963,891.53 |

| | | |
|---|---|---|
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1788 | 0.1665 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.87% | 11.36% |
| 本期基金份额净值增长率 | 12.09% | 11.81% |
| 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 | 108,342,249.67 | 2,739,171.60 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5491 | 0.5050 |
| 期末基金资产净值 | 305,655,699.03 | 8,163,185.51 |
| 期末基金份额净值 | 1.5491 | 1.5050 |
| 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 | 54.91% | -0.32% |

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

华泰柏瑞研究精选 A

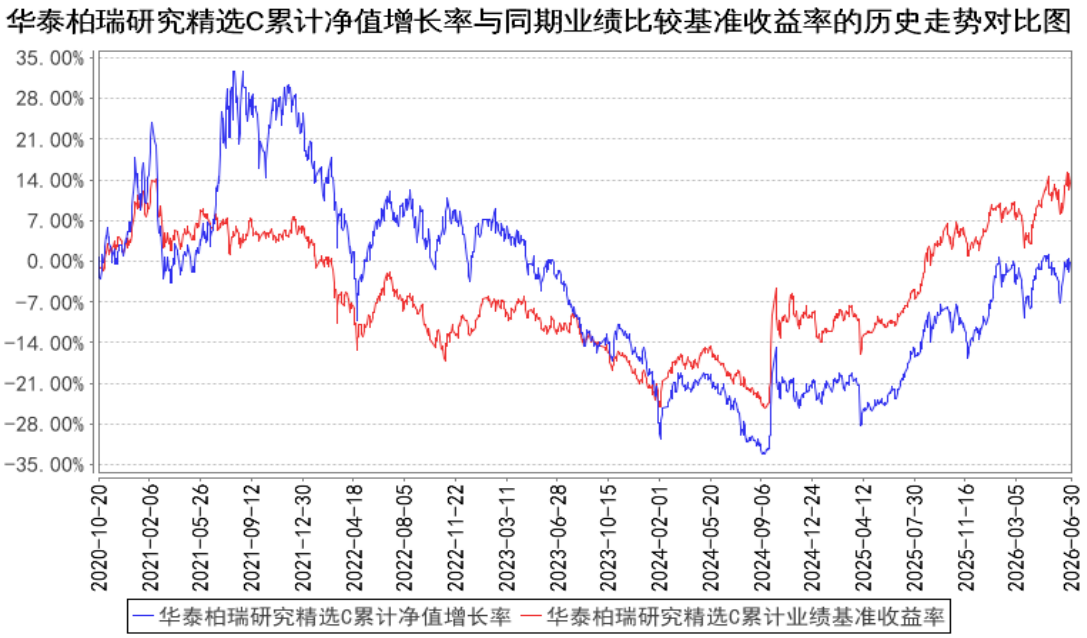
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 7.70% | 1.12% | 11.04% | 1.07% | -3.34% | 0.05% |
| 过去六个月 | 12.09% | 1.17% | 9.15% | 0.99% | 2.94% | 0.18% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一年 | 27.29% | 1.09% | 26.25% | 0.88% | 1.04% | 0.21% |
| 过去三年 | 2.86% | 1.15% | 29.90% | 0.94% | -27.04% | 0.21% |
| 过去五年 | -9.21% | 1.31% | 6.58% | 0.91% | -15.79% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.91% | 1.37% | 37.14% | 0.95% | 17.77% | 0.42% |

华泰柏瑞研究精选 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 | 7.56% | 1.12% | 11.04% | 1.07% | -3.48% | 0.05% |
| 过去六个月 | 11.81% | 1.17% | 9.15% | 0.99% | 2.66% | 0.18% |
| 过去一年 | 26.65% | 1.09% | 26.25% | 0.88% | 0.40% | 0.21% |
| 过去三年 | 1.31% | 1.15% | 29.90% | 0.94% | -28.59% | 0.21% |
| 过去五年 | -11.50% | 1.31% | 6.58% | 0.91% | -18.08% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.32% | 1.34% | 14.79% | 0.91% | -15.11% | 0.43% |

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




注：A 类图示日期为 2019 年 11 月 19 日至 2026 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2020 年 10 月 20 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 | | |
| 吴邦栋 | 主动权益投资部副总监、本基金的基金经理 | 2023 年 6 月 9 日 | - | 15 年 | 上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级研究员兼基金经理助理。2018 年 3 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 8 月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 12 月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2022 年 1 月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月至 2025 年 10 月任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月至 2023 年 11 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月至 2023 年 10 月任华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月至 2025 年 10 月任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |

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

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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中的公平交易模块，

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 年上半年市场整体震荡上行，但结构分化显著。一季度在政策预期、科技产业趋势和流动性改善推动下，风险偏好回升，随后受海外不确定性影响出现波动；二季度 AI 算力链业绩兑现，市场重拾升势，行情由上游硬件向应用、新能源新技术和新材料等方向扩散。6 月下旬高位板块波动加大，随后有所修复。按 2025 年 12 月 31 日与 2026 年 6 月 30 日收盘点位计算，上证指数上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 上涨 64.25%，成长风格明显占优。

宏观层面，经济延续结构性修复，外需和制造业保持韧性，内需和地产仍有一定压力。政策保持积极，更重视结构性工具和新质生产力支持，“十五五”相关部署持续落地。海外利率路径、地缘局势和贸易政策反复，成为阶段性扰动因素。总体看，流动性环境仍对市场形成支撑，但基本面改善并不均衡。

行业层面，AI 算力、半导体、新能源新技术和部分新材料表现活跃，二季度行情逐步向 AI 应用、消费电子等中下游环节扩散；创新药和部分顺周期品种也有阶段性机会。消费板块整体相对承压，不同行业和个股之间的收益差异扩大，市场呈现指数较强、个股分化较大的特征。

本基金延续景气驱动、自下而上选股的思路，保持行业配置相对均衡并侧重成长。年初增配受益于 AI 趋势和自主可控的半导体，随后增加新能源电池新技术、创新药以及部分顺周期优质个股；二季度在继续持有景气方向的同时，对涨幅较大的算力硬件适度减持，增配新材料、AI 应用和消费电子。消费和医药继续精选个股，对季报低于预期、盈利趋势弱化或估值性价比下降的品种进行调整，整体在控制组合波动的同时努力把握结构性机会。

### 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研究精选 A 的基金份额净值为 1.5491 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.09%，同期业绩比较基准收益率为 9.15%，截至本报告期末华泰柏瑞研究精选 C 的基金份额净值为1.5050元，本报告期基金份额净值增长率为11.81%，同期业绩比较基准收益率为9.15%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场在经历快速上涨和分化加剧后，短期可能进入震荡消化阶段。科技成长成交占比较高，前期累积涨幅需要业绩进一步验证。中报或将成为检验景气和估值匹配度的重要窗口，前期涨幅较大但业绩兑现不足的品种面临调整风险；海外利率、地缘局势和贸易政策仍可能带来阶段性波动。市场风格切换可能加快，单纯依赖估值扩张的方向波动或会更大。我们将降低对单一主题和短期情绪的依赖，更重视盈利质量和估值约束。

中期看，“十五五”政策落地、新质生产力投资和 AI 产业趋势仍可能提供结构性机会。我们将继续围绕景气和估值匹配努力优化组合，重点关注 AI 由上游算力向应用端扩散、半导体设备材料国产替代、新能源材料与新技术，以及创新药、消费电子等产业变化相对明确的方向；对景气见底、供需格局改善的部分周期细分领域保持跟踪。对于前期涨幅较大、交易拥挤的方向，将以业绩兑现和估值空间作为持有标准；对于估值低位方向，也不会因估值较低而放松景气要求。操作上保持仓位稳定，坚持自下而上挖掘个股，强化盈利验证和风险控制，力争动态优化组合结构。

### 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

托管人声明：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的真实、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：华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 19,731,588.07 | 22,247,193.04 |
| 结算备付金 | | 2,452,424.44 | 2,128,328.79 |
| 存出保证金 | | 76,879.16 | 54,668.61 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 293,077,249.14 | 336,038,648.39 |
| 其中：股票投资 | | 293,077,249.14 | 336,038,648.39 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 30,986.55 | 5,315.38 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 315,369,127.36 | 360,474,154.21 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | | 252.70 | - |
| 应付赎回款 | | 821,014.77 | 1,100,795.62 |
| 应付管理人报酬 | | 310,083.33 | 369,867.52 |
| 应付托管费 | | 51,680.58 | 61,644.56 |
| 应付销售服务费 | | 3,309.47 | 3,545.11 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 363,901.97 | 448,317.69 |
| 负债合计 | | 1,550,242.82 | 1,984,170.50 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 202,737,463.27 | 259,560,136.49 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 111,081,421.27 | 98,929,847.22 |
| 净资产合计 | | 313,818,884.54 | 358,489,983.71 |
| 负债和净资产总计 | | 315,369,127.36 | 360,474,154.21 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 202,737,463.27 份，其中华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.5491 元，基金份额总额 197,313,449.36 份；C 类基金份额净值 1.5050 元，基金份额总额 5,424,013.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 43,773,869.26 | 4,818,418.85 |
| 1.利息收入 | | 87,199.71 | 94,348.13 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 87,199.71 | 94,348.13 |
| 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） | | 47,113,209.29 | 10,377,663.46 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 42,834,662.76 | 5,113,538.49 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 4,278,546.53 | 5,264,124.97 |
| 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 | -3,433,459.59 | -5,656,843.56 |
| 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 | 6,919.85 | 3,250.82 |
| **减：二、营业总支出** | | 2,529,579.24 | 3,025,195.34 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,072,732.65 | 2,493,694.42 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 345,455.49 | 415,615.74 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 21,034.33 | 25,222.99 |
| 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 | | - | - |
| 8．其他费用 | 6.4.7.23 | 90,356.77 | 90,662.19 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 41,244,290.02 | 1,793,223.51 |
| 减：所得税费用 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 41,244,290.02 | 1,793,223.51 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 41,244,290.02 | 1,793,223.51 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金

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<br>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 | 259,560,136.49 | - | 98,929,847.22 | 358,489,983.71 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 259,560,136.49 | - | 98,929,847.22 | 358,489,983.71 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -56,822,673.22 | - | 12,151,574.05 | -44,671,099.17 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 41,244,290.02 | 41,244,290.02 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -56,822,673.22 | - | -29,092,715.97 | -85,915,389.19 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,769,573.79 | - | 1,377,271.32 | 4,146,845.11 |
| 2.基金赎回款 | -59,592,247.01 | - | -30,469,987.29 | -90,062,234.30 |
| （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 | 202,737,463.27 | - | 111,081,421.27 | 313,818,884.54 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>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 | 370,836,169.74 | - | 77,876,992.68 | 448,713,162.42 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 370,836,169.74 | - | 77,876,992.68 | 448,713,162.42 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -41,714,912.14 | - | -6,681,327.16 | -48,396,239.30 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 1,793,223.51 | 1,793,223.51 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -41,714,912.14 | - | -8,474,550.67 | -50,189,462.81 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,718,849.73 | - | 518,764.59 | 3,237,614.32 |
| 2.基金赎回款 | -44,433,761.87 | - | -8,993,315.26 | -53,427,077.13 |
| （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 | 329,121,257.60 | - | 71,195,665.52 | 400,316,923.12 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| 崔春 | 房伟力 | 赵景云 |
| --- | --- | --- |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金(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[2019]875 号《关于准予华泰柏瑞研究精选混合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《华泰柏瑞研究精选混合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 2,640,579,364.32 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(2019)第 0665 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,641,505,156.52 份基金份额，其中认购资金利息折合 925,792.20 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。

根据本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2020 年 10 月 16 日发布的《关于华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》以及更新的《华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2020 年 10 月 20 日起，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞研究精选混合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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。本基金持有的股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包

括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准中证 800 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×10%+银行活期存款利率(税后)×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2026 年 08 月 28 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财

税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 19,731,588.07 |
| 等于：本金 | 19,729,535.71 |
| 加：应计利息 | 2,052.36 |
| 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 | 19,731,588.07 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 294,261,839.12 | - | 293,077,249.14 | -1,184,589.98 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 294,261,839.12 | - | 293,077,249.14 | -1,184,589.98 |

### 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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

### 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 | 4.45 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 287,034.06 |
| 其中：交易所市场 | 287,034.06 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 76,863.46 |
| 合计 | 363,901.97 |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞研究精选 A

| 项目 | 本期<br>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 | 253,330,291.77 | 253,330,291.77 |
| 本期申购 | 2,183,523.00 | 2,183,523.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -58,200,365.41 | -58,200,365.41 |
| 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 | 197,313,449.36 | 197,313,449.36 |

华泰柏瑞研究精选 C

| 项目 | 本期<br>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 | 6,229,844.72 | 6,229,844.72 |
| 本期申购 | 586,050.79 | 586,050.79 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,391,881.60 | -1,391,881.60 |
| 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 | 5,424,013.91 | 5,424,013.91 |

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞研究精选 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 149,835,418.39 | -53,061,218.31 | 96,774,200.08 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 149,835,418.39 | -53,061,218.31 | 96,774,200.08 |
| 本期利润 | 43,631,272.92 | -3,350,874.43 | 40,280,398.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -39,480,888.14 | 10,768,539.24 | -28,712,348.90 |
| 其中：基金申购款 | 1,518,485.44 | -414,300.92 | 1,104,184.52 |
| 基金赎回款 | -40,999,373.58 | 11,182,840.16 | -29,816,533.42 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 153,985,803.17 | -45,643,553.50 | 108,342,249.67 |

华泰柏瑞研究精选 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 3,453,728.51 | -1,298,081.37 | 2,155,647.14 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 3,453,728.51 | -1,298,081.37 | 2,155,647.14 |
| 本期利润 | 1,046,476.69 | -82,585.16 | 963,891.53 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -515,685.41 | 135,318.34 | -380,367.07 |
| 其中：基金申购款 | 385,160.33 | -112,073.53 | 273,086.80 |
| 基金赎回款 | -900,845.74 | 247,391.87 | -653,453.87 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,984,519.79 | -1,245,348.19 | 2,739,171.60 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 85,350.81 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 1,742.92 |
| 其他 | 105.98 |
| 合计 | 87,199.71 |

## 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 | 42,834,662.76 |
| 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 | 42,834,662.76 |

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 672,610,945.79 |
| 减：卖出股票成本总额 | 628,729,246.20 |
| 减：交易费用 | 1,047,036.83 |
| 买卖股票差价收入 | 42,834,662.76 |

### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

### 6.4.7.15 债券投资收益

### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 4,278,546.53 |
| 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 | 4,278,546.53 |

### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -3,433,459.59 |
| 股票投资 | -3,433,459.59 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |

| | |
|---|---|
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -3,433,459.59 |

### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 5,744.09 |
| 基金转换费收入 | 1,175.76 |
| 合计 | 6,919.85 |

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50%归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 50%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<br>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 | - |
| 银行间账户服务费 | 9,000.00 |
| 银行划款手续费 | 4,493.31 |
| 合计 | 90,356.77 |

## 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 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”) | 基金管理人的股东的华泰证券的控股子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 7,222,434.08 | 0.57 | - | - |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | | | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 3,611.38 | 0.57 | 381.20 | 0.13 |

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| - | - | - | - | - |

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

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 2,072,732.65 | 2,493,694.42 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 945,363.24 | 1,032,463.10 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,127,369.41 | 1,461,231.32 |

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 1.20%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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.20%/ 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 345,455.49 | 415,615.74 |

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司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 × 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<br>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 | | |
| | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C | 合计 |
| 招商银行股份有限公司 | - | 15,016.26 | 15,016.26 |
| 华泰证券股份有限公司 | - | 3,106.94 | 3,106.94 |
| 合计 | - | 18,123.20 | 18,123.20 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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 | | |
| | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C | 合计 |
| 招商银行股份有限公司 | - | 16,400.31 | 16,400.31 |
| 华泰证券股份有限公司 | - | 3,455.92 | 3,455.92 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司 | - | 1.44 | 1.44 |
| 合计 | - | 19,857.67 | 19,857.67 |

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 0.50%的年费率计提，计算方法如下：

H = E × 0.50% ÷ 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>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 | 19,731,588.07 | 85,350.81 | 24,295,008.38 | 92,022.99 |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 华泰联合证券 | 603293 | 埃泰克 | 网下申购 | 644 | 21,567.56 |
| 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 华泰联合证券 | 301458 | 钧崴电子 | 网下申购 | 7,005 | 72,852.00 |
| 华泰联合证券 | 688757 | 胜科纳米 | 网下申购 | 5,357 | 48,641.56 |
| 华泰联合证券 | 603014 | 威高血净 | 网下申购 | 2,045 | 54,192.50 |

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001220 | 世盟股份 | 2026 年 1 月 27 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 28.00 | 27.78 | 57 | 1,596.00 | 1,583.46 | - |
| 001237 | 惠康科技 | 2026 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 53.26 | 58.74 | 150 | 7,989.00 | 8,811.00 | - |
| 001248 | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 10.11 | 10.11 | 10,636 | 107,529.96 | 107,529.96 | - |
| 001248 | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 1 个月内（含） | 新股未上市 | 10.11 | 10.11 | 4,558 | 46,081.38 | 46,081.38 | - |
| 001257 | 盛龙股份 | 2026 年 3 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 7.82 | 20.74 | 1,485 | 11,612.70 | 30,798.90 | - |
| 001312 | 福恩 | 2026 年 4 | 6 个月 | 新股 | 18.38 | 16.78 | 130 | 2,389.40 | 2,181.40 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 股份 | 月 14 日 | | 锁定期内 | | | | | | |
| 001365 | 天海电子 | 2026 年 5 月 11 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 27.19 | 31.31 | 376 | 10,223.44 | 11,772.56 | - |
| 001393 | 维通利 | 2026 年 5 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 30.38 | 38.99 | 265 | 8,050.70 | 10,332.35 | - |
| 001399 | 惠科股份 | 2026 年 6 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 10.12 | 27.73 | 1,648 | 16,677.76 | 45,699.04 | - |
| 301513 | 尚水智能 | 2026 年 4 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 26.66 | 50.96 | 138 | 3,679.08 | 7,032.48 | - |
| 301531 | 春光集团 | 2026 年 4 月 28 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 13.30 | 51.56 | 290 | 3,857.00 | 14,952.40 | - |
| 301599 | 理奇智能 | 2026 年 4 月 22 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 13.91 | 32.47 | 433 | 6,023.03 | 14,059.51 | - |
| 301666 | 大普微 | 2026 年 4 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 46.08 | 463.33 | 540 | 24,883.20 | 250,198.20 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 期内 | | | | | | |
| 301669 | 高特电子 | 2026 年 6 月 2 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 7.08 | 28.40 | 546 | 3,865.68 | 15,506.40 | - |
| 301680 | 固德电材 | 2026 年 2 月 27 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 58.00 | 112.16 | 117 | 6,786.00 | 13,122.72 | - |
| 301682 | 宏明电子 | 2026 年 3 月 18 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 69.66 | 160.06 | 339 | 23,614.74 | 54,260.34 | - |
| 301683 | 慧谷新材 | 2026 年 3 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 78.38 | 121.77 | 80 | 6,270.40 | 9,741.60 | - |
| 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 | 344 | 3,845.92 | 6,050.96 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 65 | 2,176.85 | 2,205.45 | - |
| 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 | 231 | 4,088.70 | 19,477.92 | - |
| 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 | - |
| 688759 | 必贝 | 2025 年 10 | 6 个月以上 | 新股 | 17.78 | 30.65 | 9,153 | 162,740.34 | 280,539.45 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 特 | 月 21 日 | | 锁定期内 | | | | | | |
| 688765 | 禾元生物 | 2025 年 10 月 16 日 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 29.06 | 48.56 | 7,326 | 212,893.56 | 355,750.56 | - |
| 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 | 3,327 | 75,456.36 | 140,266.32 | - |
| 688783 | 西安奕材 | 2025 年 10 月 20 日 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 8.62 | 57.42 | 17,255 | 148,738.10 | 990,782.10 | - |
| 688785 | 恒运昌 | 2026 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 92.18 | 463.15 | 93 | 8,572.74 | 43,072.95 | - |
| 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 | 1,101 | 91,449.06 | 139,221.45 | - |
| 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 | 1,378 | 157,477.84 | 932,823.32 | - |
| 688797 | 臻宝科技 | 2026 年 6 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 44.56 | 468.67 | 125 | 5,570.00 | 58,583.75 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 期内 | | | | | | |
| 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 | 999 | 104,555.34 | 768,121.11 | - |
| 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 | 89 | 7,287.32 | 141,005.37 | - |
| 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 | 易思维 | 2026 年 2 月 4 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 55.95 | 57.10 | 152 | 8,504.40 | 8,679.20 | - |
| 688818 | 电科蓝天 | 2026 年 2 月 3 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 9.47 | 70.14 | 1,098 | 10,398.06 | 77,013.72 | - |
| 688820 | 盛合晶微 | 2026 年 4 月 13 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 19.68 | 141.49 | 516 | 10,154.88 | 73,008.84 | - |

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

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

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

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

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 601369 | 陕鼓动力 | 2026 年 6 月 29 日 | 重大事项停牌 | 9.05 | 2026 年 7 月 13 日 | 9.96 | 300 | 2,619.44 | 2,715.00 | - |

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

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合

理的价格变现。

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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 | 19,731,588.07 | - | - | - | - | - | 19,731,588.07 |
| 结算备付金 | 2,452,424.44 | - | - | - | - | - | 2,452,424.44 |
| 存出保证金 | 76,879.16 | - | - | - | - | - | 76,879.16 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 293,077,249.14 | 293,077,249.14 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 30,986.55 | 30,986.55 |
| 资产总计 | 22,260,891.67 | - | - | - | - | 293,108,235.69 | 315,369,127.36 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 821,014.77 | 821,014.77 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 310,083.33 | 310,083.33 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 51,680.58 | 51,680.58 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 252.70 | 252.70 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 3,309.47 | 3,309.47 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 363,901.97 | 363,901.97 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,550,242.82 | 1,550,242.82 |
| 利率敏感度缺口 | 22,260,891.67 | - | - | - | - | 291,557,992.87 | 313,818,884.54 |
| 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 | 22,247,193.0 | - | - | - | - | - | 22,247,193.0 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 4 | | | | | | 4 |
| 结算备付金 | 2,128,328.79 | - | - | - | - | - | 2,128,328.79 |
| 存出保证金 | 54,668.61 | - | - | - | - | - | 54,668.61 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 336,038,648.39 | 336,038,648.39 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 5,315.38 | 5,315.38 |
| 资产总计 | 24,430,190.44 | - | - | - | - | 336,043,963.77 | 360,474,154.21 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,100,795.62 | 1,100,795.62 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 369,867.52 | 369,867.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 61,644.56 | 61,644.56 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 3,545.11 | 3,545.11 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 448,317.69 | 448,317.69 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,984,170.50 | 1,984,170.50 |
| 利率敏感度缺口 | 24,430,190.44 | - | - | - | - | 334,059,793.27 | 358,489,983.71 |

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

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>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 | 293,077,249.14 | 93.39 | 336,038,648.39 | 93.74 |
| 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 | 293,077,249.14 | 93.39 | 336,038,648.39 | 93.74 |

### 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% | 14,898,962.30 | 19,159,029.34 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -14,898,962.30 | -19,159,029.34 |

## 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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 288,197,310.17 | 327,779,480.31 |
| 第二层次 | 156,326.34 | 5,227,378.00 |
| 第三层次 | 4,723,612.63 | 3,031,790.08 |
| 合计 | 293,077,249.14 | 336,038,648.39 |

#### 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 | 293,077,249.14 | 92.93 |
| | 其中：股票 | 293,077,249.14 | 92.93 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 22,184,012.51 | 7.03 |
| 8 | 其他各项资产 | 107,865.71 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 315,369,127.36 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 8,888,436.90 | 2.83 |
| C | 制造业 | 189,812,984.39 | 60.48 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,844,778.34 | 0.91 |
| E | 建筑业 | 13,298,195.00 | 4.24 |
| F | 批发和零售业 | 7,011,415.20 | 2.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,561,422.26 | 5.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,606,246.07 | 6.25 |
| J | 金融业 | 9,747,059.00 | 3.11 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 989,014.00 | 0.32 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,914,903.98 | 2.52 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,394,938.00 | 4.91 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 6,870.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 986.00 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 293,077,249.14 | 93.39 |

### 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 | 600176 | 中国巨石 | 219,300 | 15,982,584.00 | 5.09 |
| 2 | 300054 | 鼎龙股份 | 128,400 | 13,606,548.00 | 4.34 |
| 3 | 300408 | 三环集团 | 79,900 | 13,335,310.00 | 4.25 |
| 4 | 688368 | 晶丰明源 | 59,111 | 12,798,713.72 | 4.08 |
| 5 | 603929 | 亚翔集成 | 42,300 | 11,506,446.00 | 3.67 |
| 6 | 688388 | 嘉元科技 | 231,839 | 10,200,916.00 | 3.25 |
| 7 | 600186 | 莲花控股 | 635,530 | 8,897,420.00 | 2.84 |
| 8 | 000951 | 中国重汽 | 443,800 | 8,658,538.00 | 2.76 |
| 9 | 605117 | 德业股份 | 74,560 | 7,916,780.80 | 2.52 |
| 10 | 603127 | 昭衍新药 | 206,300 | 7,884,786.00 | 2.51 |
| 11 | 605016 | 百龙创园 | 294,800 | 7,620,580.00 | 2.43 |
| 12 | 002557 | 洽洽食品 | 406,998 | 7,309,684.08 | 2.33 |
| 13 | 300867 | 圣元环保 | 389,900 | 7,064,988.00 | 2.25 |
| 14 | 002033 | 丽江股份 | 847,100 | 6,997,046.00 | 2.23 |
| 15 | 300750 | 宁德时代 | 17,467 | 6,864,705.67 | 2.19 |
| 16 | 603558 | 健盛集团 | 616,100 | 6,832,549.00 | 2.18 |
| 17 | 301371 | 敷尔佳 | 262,000 | 6,812,000.00 | 2.17 |
| 18 | 688111 | 金山办公 | 31,847 | 6,785,003.35 | 2.16 |
| 19 | 600872 | 中炬高新 | 386,000 | 6,700,960.00 | 2.14 |
| 20 | 601579 | 会稽山 | 449,400 | 6,601,686.00 | 2.10 |
| 21 | 301219 | 腾远钴业 | 117,620 | 6,445,576.00 | 2.05 |
| 22 | 603162 | 海通发展 | 699,540 | 6,274,873.80 | 2.00 |
| 23 | 600546 | 山煤国际 | 570,300 | 6,233,379.00 | 1.99 |
| 24 | 301358 | 湖南裕能 | 78,500 | 5,955,795.00 | 1.90 |
| 25 | 603345 | 安井食品 | 73,300 | 5,877,927.00 | 1.87 |
| 26 | 600233 | 圆通速递 | 373,100 | 5,876,325.00 | 1.87 |
| 27 | 600499 | 科达制造 | 416,500 | 5,747,700.00 | 1.83 |
| 28 | 605189 | 富春染织 | 473,219 | 5,702,288.95 | 1.82 |
| 29 | 600989 | 宝丰能源 | 267,000 | 5,428,110.00 | 1.73 |
| 30 | 600177 | 雅戈尔 | 288,600 | 2,173,158.00 | 0.69 |
| 31 | 600511 | 国药股份 | 77,500 | 2,018,100.00 | 0.64 |
| 32 | 603565 | 中谷物流 | 204,300 | 2,004,183.00 | 0.64 |
| 33 | 600887 | 伊利股份 | 80,700 | 1,933,572.00 | 0.62 |
| 34 | 000001 | 平安银行 | 192,200 | 1,931,610.00 | 0.62 |
| 35 | 002867 | 周大生 | 167,200 | 1,864,280.00 | 0.59 |
| 36 | 002032 | 苏 泊 尔 | 47,000 | 1,861,200.00 | 0.59 |
| 37 | 000848 | 承德露露 | 249,000 | 1,842,600.00 | 0.59 |
| 38 | 002563 | 森马服饰 | 364,900 | 1,839,096.00 | 0.59 |
| 39 | 600285 | 羚锐制药 | 93,600 | 1,813,968.00 | 0.58 |
| 40 | 000828 | 东莞控股 | 193,000 | 1,806,480.00 | 0.58 |
| 41 | 600919 | 江苏银行 | 167,200 | 1,802,416.00 | 0.57 |
| 42 | 600023 | 浙能电力 | 341,400 | 1,795,764.00 | 0.57 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 43 | 600502 | 安徽建工 | 411,400 | 1,789,590.00 | 0.57 |
| 44 | 000895 | 双汇发展 | 79,871 | 1,789,110.40 | 0.57 |
| 45 | 603233 | 大参林 | 118,500 | 1,781,055.00 | 0.57 |
| 46 | 002216 | 三全食品 | 154,300 | 1,779,079.00 | 0.57 |
| 47 | 002832 | 比音勒芬 | 84,800 | 1,750,272.00 | 0.56 |
| 48 | 601577 | 长沙银行 | 197,600 | 1,721,096.00 | 0.55 |
| 49 | 601857 | 中国石油 | 185,200 | 1,607,536.00 | 0.51 |
| 50 | 601997 | 贵阳银行 | 312,800 | 1,604,664.00 | 0.51 |
| 51 | 603195 | 公牛集团 | 40,800 | 1,597,320.00 | 0.51 |
| 52 | 601000 | 唐山港 | 384,800 | 1,596,920.00 | 0.51 |
| 53 | 600566 | 济川药业 | 60,100 | 1,333,619.00 | 0.42 |
| 54 | 600827 | 百联股份 | 179,700 | 1,331,577.00 | 0.42 |
| 55 | 600323 | 瀚蓝环境 | 48,400 | 1,329,064.00 | 0.42 |
| 56 | 002128 | 电投能源 | 43,900 | 1,014,968.00 | 0.32 |
| 57 | 688783 | 西安奕材 | 17,255 | 990,782.10 | 0.32 |
| 58 | 601077 | 渝农商行 | 161,700 | 987,987.00 | 0.31 |
| 59 | 002027 | 分众传媒 | 203,600 | 985,424.00 | 0.31 |
| 60 | 300406 | 九强生物 | 85,400 | 933,422.00 | 0.30 |
| 61 | 688795 | 摩尔线程 | 1,378 | 932,823.32 | 0.30 |
| 62 | 001286 | 陕西能源 | 87,300 | 885,222.00 | 0.28 |
| 63 | 002142 | 宁波银行 | 28,600 | 849,134.00 | 0.27 |
| 64 | 601665 | 齐鲁银行 | 133,900 | 772,603.00 | 0.25 |
| 65 | 688802 | 沐曦股份 | 999 | 768,121.11 | 0.24 |
| 66 | 000589 | 贵州轮胎 | 177,000 | 718,620.00 | 0.23 |
| 67 | 600329 | 达仁堂 | 18,300 | 681,126.00 | 0.22 |
| 68 | 688765 | 禾元生物 | 7,326 | 355,750.56 | 0.11 |
| 69 | 688759 | 必贝特 | 9,153 | 280,539.45 | 0.09 |
| 70 | 301666 | 大普微 | 540 | 250,198.20 | 0.08 |
| 71 | 001248 | 华润新能源 | 15,194 | 153,611.34 | 0.05 |
| 72 | 688808 | 联讯仪器 | 89 | 141,005.37 | 0.04 |
| 73 | 688781 | 视涯科技 | 3,327 | 140,266.32 | 0.04 |
| 74 | 688790 | 昂瑞微 | 1,101 | 139,221.45 | 0.04 |
| 75 | 688818 | 电科蓝天 | 1,098 | 77,013.72 | 0.02 |
| 76 | 688820 | 盛合晶微 | 516 | 73,008.84 | 0.02 |
| 77 | 688809 | 强一股份 | 112 | 69,776.00 | 0.02 |
| 78 | 688797 | 臻宝科技 | 125 | 58,583.75 | 0.02 |
| 79 | 300033 | 同花顺 | 240 | 57,840.00 | 0.02 |
| 80 | 301682 | 宏明电子 | 339 | 54,260.34 | 0.02 |
| 81 | 688712 | 北芯生命 | 1,500 | 53,880.00 | 0.02 |
| 82 | 001399 | 惠科股份 | 1,648 | 45,699.04 | 0.01 |
| 83 | 688785 | 恒运昌 | 93 | 43,072.95 | 0.01 |
| 84 | 300953 | 震裕科技 | 322 | 43,051.40 | 0.01 |
| 85 | 300394 | 天孚通信 | 140 | 42,375.20 | 0.01 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 86 | 688813 | 泰金新能 | 234 | 40,269.06 | 0.01 |
| 87 | 688635 | 长进光子 | 128 | 39,448.32 | 0.01 |
| 88 | 603893 | 瑞芯微 | 200 | 37,672.00 | 0.01 |
| 89 | 301031 | 中熔电气 | 299 | 35,715.55 | 0.01 |
| 90 | 002028 | 思源电气 | 200 | 34,600.00 | 0.01 |
| 91 | 001257 | 盛龙股份 | 1,485 | 30,798.90 | 0.01 |
| 92 | 603259 | 药明康德 | 200 | 24,902.00 | 0.01 |
| 93 | 301345 | 涛涛车业 | 100 | 23,100.00 | 0.01 |
| 94 | 002938 | 鹏鼎控股 | 200 | 21,076.00 | 0.01 |
| 95 | 688811 | 有研复材 | 834 | 20,124.42 | 0.01 |
| 96 | 603459 | 红板科技 | 231 | 19,477.92 | 0.01 |
| 97 | 301696 | 三瑞智能 | 216 | 18,748.80 | 0.01 |
| 98 | 000596 | 古井贡酒 | 233 | 18,593.40 | 0.01 |
| 99 | 301669 | 高特电子 | 546 | 15,506.40 | 0.00 |
| 100 | 301687 | 新广益 | 195 | 15,167.10 | 0.00 |
| 101 | 301531 | 春光集团 | 290 | 14,952.40 | 0.00 |
| 102 | 301599 | 理奇智能 | 433 | 14,059.51 | 0.00 |
| 103 | 000408 | 藏格矿业 | 200 | 13,864.00 | 0.00 |
| 104 | 301680 | 固德电材 | 117 | 13,122.72 | 0.00 |
| 105 | 001365 | 天海电子 | 376 | 11,772.56 | 0.00 |
| 106 | 601628 | 中国人寿 | 300 | 10,605.00 | 0.00 |
| 107 | 001393 | 维通利 | 265 | 10,332.35 | 0.00 |
| 108 | 603486 | 科沃斯 | 200 | 10,150.00 | 0.00 |
| 109 | 600660 | 福耀玻璃 | 200 | 10,088.00 | 0.00 |
| 110 | 301683 | 慧谷新材 | 80 | 9,741.60 | 0.00 |
| 111 | 001237 | 惠康科技 | 150 | 8,811.00 | 0.00 |
| 112 | 688816 | 易思维 | 152 | 8,679.20 | 0.00 |
| 113 | 600941 | 中国移动 | 100 | 8,613.00 | 0.00 |
| 114 | 603678 | 火炬电子 | 100 | 8,300.00 | 0.00 |
| 115 | 001369 | 双欣材料 | 611 | 8,260.72 | 0.00 |
| 116 | 605128 | 上海沿浦 | 298 | 7,223.52 | 0.00 |
| 117 | 300724 | 捷佳伟创 | 100 | 7,060.00 | 0.00 |
| 118 | 301513 | 尚水智能 | 138 | 7,032.48 | 0.00 |
| 119 | 300492 | 华图山鼎 | 200 | 6,870.00 | 0.00 |
| 120 | 603173 | 福斯达 | 200 | 6,780.00 | 0.00 |
| 121 | 600096 | 云天化 | 200 | 6,080.00 | 0.00 |
| 122 | 601112 | 振石股份 | 344 | 6,050.96 | 0.00 |
| 123 | 000792 | 盐湖股份 | 200 | 6,038.00 | 0.00 |
| 124 | 605060 | 联德股份 | 100 | 5,674.00 | 0.00 |
| 125 | 000915 | 华特达因 | 200 | 5,662.00 | 0.00 |
| 126 | 600729 | 重百集团 | 300 | 5,634.00 | 0.00 |
| 127 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 296 | 5,538.16 | 0.00 |
| 128 | 301195 | 北路智控 | 200 | 5,420.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 129 | 002518 | 科士达 | 100 | 5,359.00 | 0.00 |
| 130 | 300596 | 利安隆 | 100 | 5,248.00 | 0.00 |
| 131 | 600418 | 江淮汽车 | 200 | 5,166.00 | 0.00 |
| 132 | 002709 | 天赐材料 | 100 | 5,143.00 | 0.00 |
| 133 | 603435 | 嘉德利 | 104 | 4,857.84 | 0.00 |
| 134 | 603799 | 华友钴业 | 100 | 4,826.00 | 0.00 |
| 135 | 002202 | 金风科技 | 200 | 4,780.00 | 0.00 |
| 136 | 601318 | 中国平安 | 100 | 4,774.00 | 0.00 |
| 137 | 600141 | 兴发集团 | 100 | 4,697.00 | 0.00 |
| 138 | 300357 | 我武生物 | 200 | 4,664.00 | 0.00 |
| 139 | 603583 | 捷昌驱动 | 200 | 4,560.00 | 0.00 |
| 140 | 000028 | 国药一致 | 220 | 4,160.20 | 0.00 |
| 141 | 300450 | 先导智能 | 100 | 4,072.00 | 0.00 |
| 142 | 300677 | 英科医疗 | 100 | 3,917.00 | 0.00 |
| 143 | 603588 | 高能环境 | 200 | 3,840.00 | 0.00 |
| 144 | 002745 | 木林森 | 300 | 3,765.00 | 0.00 |
| 145 | 603237 | 五芳斋 | 300 | 3,714.00 | 0.00 |
| 146 | 601677 | 明泰铝业 | 200 | 3,320.00 | 0.00 |
| 147 | 600482 | 中国动力 | 100 | 3,280.00 | 0.00 |
| 148 | 300363 | 博腾股份 | 200 | 3,248.00 | 0.00 |
| 149 | 600888 | 新疆众和 | 200 | 3,178.00 | 0.00 |
| 150 | 600741 | 华域汽车 | 200 | 3,104.00 | 0.00 |
| 151 | 600415 | 小商品城 | 300 | 3,048.00 | 0.00 |
| 152 | 601963 | 重庆银行 | 300 | 3,024.00 | 0.00 |
| 153 | 003010 | 若羽臣 | 120 | 2,916.00 | 0.00 |
| 154 | 002690 | 美亚光电 | 200 | 2,866.00 | 0.00 |
| 155 | 603352 | 至信股份 | 112 | 2,858.24 | 0.00 |
| 156 | 300012 | 华测检测 | 200 | 2,772.00 | 0.00 |
| 157 | 605599 | 菜百股份 | 200 | 2,740.00 | 0.00 |
| 158 | 601369 | 陕鼓动力 | 300 | 2,715.00 | 0.00 |
| 159 | 300146 | 汤臣倍健 | 300 | 2,712.00 | 0.00 |
| 160 | 600066 | 宇通客车 | 100 | 2,681.00 | 0.00 |
| 161 | 300850 | 新强联 | 100 | 2,680.00 | 0.00 |
| 162 | 603166 | 福达股份 | 200 | 2,674.00 | 0.00 |
| 163 | 000725 | 京东方 A | 300 | 2,604.00 | 0.00 |
| 164 | 301270 | 汉仪股份 | 100 | 2,568.00 | 0.00 |
| 165 | 000823 | 超声电子 | 100 | 2,565.00 | 0.00 |
| 166 | 600637 | 东方明珠 | 300 | 2,493.00 | 0.00 |
| 167 | 001396 | 誉帆科技 | 69 | 2,443.98 | 0.00 |
| 168 | 600352 | 浙江龙盛 | 200 | 2,422.00 | 0.00 |
| 169 | 002048 | 宁波华翔 | 100 | 2,300.00 | 0.00 |
| 170 | 600449 | 宁夏建材 | 200 | 2,236.00 | 0.00 |
| 170 | 603816 | 顾家家居 | 100 | 2,236.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 171 | 600750 | 华润江中 | 100 | 2,207.00 | 0.00 |
| 172 | 603293 | 埃泰克 | 65 | 2,205.45 | 0.00 |
| 173 | 603556 | 海兴电力 | 100 | 2,200.00 | 0.00 |
| 174 | 001312 | 福恩股份 | 130 | 2,181.40 | 0.00 |
| 175 | 600742 | 富维股份 | 300 | 2,172.00 | 0.00 |
| 176 | 603035 | 常熟汽饰 | 200 | 2,124.00 | 0.00 |
| 177 | 000913 | 钱江摩托 | 200 | 2,050.00 | 0.00 |
| 178 | 603529 | 爱玛科技 | 100 | 1,951.00 | 0.00 |
| 179 | 002911 | 佛燃能源 | 200 | 1,898.00 | 0.00 |
| 180 | 603612 | 索通发展 | 100 | 1,813.00 | 0.00 |
| 181 | 300138 | 晨光生物 | 200 | 1,800.00 | 0.00 |
| 182 | 603993 | 洛阳钼业 | 100 | 1,755.00 | 0.00 |
| 183 | 600642 | 申能股份 | 200 | 1,746.00 | 0.00 |
| 184 | 600031 | 三一重工 | 100 | 1,728.00 | 0.00 |
| 185 | 601600 | 中国铝业 | 200 | 1,644.00 | 0.00 |
| 186 | 603284 | 林平发展 | 46 | 1,604.02 | 0.00 |
| 187 | 600420 | 国药现代 | 200 | 1,590.00 | 0.00 |
| 188 | 001220 | 世盟股份 | 57 | 1,583.46 | 0.00 |
| 189 | 600039 | 四川路桥 | 200 | 1,564.00 | 0.00 |
| 190 | 600801 | 华新建材 | 100 | 1,560.00 | 0.00 |
| 191 | 600011 | 华能国际 | 200 | 1,518.00 | 0.00 |
| 192 | 601567 | 三星电气 | 100 | 1,494.00 | 0.00 |
| 193 | 600873 | 梅花生物 | 200 | 1,470.00 | 0.00 |
| 194 | 603368 | 柳药集团 | 100 | 1,467.00 | 0.00 |
| 195 | 600388 | 龙净环保 | 100 | 1,455.00 | 0.00 |
| 196 | 002091 | 江苏国泰 | 200 | 1,446.00 | 0.00 |
| 197 | 000157 | 中联重科 | 200 | 1,394.00 | 0.00 |
| 198 | 601717 | 中创智领 | 100 | 1,391.00 | 0.00 |
| 199 | 600582 | 天地科技 | 300 | 1,335.00 | 0.00 |
| 200 | 603886 | 元祖股份 | 100 | 1,278.00 | 0.00 |
| 201 | 000708 | 中信特钢 | 100 | 1,262.00 | 0.00 |
| 202 | 603766 | 隆鑫通用 | 100 | 1,193.00 | 0.00 |
| 203 | 300360 | 炬华科技 | 100 | 1,175.00 | 0.00 |
| 204 | 601139 | 深圳燃气 | 200 | 1,132.00 | 0.00 |
| 205 | 002668 | TCL 智家 | 100 | 1,108.00 | 0.00 |
| 206 | 002170 | 芭田股份 | 100 | 1,086.00 | 0.00 |
| 207 | 002507 | 涪陵榨菜 | 100 | 1,080.00 | 0.00 |
| 208 | 002440 | 闰土股份 | 100 | 1,025.00 | 0.00 |
| 209 | 600483 | 福能股份 | 100 | 1,019.00 | 0.00 |
| 210 | 000729 | 燕京啤酒 | 100 | 1,013.00 | 0.00 |
| 211 | 601801 | 皖新传媒 | 200 | 986.00 | 0.00 |
| 212 | 600710 | 苏美达 | 100 | 956.00 | 0.00 |
| 213 | 000600 | 建投能源 | 100 | 875.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 214 | 000404 | 长虹华意 | 100 | 786.00 | 0.00 |
| 215 | 002839 | 张家港行 | 200 | 780.00 | 0.00 |
| 216 | 000543 | 皖能电力 | 100 | 757.00 | 0.00 |
| 217 | 600578 | 京能电力 | 100 | 645.00 | 0.00 |
| 218 | 601186 | 中国铁建 | 100 | 595.00 | 0.00 |
| 219 | 600098 | 广州发展 | 100 | 591.00 | 0.00 |
| 220 | 000100 | TCL 科技 | 100 | 582.00 | 0.00 |
| 221 | 600351 | 亚宝药业 | 100 | 575.00 | 0.00 |
| 222 | 600019 | 宝钢股份 | 100 | 543.00 | 0.00 |
| 223 | 600057 | 厦门象屿 | 100 | 542.00 | 0.00 |
| 224 | 601916 | 浙商银行 | 200 | 526.00 | 0.00 |
| 225 | 601728 | 中国电信 | 100 | 519.00 | 0.00 |
| 226 | 600150 | 中国船舶 | 13 | 439.27 | 0.00 |
| 227 | 600269 | 赣粤高速 | 100 | 398.00 | 0.00 |
| 228 | 600035 | 楚天高速 | 100 | 337.00 | 0.00 |
| 229 | 600033 | 福建高速 | 100 | 322.00 | 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 | 603950 | 长源东谷 | 10,338,183.00 | 2.88 |
| 2 | 300492 | 华图山鼎 | 10,326,833.92 | 2.88 |
| 3 | 605128 | 上海沿浦 | 10,273,703.42 | 2.87 |
| 4 | 300435 | 中泰股份 | 10,260,151.00 | 2.86 |
| 5 | 301358 | 湖南裕能 | 10,169,552.04 | 2.84 |
| 6 | 000729 | 燕京啤酒 | 10,163,971.00 | 2.84 |
| 7 | 301345 | 涛涛车业 | 10,159,984.00 | 2.83 |
| 8 | 000951 | 中国重汽 | 10,152,102.00 | 2.83 |
| 9 | 603583 | 捷昌驱动 | 10,107,316.00 | 2.82 |
| 10 | 002709 | 天赐材料 | 10,101,620.00 | 2.82 |
| 11 | 300138 | 晨光生物 | 10,062,294.00 | 2.81 |
| 12 | 300033 | 同花顺 | 10,036,995.00 | 2.80 |
| 13 | 300953 | 震裕科技 | 10,025,970.00 | 2.80 |
| 14 | 603799 | 华友钴业 | 9,994,966.60 | 2.79 |
| 15 | 688235 | 百济神州 | 9,994,317.76 | 2.79 |
| 16 | 000792 | 盐湖股份 | 9,989,333.00 | 2.79 |
| 17 | 000100 | TCL 科技 | 9,987,109.00 | 2.79 |
| 18 | 301031 | 中熔电气 | 9,978,762.08 | 2.78 |
| 19 | 300450 | 先导智能 | 9,935,245.68 | 2.77 |
| 20 | 688213 | 思特威 | 9,925,712.27 | 2.77 |
| 21 | 688326 | 经纬恒润 | 9,864,847.37 | 2.75 |
| 22 | 600418 | 江淮汽车 | 9,818,058.00 | 2.74 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 23 | 688981 | 中芯国际 | 9,816,548.59 | 2.74 |
| 24 | 603893 | 瑞芯微 | 9,752,695.00 | 2.72 |
| 25 | 000600 | 建投能源 | 9,663,905.00 | 2.70 |
| 26 | 002557 | 洽洽食品 | 9,626,520.28 | 2.69 |
| 27 | 688525 | 佰维存储 | 9,319,450.23 | 2.60 |
| 28 | 688368 | 晶丰明源 | 8,892,360.22 | 2.48 |
| 29 | 600176 | 中国巨石 | 8,624,391.00 | 2.41 |
| 30 | 603929 | 亚翔集成 | 8,600,063.00 | 2.40 |
| 31 | 300054 | 鼎龙股份 | 8,537,084.00 | 2.38 |
| 32 | 300867 | 圣元环保 | 8,516,388.00 | 2.38 |
| 33 | 600186 | 莲花控股 | 8,477,816.30 | 2.36 |
| 34 | 688388 | 嘉元科技 | 8,444,826.72 | 2.36 |
| 35 | 688111 | 金山办公 | 8,420,284.48 | 2.35 |
| 36 | 600499 | 科达制造 | 8,310,107.00 | 2.32 |
| 37 | 605117 | 德业股份 | 8,290,662.00 | 2.31 |
| 38 | 603558 | 健盛集团 | 8,288,336.00 | 2.31 |
| 39 | 605016 | 百龙创园 | 8,217,497.00 | 2.29 |
| 40 | 600872 | 中炬高新 | 8,215,956.00 | 2.29 |
| 41 | 300750 | 宁德时代 | 8,202,751.00 | 2.29 |
| 42 | 603127 | 昭衍新药 | 8,184,961.00 | 2.28 |
| 43 | 301371 | 敷尔佳 | 8,168,501.90 | 2.28 |
| 44 | 601579 | 会稽山 | 8,167,973.00 | 2.28 |
| 45 | 600546 | 山煤国际 | 8,155,140.00 | 2.27 |
| 46 | 300408 | 三环集团 | 8,131,743.20 | 2.27 |
| 47 | 600233 | 圆通速递 | 8,131,037.00 | 2.27 |
| 48 | 603345 | 安井食品 | 8,079,004.00 | 2.25 |
| 49 | 301219 | 腾远钴业 | 8,047,468.00 | 2.24 |
| 50 | 605189 | 富春染织 | 8,036,622.47 | 2.24 |
| 51 | 002033 | 丽江股份 | 8,004,378.77 | 2.23 |
| 52 | 600989 | 宝丰能源 | 7,832,570.00 | 2.18 |
| 53 | 603162 | 海通发展 | 7,641,292.29 | 2.13 |
| 54 | 002440 | 闰土股份 | 7,393,331.00 | 2.06 |

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 | 603950 | 长源东谷 | 17,657,056.60 | 4.93 |
| 2 | 600549 | 厦门钨业 | 15,889,001.52 | 4.43 |
| 3 | 688308 | 欧科亿 | 15,072,518.47 | 4.20 |
| 4 | 002709 | 天赐材料 | 14,027,643.00 | 3.91 |
| 5 | 301200 | 大族数控 | 13,757,614.00 | 3.84 |
| 6 | 300953 | 震裕科技 | 13,225,066.70 | 3.69 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 7 | 002028 | 思源电气 | 13,177,127.00 | 3.68 |
| 8 | 301345 | 涛涛车业 | 12,314,155.00 | 3.44 |
| 9 | 002258 | 利尔化学 | 11,828,690.00 | 3.30 |
| 10 | 000792 | 盐湖股份 | 11,688,530.00 | 3.26 |
| 11 | 603259 | 药明康德 | 11,168,699.00 | 3.12 |
| 12 | 000729 | 燕京啤酒 | 10,864,313.00 | 3.03 |
| 13 | 301031 | 中熔电气 | 10,830,153.00 | 3.02 |
| 14 | 000600 | 建投能源 | 10,811,078.72 | 3.02 |
| 15 | 002518 | 科士达 | 10,569,254.00 | 2.95 |
| 16 | 688525 | 佰维存储 | 10,543,291.32 | 2.94 |
| 17 | 603766 | 隆鑫通用 | 10,521,826.00 | 2.94 |
| 18 | 002008 | 大族激光 | 10,513,662.00 | 2.93 |
| 19 | 600262 | 北方股份 | 10,486,190.00 | 2.93 |
| 20 | 300012 | 华测检测 | 10,412,860.00 | 2.90 |
| 21 | 300596 | 利安隆 | 10,410,153.00 | 2.90 |
| 22 | 603699 | 纽威股份 | 10,286,528.00 | 2.87 |
| 23 | 601628 | 中国人寿 | 10,281,720.00 | 2.87 |
| 24 | 002967 | 广电计量 | 10,171,836.00 | 2.84 |
| 25 | 600801 | 华新建材 | 10,101,694.00 | 2.82 |
| 26 | 688981 | 中芯国际 | 9,914,933.43 | 2.77 |
| 27 | 600388 | 龙净环保 | 9,734,963.00 | 2.72 |
| 28 | 603893 | 瑞芯微 | 9,556,528.00 | 2.67 |
| 29 | 688213 | 思特威 | 9,468,793.06 | 2.64 |
| 30 | 600323 | 瀚蓝环境 | 9,449,615.00 | 2.64 |
| 31 | 300450 | 先导智能 | 9,405,151.00 | 2.62 |
| 32 | 301606 | 绿联科技 | 9,382,920.00 | 2.62 |
| 33 | 300033 | 同花顺 | 9,343,366.00 | 2.61 |
| 34 | 600578 | 京能电力 | 9,292,013.00 | 2.59 |
| 35 | 603799 | 华友钴业 | 9,139,401.00 | 2.55 |
| 36 | 600418 | 江淮汽车 | 9,085,656.00 | 2.53 |
| 37 | 000100 | TCL 科技 | 9,040,514.00 | 2.52 |
| 38 | 000543 | 皖能电力 | 9,035,758.00 | 2.52 |
| 39 | 002690 | 美亚光电 | 8,992,186.00 | 2.51 |
| 40 | 688046 | 药康生物 | 8,875,837.49 | 2.48 |
| 41 | 300138 | 晨光生物 | 8,732,736.18 | 2.44 |
| 42 | 605128 | 上海沿浦 | 8,666,286.00 | 2.42 |
| 43 | 688235 | 百济神州 | 8,416,714.69 | 2.35 |
| 44 | 002236 | 大华股份 | 8,387,436.00 | 2.34 |
| 45 | 300363 | 博腾股份 | 8,210,730.34 | 2.29 |
| 46 | 600415 | 小商品城 | 8,205,982.00 | 2.29 |
| 47 | 300435 | 中泰股份 | 8,037,001.00 | 2.24 |
| 48 | 603583 | 捷昌驱动 | 7,959,084.00 | 2.22 |
| 49 | 300850 | 新强联 | 7,651,083.23 | 2.13 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 50 | 300357 | 我武生物 | 7,573,430.06 | 2.11 |
| 51 | 688183 | 生益电子 | 7,476,562.28 | 2.09 |

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 | 589,201,306.54 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 672,610,945.79 |

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，莲花控股（600186）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度

的要求。

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

### 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 | 76,879.16 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 30,986.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 107,865.71 |

### 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（%） |
| 华泰柏瑞研究精选 A | 9,141 | 21,585.54 | 0.00 | 0.00 | 197,313,449.36 | 100.00 |
| 华泰柏瑞 | 40,625 | 133.51 | 0.00 | 0.00 | 5,424,013.91 | 100.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 研究精选 C | | | | | | |
| 合计 | 49,654 | 4,083.00 | 0.00 | 0.00 | 202,737,463.27 | 100.00 |

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 盈利投资者数量占比

| 项目 | 过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |
|---|---|
| 盈利投资者数量占比（%） | 99.89 |

## 8.3 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 | 华泰柏瑞研究精选 A | 281.30 | 0.0001 |
| | 华泰柏瑞研究精选 C | 2.37 | 0.0000 |
| | 合计 | 283.67 | 0.0001 |

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 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 | 华泰柏瑞研究精选 A | 0 |
| | 华泰柏瑞研究精选 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华泰柏瑞研究精选 A | 0 |
| | 华泰柏瑞研究精选 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2019 年 11 月 19 日）基金份额总额 | 2,641,505,156.52 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 253,330,291.77 | 6,229,844.72 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,183,523.00 | 586,050.79 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 58,200,365.41 | 1,391,881.60 |

| | | |
|---|---|---|
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 197,313,449.36 | 5,424,013.91 |

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

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 | 内容 |
|---|---|

| 罚等情况 1 | |
|---|---|
| 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：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到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(%) | |
| 国联民生证券 | 2 | 312,361,621.61 | 24.80 | 156,192.42 | 24.80 | - |
| 长江证券 | 2 | 292,715,498.25 | 23.24 | 146,365.13 | 23.24 | - |
| 中信证券 | 2 | 288,076,582.49 | 22.87 | 144,045.57 | 22.87 | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投 | 2 | 266,918,171.05 | 21.19 | 133,466.74 | 21.19 | - |
| 银河证券 | 2 | 52,235,020.42 | 4.15 | 26,118.56 | 4.15 | - |
| 国泰海通证券 | 3 | 18,306,715.70 | 1.45 | 9,153.92 | 1.45 | - |
| 广发证券 | 2 | 17,446,345.55 | 1.38 | 8,723.93 | 1.38 | - |
| 华泰证券 | 6 | 7,222,434.08 | 0.57 | 3,611.38 | 0.57 | - |
| 兴业证券 | 2 | 4,167,035.36 | 0.33 | 2,083.57 | 0.33 | - |
| 方正证券 | 4 | 272,683.15 | 0.02 | 136.38 | 0.02 | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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要；

(6)被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

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

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增兴业证券的交易单元。

## 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(%) |
| 国联民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 06 月 25 日 |
| 2 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 06 月 25 日 |
| 3 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 06 月 12 日 |
| 4 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 06 月 06 日 |
| 5 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 04 月 10 日 |
| 6 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 03 月 27 日 |
| 7 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 03 月 05 日 |
| 8 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 02 月 27 日 |
| 9 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 01 月 26 日 |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 01 月 10 日 |
| 11 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2026 年 01 月 09 日 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

## 12.3 查阅方式

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

**华泰柏瑞基金管理有限公司**

**2026 年 8 月 29 日**