

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49

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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
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
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
报告期末基金份额总额	73,999,645.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 12 月 12 日

2.2 基金产品说明

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 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。 本基金运用的量化投资模型主要包括： （1）多因子 alpha 模型——股票超额回报预测 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。 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。 （2）风险估测模型——有效控制预期风险 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。 （3）交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩 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。 (4) 投资组合的优化和调整 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。 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%, 年化跟踪误差不得超过 6.5%。 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。 2、存托凭证投资策略; 3、债券投资策略; 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; 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。
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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95559
传真	021-38601799	021-62701216
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	中国 (上海) 自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	中国 (上海) 长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200135	200336
法定代表人	贾波	任德奇

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公	北京市西城区太平桥大街 17 号

	司	
--	---	--

§ 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)
本期已实现收益	10,390,468.51
本期利润	14,502,843.65
加权平均基金份额本期利润	0.3427
本期加权平均净值利润率	21.97%
本期基金份额净值增长率	24.37%
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	42,376,282.49
期末可供分配基金份额利润	0.5727
期末基金资产净值	126,874,620.95
期末基金份额净值	1.7145
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	71.45%

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。

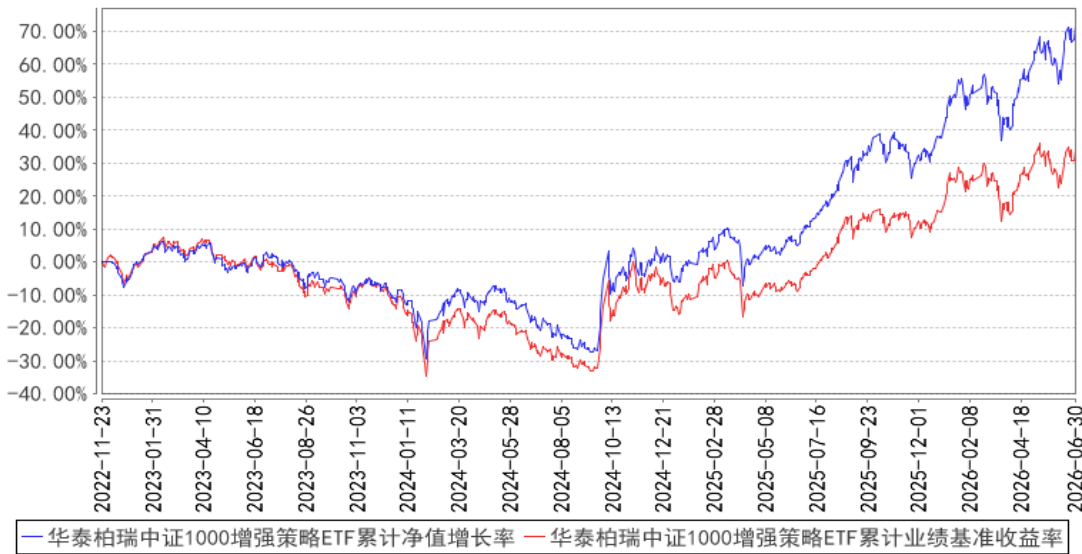
3.2 基金净值表现

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

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	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份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞中证1000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		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	2026 年 2 月 25 日	7 年	理学硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证

					180 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、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。
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 总 监 助 理、本基 金的基金	2022 年 11 月 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

	经理				化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	----	--	--	--	--

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

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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股一波三折，上证指数跨越 4200 点关口，主要指数均创出多年新高。年初以来的上涨行情受美伊冲突影响中断。二季度随着美伊战事边际缓和，对全球能源体系威胁边际下降，市场风险偏好逐渐好转。在随后的年报季，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。上半年末，市场以结构性分化行情为主。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。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 7.55%；代表中小市值公司的中证 500、中证 1000 同期涨幅分别为 20.97%、15.99%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数下跌 6.82%。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。

4.4.2 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 24.37%，业绩比较基准收益率为 15.99%。

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。我们认为今后一段时间，供应链安全或位于更加突出的位置，产业链的自主可控或也更加深入推进。消费转型升级等扩内需政策有望延续，人工智能及应用等产业方向的引导可能加强。海外，美国的对外政策给全球经济发展带来一定不确定性，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，各领域的投资可能靠前发力，有望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之后，未来股票市场的不确定性或在下降。随着半年度财报季临近，我们认为投资人可能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价值类因子近期表现较好，我们认为其趋势仍有望延续。质量和量价类因子表现相对稳健，后续表现可期。同时，我们认为在后市当中，大小市值、各行业股票或均有机会，量化投资全市场选股的优势有望得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，或是很不错的配置风格均衡的多因子量化基金的机会。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。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

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金自 2025-2-17 至 2026-3-3 存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

已于 2025 年 5 月 19 日将《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于五千万元情况的报告》上报上海证监局。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华泰柏瑞基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,931,671.74	1,546,854.57
结算备付金		2,076,010.34	1,252,775.67
存出保证金		426,396.03	367,408.64
交易性金融资产	6.4.7.2	122,545,599.49	36,860,537.57
其中：股票投资		122,447,897.35	36,860,537.57
基金投资		—	—
债券投资		97,702.14	—
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		—	—

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		126,979,677.60	40,027,576.45
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	0.12
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		65,141.38	23,670.62
应付托管费		9,305.91	3,381.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,579.47	782.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	22,029.89	24,937.38
负债合计		105,056.65	52,772.54
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	73,999,645.00	28,999,645.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	52,874,975.95	10,975,158.91
净资产合计		126,874,620.95	39,974,803.91
负债和净资产总计		126,979,677.60	40,027,576.45

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7145 元，基金份额总额 73,999,645.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,763,515.35	5,106,561.90
1. 利息收入		9,789.79	8,886.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,789.79	8,886.62
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）		10,395,543.80	7,172,313.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,994,665.30	6,618,254.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2.09	30,721.17
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	686,681.54	172,042.13
股利收益	6.4.7.19	714,194.87	351,295.32
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	4,112,375.14	-2,237,538.62
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	245,806.62	162,900.49
减：二、营业总支出		260,671.70	301,176.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	224,805.73	135,865.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,115.12	19,409.40
3. 销售服务费		-	-
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		2,473.18	846.83
8. 其他费用	6.4.7.23	1,277.67	145,054.92
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		14,502,843.65	4,805,385.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		14,502,843.65	4,805,385.03
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		14,502,843.65	4,805,385.03

6.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,999,645.00	-	10,975,158.91	39,974,803.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	28,999,645.00	-	10,975,158.91	39,974,803.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	45,000,000.00	-	41,899,817.04	86,899,817.04
（一）、综合收益总额	-	-	14,502,843.65	14,502,843.65
（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）	45,000,000.00	-	27,396,973.39	72,396,973.39
其中：1. 基金申购款	65,000,000.00	-	38,096,012.68	103,096,012.68
2. 基金赎回款	-20,000,000.00	-	-10,699,039.29	-30,699,039.29
（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	73,999,645.00	-	52,874,975.95	126,874,620.95
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	56,499,645.00	-	-600,969.11	55,898,675.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	56,499,645.00	-	-600,969.11	55,898,675.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-27,500,000.00	-	3,744,836.07	-23,755,163.93
（一）、综合收益总额	-	-	4,805,385.03	4,805,385.03
（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）	-27,500,000.00	-	-1,060,548.96	-28,560,548.96
其中：1. 基金申购款	47,500,000.00	-	260,312.61	47,760,312.61
2. 基金赎回款	-75,000,000.00	-	-1,320,861.57	-76,320,861.57
（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	28,999,645.00	-	3,143,866.96	32,143,511.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

崔春

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(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[2022]2600 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 298,999,645.00 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(2022)第 0961 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 11 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 298,999,645.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]333 号核准,本基金 298,999,645.00 份基金份额于 2022 年 12 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、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、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)的比例不得低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会

计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税交易,资管产品管理人为纳税人。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,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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税交易,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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、债券取得的收入免征增值税。

资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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。

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

(3)对基金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。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,931,671.74

等于：本金	1,931,635.63
加：应计利息	36.11
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	1,931,671.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		114,979,703.78	-	122,447,897.35	7,468,193.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	97,700.00	2.14	97,702.14	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	97,700.00	2.14	97,702.14	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		115,077,403.78	2.14	122,545,599.49	7,468,193.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生	3,317,800.00	-	-	

工具				
其中： 股指期货 投资	3,317,800.00	—	—	
其他衍生 工具	—	—	—	
合计	3,317,800.00	—	—	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2609	中证1000股指期货 2609	2.00	3,394,000.00	76,200.00
合计				76,200.00
减：可抵销期货 暂收款				76,200.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

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投资。

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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	22,029.89
其中：交易所市场	22,029.89
银行间市场	—
应付利息	—
合计	22,029.89

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,999,645.00	28,999,645.00
本期申购	65,000,000.00	65,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-20,000,000.00	-20,000,000.00
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	73,999,645.00	73,999,645.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,130,057.21	845,101.70	10,975,158.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,130,057.21	845,101.70	10,975,158.91
本期利润	10,390,468.51	4,112,375.14	14,502,843.65
本期基金份额交易产生的变动数	21,855,756.77	5,541,216.62	27,396,973.39
其中：基金申购款	30,870,906.54	7,225,106.14	38,096,012.68
基金赎回款	-9,015,149.77	-1,683,889.52	-10,699,039.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,376,282.49	10,498,693.46	52,874,975.95

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	586.78
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	9,183.46
其他	19.55
合计	9,789.79

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	7,787,497.84
股票投资收益——赎回差价收入	1,207,167.46
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	8,994,665.30
----	--------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	54,886,561.47
减：卖出股票成本总额	47,030,230.24
减：交易费用	68,833.39
买卖股票差价收入	7,787,497.84

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	30,699,039.29
减：现金支付赎回款总额	16,962,140.29
减：赎回股票成本总额	12,529,731.54
减：交易费用	—
赎回差价收入	1,207,167.46

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	2.09

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	686,681.54

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	714,194.87
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	714,194.87

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,211,015.14
股票投资	4,211,015.14
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	-98,640.00
权证投资	—
期货投资	-98,640.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	4,112,375.14

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	245,806.62
合计	245,806.62

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,269.47
存托服务费	8.20
合计	1,277.67

注：本报告期内，本基金的信息披露费、审计费等费用由本基金的基金管理人承担。

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、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
华泰证券	69,781,706.28	44.53	55,908,830.67	52.46

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	13,957.14	44.53	9,595.31	43.56
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	11,183.23	52.45	3,399.22	45.65

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	224,805.73	135,865.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,806.27	3,478.25
应支付基金管理人的净管理费	210,999.46	132,387.47

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	32,115.12	19,409.40

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
华泰证券股份 有限公司	565,338.00	0.7640	565,338.00	1.9495

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,931,671.74	586.78	1,277,826.56	748.09

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127114	宜化转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	977	97,700.00	97,702.14	-

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

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现超越标的指数的投资收益，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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

围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.08% (2025 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要

求。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,931,671.74	-	-	-	-	-	-1,931,671.74
结算备付金	2,076,010.34	-	-	-	-	-	-2,076,010.34
存出保证金	19,116.03	-	-	-	-	407,280.00	426,396.03
交易性金融资产	-	-	-	-	97,702.14	122,447,897.35	122,545,599.49
资产总计	4,026,798.11	-	-	-	97,702.14	122,855,177.35	126,979,677.60
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	65,141.38	65,141.38

应付托管费	-	-	-	-	-	9,305.91	9,305.91
应交税费	-	-	-	-	-	8,579.47	8,579.47
其他负债	-	-	-	-	-	22,029.89	22,029.89
负债总计	-	-	-	-	-	105,056.65	105,056.65
利率敏感度缺口	4,026,798.11	-	-	-	97,702.14	122,750,120.70	126,874,620.95
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	1,546,854.57	-	-	-	-	-	1,546,854.57
结算备付金	1,252,775.67	-	-	-	-	-	1,252,775.67
存出保证金	10,336.64	-	-	-	-	357,072.00	367,408.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	36,860,537.57	36,860,537.57
资产总计	2,809,966.88	-	-	-	-	37,217,609.57	40,027,576.45
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,670.62	23,670.62
应付托管费	-	-	-	-	-	3,381.51	3,381.51
应付清算款	-	-	-	-	-	0.12	0.12
应交税费	-	-	-	-	-	782.91	782.91
其他负债	-	-	-	-	-	24,937.38	24,937.38
负债总计	-	-	-	-	-	52,772.54	52,772.54
利率敏感度缺口	2,809,966.88	-	-	-	-	37,164,837.03	39,974,803.91

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.08%(2025 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	122,447,897.35	96.51	36,860,537.57	92.21
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	122,447,897.35	96.51	36,860,537.57	92.21

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	6,279,491.18	1,920,669.90
	业绩比较基准下降 5%	-6,279,491.18	-1,920,669.90

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	122,447,897.35	36,732,565.57
第二层次	97,702.14	127,972.00
第三层次	—	—
合计	122,545,599.49	36,860,537.57

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

（1）基金申购款

于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为

103,096,012.68 元(2025 年度:76,113,937.98 元),其中包括以股票支付的申购款 39,109,966.02 元和以现金支付的申购款 63,986,046.66 元(2025 年度:其中包括以股票支付的申购款 37,304,151.87 元和以现金支付的申购款 38,809,786.11 元)。

(2) 除基金申购款外,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	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	其他各项资产	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	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。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	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
11	603678	火炬电子	14,100	1,170,300.00	0.92
12	688110	东芯股份	5,660	1,152,942.00	0.91
13	688059	华锐精密	5,660	1,130,358.60	0.89
14	688686	奥普特	6,525	1,098,744.75	0.87
15	688390	固德威	10,000	1,085,100.00	0.86

16	300602	飞荣达	20,700	1,059,840.00	0.84
17	600961	株冶集团	31,900	1,033,241.00	0.81
18	688127	蓝特光学	10,400	1,015,040.00	0.80
19	688001	华兴源创	11,800	1,011,260.00	0.80
20	688388	嘉元科技	22,700	998,800.00	0.79
21	601126	四方股份	15,300	966,960.00	0.76
22	300475	香农芯创	3,200	960,000.00	0.76
23	603588	高能环境	49,800	956,160.00	0.75
24	300548	长芯博创	3,400	945,200.00	0.74
25	300726	宏达电子	11,100	938,727.00	0.74
26	301396	宏景科技	2,800	928,480.00	0.73
27	688147	微导纳米	5,660	916,240.80	0.72
28	688717	艾罗能源	10,855	896,297.35	0.71
29	603699	纽威股份	17,800	895,340.00	0.71
30	001339	智微智能	8,710	890,858.80	0.70
31	603663	三祥新材	8,900	857,070.00	0.68
32	003010	若羽臣	34,800	845,640.00	0.67
33	605020	永和股份	20,600	838,832.00	0.66
34	301219	腾远钴业	15,270	836,796.00	0.66
35	002345	潮宏基	90,700	831,719.00	0.66
36	300357	我武生物	35,200	820,864.00	0.65
37	002222	福晶科技	8,600	793,608.00	0.63
38	605376	博迁新材	2,900	786,770.00	0.62
39	688800	瑞可达	8,120	779,276.40	0.61
40	600552	凯盛科技	23,900	778,662.00	0.61
41	688503	聚和材料	5,660	751,082.00	0.59
42	688088	虹软科技	20,903	743,101.65	0.59
43	002545	东方铁塔	44,100	715,302.00	0.56
44	002468	申通快递	49,100	714,896.00	0.56
45	002497	雅化集团	34,900	710,913.00	0.56
46	688097	博众精工	11,087	699,035.35	0.55
47	000059	华锦股份	183,300	687,375.00	0.54
48	688153	唯捷创芯	21,300	684,156.00	0.54
49	688049	炬芯科技	14,580	683,947.80	0.54
50	300236	上海新阳	5,200	683,800.00	0.54
51	300953	震裕科技	5,100	681,870.00	0.54
52	301217	铜冠铜箔	4,100	676,787.00	0.53
53	603093	南华期货	37,000	671,550.00	0.53
54	000603	盛达资源	28,900	667,590.00	0.53
55	603083	剑桥科技	2,600	662,662.00	0.52
56	002993	奥海科技	9,200	658,812.00	0.52
57	600353	旭光电子	14,400	656,640.00	0.52
58	002258	利尔化学	51,400	653,294.00	0.51

59	300223	北京君正	2,600	647,140.00	0.51
60	002948	青岛银行	126,800	644,144.00	0.51
61	603005	晶方科技	11,800	635,666.00	0.50
62	601677	明泰铝业	38,000	630,800.00	0.50
63	601208	东材科技	8,900	630,031.00	0.50
64	002484	江海股份	5,900	619,500.00	0.49
65	300772	运达股份	50,300	618,690.00	0.49
66	000935	四川双马	23,400	610,506.00	0.48
67	002838	道恩股份	19,900	609,338.00	0.48
68	000600	建投能源	68,400	598,500.00	0.47
69	300244	迪安诊断	31,300	586,562.00	0.46
70	301087	可孚医疗	12,300	586,095.00	0.46
71	600186	莲花控股	41,800	585,200.00	0.46
72	002925	盈趣科技	23,500	579,510.00	0.46
73	600971	恒源煤电	80,700	556,830.00	0.44
74	688321	微芯生物	21,052	554,299.16	0.44
75	603992	松霖科技	17,100	554,040.00	0.44
76	688131	皓元医药	5,751	544,044.60	0.43
77	600761	安徽合力	32,800	536,608.00	0.42
78	603638	艾迪精密	22,700	532,315.00	0.42
79	688208	道通科技	20,920	526,974.80	0.42
80	688700	东威科技	5,871	524,867.40	0.41
81	300861	美畅股份	20,800	523,952.00	0.41
82	301631	壹连科技	7,260	521,703.60	0.41
83	301371	敷尔佳	19,900	517,400.00	0.41
84	603317	天味食品	39,700	516,497.00	0.41
85	300224	正海磁材	38,700	515,871.00	0.41
86	300443	金雷股份	23,900	515,762.00	0.41
87	300573	兴齐眼药	12,410	505,831.60	0.40
88	600686	金龙汽车	43,800	494,502.00	0.39
89	300655	晶瑞电材	23,085	494,480.70	0.39
90	002668	TCL 智家	44,400	491,952.00	0.39
91	301381	赛维时代	26,400	486,816.00	0.38
92	300037	新宙邦	5,200	482,820.00	0.38
93	300409	道氏技术	24,200	482,306.00	0.38
94	600388	龙净环保	32,800	477,240.00	0.38
95	600266	城建发展	121,400	474,674.00	0.37
96	002237	恒邦股份	32,100	471,549.00	0.37
97	688182	灿勤科技	10,900	469,463.00	0.37
98	002518	科士达	8,600	460,874.00	0.36
99	301489	思泉新材	2,800	460,824.00	0.36
100	000422	湖北宜化	32,200	452,410.00	0.36
101	002946	新乳业	32,000	450,560.00	0.36

102	688433	华曙高科	5,200	445,120.00	0.35
103	688559	海目星	5,200	436,384.00	0.34
104	603127	昭衍新药	11,400	435,708.00	0.34
105	002488	金固股份	48,400	431,244.00	0.34
106	300693	盛弘股份	8,700	424,125.00	0.33
107	688380	中微半导	6,400	421,824.00	0.33
108	000555	神州信息	40,400	416,120.00	0.33
109	688543	国科军工	10,540	415,803.00	0.33
110	000690	宝新能源	88,200	414,540.00	0.33
111	002215	诺普信	49,300	405,739.00	0.32
112	605599	菜百股份	29,600	405,520.00	0.32
113	000581	威孚高科	23,700	403,374.00	0.32
114	002284	亚太股份	42,400	402,376.00	0.32
115	301606	绿联科技	6,500	396,630.00	0.31
116	600285	羚锐制药	20,400	395,352.00	0.31
117	300811	铂科新材	4,140	392,844.60	0.31
118	688400	凌云光	5,900	390,580.00	0.31
119	600428	中远海特	50,000	390,500.00	0.31
120	600502	安徽建工	89,600	389,760.00	0.31
121	688337	普源精电	5,200	389,636.00	0.31
122	300634	彩讯股份	19,800	387,486.00	0.31
123	300363	博腾股份	23,700	384,888.00	0.30
124	688556	高测股份	28,900	383,792.00	0.30
125	600391	航发科技	11,400	381,330.00	0.30
126	301607	富特科技	7,260	379,335.00	0.30
127	000719	中原传媒	32,300	369,189.00	0.29
128	600882	妙可蓝多	22,900	366,171.00	0.29
129	600210	紫江企业	58,900	365,180.00	0.29
130	688095	福昕软件	6,062	360,264.66	0.28
131	002755	奥赛康	25,800	351,396.00	0.28
132	601083	锦江航运	35,300	350,882.00	0.28
133	301316	慧博云通	8,900	350,482.00	0.28
134	300770	新媒股份	11,100	349,539.00	0.28
135	001914	招商积余	42,500	346,800.00	0.27
136	000811	冰轮环境	6,100	342,942.00	0.27
137	603171	税友股份	8,500	338,725.00	0.27
138	301536	星辰科技	2,600	334,646.00	0.26
139	600064	南京高科	46,900	334,397.00	0.26
140	300049	福瑞医科	8,600	334,368.00	0.26
141	688522	纳睿雷达	16,518	330,690.36	0.26
142	002315	焦点科技	14,140	329,179.20	0.26
143	002895	川恒股份	11,119	324,674.80	0.26
144	002517	恺英网络	19,900	323,375.00	0.25

145	600057	厦门象屿	58,300	315,986.00	0.25
146	600750	华润江中	14,200	313,394.00	0.25
147	600201	生物股份	26,900	313,385.00	0.25
148	300850	新强联	11,500	308,200.00	0.24
149	601069	西部黄金	14,000	308,000.00	0.24
150	600867	通化东宝	38,300	307,932.00	0.24
151	601020	华钰矿业	12,800	307,072.00	0.24
152	002906	华阳集团	12,159	303,488.64	0.24
153	688698	伟创电气	5,734	300,748.30	0.24
154	600728	佳都科技	70,400	299,904.00	0.24
155	603505	金石资源	14,800	298,220.00	0.24
156	688063	派能科技	5,500	292,985.00	0.23
156	688580	伟思医疗	5,500	292,985.00	0.23
157	301080	百普赛斯	6,100	292,800.00	0.23
158	601900	南方传媒	26,700	289,962.00	0.23
159	688690	纳微科技	6,363	280,608.30	0.22
160	300841	康华生物	5,900	280,604.00	0.22
161	002511	中顺洁柔	41,700	277,305.00	0.22
162	301061	匠心家居	7,860	275,650.20	0.22
163	001301	尚太科技	2,900	271,179.00	0.21
164	002534	西子洁能	14,400	267,120.00	0.21
165	000680	山推股份	26,500	266,325.00	0.21
166	300170	汉得信息	17,300	263,652.00	0.21
167	002216	三全食品	22,700	261,731.00	0.21
168	603236	移远通信	5,040	257,896.80	0.20
169	603612	索通发展	14,189	257,246.57	0.20
170	300662	科锐国际	15,100	256,398.00	0.20
171	002558	巨人网络	9,200	253,552.00	0.20
172	300098	高新兴	55,100	252,909.00	0.20
173	300820	英杰电气	2,800	252,644.00	0.20
174	301110	青木科技	6,620	250,633.20	0.20
175	301548	崇德科技	2,800	248,556.00	0.20
176	000729	燕京啤酒	24,000	243,120.00	0.19
177	300416	苏试试验	11,900	242,522.00	0.19
178	600323	瀚蓝环境	8,600	236,156.00	0.19
179	600507	方大特钢	58,200	235,710.00	0.19
180	001337	四川黄金	6,400	234,624.00	0.18
181	600389	江山股份	12,000	234,240.00	0.18
182	301580	爱迪特	3,620	232,874.60	0.18
183	002100	天康生物	36,700	231,577.00	0.18
184	301263	泰恩康	11,300	231,537.00	0.18
185	300607	拓斯达	5,600	230,888.00	0.18
186	002043	兔宝宝	20,200	223,816.00	0.18

187	000923	河钢资源	18,000	223,380.00	0.18
188	002961	瑞达期货	11,400	223,212.00	0.18
189	301225	恒勃股份	2,800	220,612.00	0.17
190	002690	美亚光电	15,300	219,249.00	0.17
191	603305	旭升集团	17,900	216,948.00	0.17
192	600546	山煤国际	19,800	216,414.00	0.17
193	601975	招商南油	57,800	215,594.00	0.17
194	300633	开立医疗	11,700	215,163.00	0.17
195	000917	电广传媒	32,100	214,749.00	0.17
196	603713	密尔克卫	3,000	213,510.00	0.17
197	002006	精工科技	14,300	210,353.00	0.17
198	601963	重庆银行	20,600	207,648.00	0.16
199	002233	塔牌集团	29,600	206,312.00	0.16
200	300492	华图山鼎	6,000	206,100.00	0.16
201	000902	新洋丰	17,700	204,612.00	0.16
202	002063	远光软件	39,600	201,960.00	0.16
203	300348	长亮科技	22,900	201,520.00	0.16
204	300685	艾德生物	11,800	198,712.00	0.16
205	002048	宁波华翔	8,400	193,200.00	0.15
206	002777	久远银海	16,000	192,480.00	0.15
207	603162	海通发展	21,432	192,245.04	0.15
208	301035	润丰股份	4,110	190,704.00	0.15
209	603057	紫燕食品	8,500	189,550.00	0.15
210	603319	美湖股份	5,700	189,297.00	0.15
211	300595	欧普康视	17,700	186,381.00	0.15
212	001316	润贝航科	5,600	184,688.00	0.15
213	002061	浙江交科	55,600	183,480.00	0.14
214	600596	新安股份	11,400	181,944.00	0.14
215	300415	伊之密	8,700	173,217.00	0.14
216	300398	飞凯材料	2,800	172,900.00	0.14
217	301029	怡合达	6,400	172,864.00	0.14
218	603383	顶点软件	6,300	167,328.00	0.13
219	688772	珠海冠宇	8,069	158,394.47	0.12
220	300428	立中集团	8,600	156,348.00	0.12
221	000498	山东路桥	33,000	156,090.00	0.12
222	002364	中恒电气	2,900	156,020.00	0.12
223	002250	联化科技	11,400	155,838.00	0.12
224	000012	南玻 A	29,600	152,736.00	0.12
225	300624	万兴科技	2,900	150,423.00	0.12
226	603009	北特科技	3,100	148,707.00	0.12
227	600480	凌云股份	17,600	146,256.00	0.12
228	002985	北摩高科	5,200	144,040.00	0.11
229	002544	普天科技	7,900	143,938.00	0.11

230	000778	新兴铸管	37,500	139,125.00	0.11
231	300761	立华股份	8,400	137,844.00	0.11
232	603599	广信股份	14,300	136,994.00	0.11
233	600458	时代新材	8,200	135,710.00	0.11
234	603583	捷昌驱动	5,900	134,520.00	0.11
235	002539	云图控股	11,700	132,444.00	0.10
236	000685	中山公用	11,800	131,688.00	0.10
237	000915	华特达因	4,600	130,226.00	0.10
238	002807	江阴银行	34,760	128,959.60	0.10
239	600718	东软集团	17,100	123,804.00	0.10
240	601101	昊华能源	11,600	122,496.00	0.10
241	600496	精工钢构	38,200	118,420.00	0.09
242	300682	朗新科技	11,900	117,810.00	0.09
243	600361	创新新材	32,500	117,000.00	0.09
244	603871	嘉友国际	11,300	115,373.00	0.09
245	002701	奥瑞金	26,700	113,742.00	0.09
246	002911	佛燃能源	11,900	112,931.00	0.09
247	600740	山西焦化	34,900	111,331.00	0.09
248	002541	鸿路钢构	6,400	110,848.00	0.09
249	600211	西藏药业	2,900	108,431.00	0.09
250	600114	东睦股份	2,800	105,728.00	0.08
251	600012	皖通高速	6,200	97,712.00	0.08
252	603619	中曼石油	5,200	97,292.00	0.08
253	300113	顺网科技	5,200	94,692.00	0.07
254	300674	宇信科技	6,200	93,310.00	0.07
255	600258	首旅酒店	8,500	92,820.00	0.07
256	600633	浙数文化	8,800	89,584.00	0.07
257	600827	百联股份	12,000	88,920.00	0.07
258	600782	新钢股份	32,800	81,344.00	0.06
259	600125	铁龙物流	14,700	74,529.00	0.06
260	300322	硕贝德	2,800	70,560.00	0.06
261	300435	中泰股份	2,600	70,382.00	0.06
262	600508	上海能源	9,160	67,509.20	0.05
263	002170	芭田股份	6,100	66,246.00	0.05
264	603218	日月股份	6,400	65,408.00	0.05
265	603313	梦百合	11,000	65,120.00	0.05
266	600993	马应龙	3,000	64,860.00	0.05
267	301216	万凯新材	2,800	64,372.00	0.05
268	300738	奥飞数据	3,000	60,660.00	0.05
269	601801	皖新传媒	11,900	58,667.00	0.05
270	002011	盾安环境	5,500	58,355.00	0.05
271	603533	掌阅科技	2,800	56,812.00	0.04
272	002246	北化股份	2,800	52,640.00	0.04

273	603300	海南华铁	11,300	51,415.00	0.04
274	300867	圣元环保	2,600	47,112.00	0.04
275	603100	川仪股份	2,600	46,930.00	0.04
276	300284	苏交科	8,600	43,000.00	0.03
277	601595	上海电影	2,500	41,500.00	0.03
278	300181	佐力药业	2,900	40,890.00	0.03
279	600063	皖维高新	5,200	39,520.00	0.03
280	003006	百亚股份	2,600	37,726.00	0.03
281	300703	创源股份	2,700	34,479.00	0.03
282	002839	张家港行	8,000	31,200.00	0.02
283	300036	超图软件	2,700	30,429.00	0.02
284	601311	骆驼股份	3,600	28,044.00	0.02
285	600590	泰豪科技	2,600	26,260.00	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300438	鹏辉能源	1,781,162.00	4.46
2	301031	中熔电气	1,709,304.12	4.28
3	001309	德明利	1,694,941.00	4.24
4	301377	鼎泰高科	1,452,489.00	3.63
5	300548	长芯博创	1,219,637.00	3.05
6	300475	香农芯创	1,210,919.02	3.03
7	002345	潮宏基	1,192,004.00	2.98
8	301095	广立微	1,172,941.00	2.93
9	688388	嘉元科技	1,103,080.00	2.76
10	688059	华锐精密	1,097,570.22	2.75
11	688409	富创精密	1,069,475.40	2.68
12	300772	运达股份	1,057,232.00	2.64
13	000603	盛达资源	1,016,750.00	2.54
14	301219	腾远钴业	1,004,880.00	2.51
15	300990	同飞股份	980,948.00	2.45
16	002545	东方铁塔	961,741.00	2.41
17	003010	若羽臣	953,743.00	2.39
18	300357	我武生物	947,428.36	2.37
19	000600	建投能源	918,924.00	2.30
20	002222	福晶科技	900,225.00	2.25
21	002497	雅化集团	886,581.00	2.22

22	688630	芯碁微装	854,114.43	2.14
23	688717	艾罗能源	853,539.22	2.14
24	300602	飞荣达	820,282.00	2.05
25	000589	贵州轮胎	813,223.00	2.03

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	301377	鼎泰高科	3,464,958.00	8.67
2	001309	德明利	2,117,734.00	5.30
3	300620	光库科技	1,218,846.00	3.05
4	002487	大金重工	1,054,540.00	2.64
5	688515	裕太微	1,019,415.91	2.55
6	300666	江丰电子	952,561.00	2.38
7	688048	长光华芯	931,035.79	2.33
8	301217	铜冠铜箔	927,326.28	2.32
9	300548	长芯博创	926,263.00	2.32
10	688308	欧科亿	880,610.04	2.20
11	000589	贵州轮胎	825,091.00	2.06
12	300604	长川科技	824,982.00	2.06
13	688141	杰华特	824,278.31	2.06
14	688326	经纬恒润	722,499.02	1.81
15	300570	太辰光	722,089.00	1.81
16	300475	香农芯创	682,394.00	1.71
17	603267	鸿远电子	665,491.00	1.66
18	688200	华峰测控	656,824.19	1.64
19	002051	中工国际	645,069.00	1.61
20	603766	隆鑫通用	632,645.00	1.58

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	101,826,340.40
卖出股票收入（成交）总额	54,886,561.47

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	426,396.03
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	426,396.03

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金未持有积极投资的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

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 (%)
1,135	65,197.93	17,285,845.00	23.36	56,713,800.00	76.64

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	100.00	0.0001

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 11 月 23 日） 基金份额总额	298,999,645.00
本报告期期初基金份额总额	28,999,645.00
本报告期基金总申购份额	65,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	20,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	73,999,645.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
华泰证券	2	69,781,706.28	44.53	13,957.14	44.53	-
银河证券	2	43,507,643.86	27.76	8,702.26	27.76	-
中信证券	2	43,422,567.67	27.71	8,684.67	27.71	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	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
- (6) 被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

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

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 06 日

	办理旗下基金相关业务公告		
5	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
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金变更基金简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 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 03 月 05 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 02 月 27 日
10	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
11	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
12	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
个人	1	20260527-20260610;20260615-20260630;	0.00	34,809,000.00	11,000,000.00	23,809,000.00	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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：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