

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券
投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 30 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。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 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	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	51

8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
8.6 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	78
8.7 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	78
8.8 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	78
8.9 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	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12 投资组合报告附注	78
§ 9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末上市基金前十名持有人	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
9.4 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	80
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	80
§ 10 开放式基金份额变动	80
§ 11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
11.2 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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8 其他重大事件	83
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 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	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§ 13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 1000ETF
场内简称	中证 1000 (扩位证券简称: 中证 1000ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	516300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,012,592.00 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	2021 年 3 月 24 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	1、股票的投资策略；2、存托凭证的投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货的投资策略；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
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中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，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：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	韩鑫普
	联系电话	021-38601777	0755-82943666
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95565
传真		021-38601799	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

邮政编码	200135	518000
法定代表人	贾波	霍达

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	20,900,950.79	11,846,318.33	-2,028,509.73
本期利润	24,161,468.14	24,875,905.37	-407,450.95
加权平均基金份额本期利润	0.6511	0.1732	-0.0030
本期加权平均净值利润率	24.66%	17.12%	-0.29%
本期基金份额净值增长率	30.41%	4.93%	-3.41%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	16,211,873.82	2,815,138.00	-4,535,440.78
期末可供分配基金份额利润	0.7715	0.0386	-0.0315
期末基金资产净值	66,042,411.44	175,961,635.75	139,566,741.22
期末基金份额净值	3.1430	2.4100	0.9685

3.1.3 累计 期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累 计净值增长 率	32.53%	1.62%	-3.15%

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。

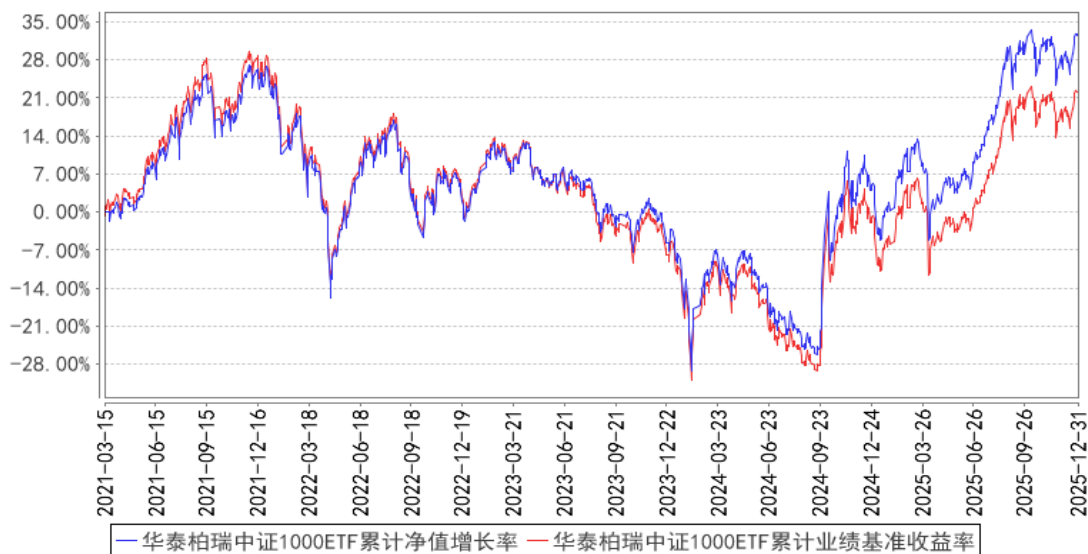
3.2 基金净值表现

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	0.29%	1.13%	0.27%	1.13%	0.02%	0.00%
过去六个月	19.85%	1.11%	19.49%	1.11%	0.36%	0.00%
过去一年	30.41%	1.37%	27.49%	1.39%	2.92%	-0.02%
过去三年	32.18%	1.54%	20.91%	1.56%	11.27%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	32.53%	1.48%	22.10%	1.50%	10.43%	-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

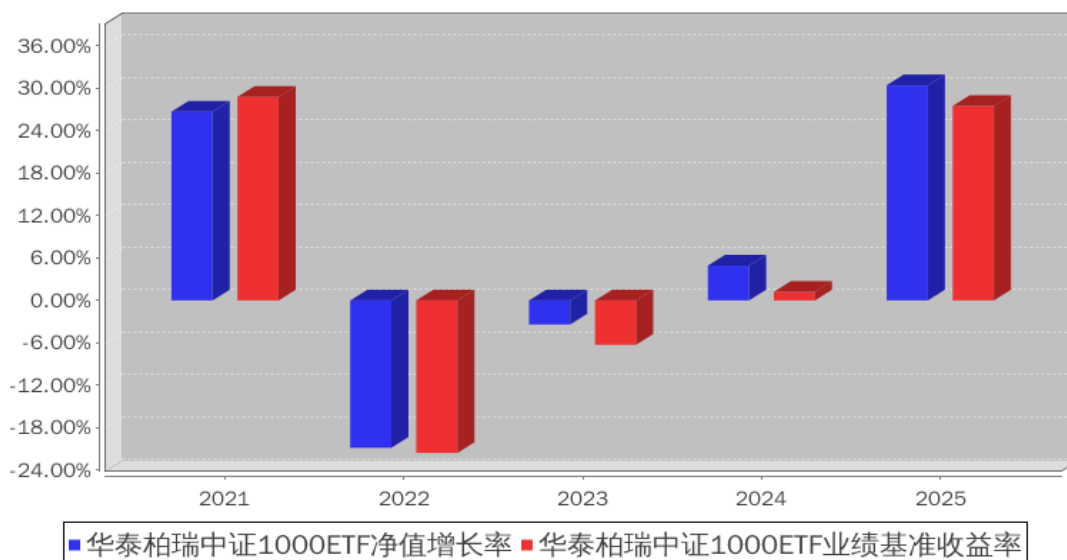
华泰柏瑞中证1000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2021 年 3 月 15 日至 2025 年 12 月 31 日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞中证1000ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2021 年 3 月 15 日起生效，2021 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施过利润分配。

§ 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 2025 年 12 月 31 日，公司旗下管理 190 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	2025 年 1 月 23 日	7 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
李茜	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2021 年 3 月 15 日	2025 年 1 月 23 日	10 年	伦敦政治经济学院金融数学硕士。曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 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。2019 年 11 月至 2022 年 12 月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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 11 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。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月至 2024 年 5 月任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开

					<p>放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华泰柏瑞中证港股通 50 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。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资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。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业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。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利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。2024 年 3 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月起任华泰柏瑞中证 A50 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。2024 年 9 月起任华泰柏瑞恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞恒生创新药交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒生港股通高股息低波动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。</p>
胡亦清	指数投资部总监助理、本基金的基金	2025 年 1 月 23 日	-	11 年	<p>硕士毕业于美国东北大学应用数学专业。2014 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任风险分析员、高级风险分析师、指数投资部高级研究员、总监助理兼投资</p>

	经理			经理。2025 年 1 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。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞北证 50 成份指数型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指自由现金流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全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	----	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
胡亦清	公募基金	9	4,061,604,304.07	2025 年 1 月 23 日
	私募资产管理计划	5	1,638,457,828.89	2023 年 10 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	14	5,700,062,132.96	-

注：本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，胡亦清离任产品情况：

- ① 产品类型：公募，离任数量：0 只，离任时间：无；
- ② 产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1 只，离任时间：2025-10-21。

4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩不直接与兼任基金经理薪酬激励挂钩，公司会根据实际情况对兼任基金经理的公募产品及所管理的私募资产管理计划分别进行考核，并依据考核结果对薪酬激励进行评定和调整。

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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合投资交易行为加强管理、监控和分析，防范不公平交易。包括：原则上采取“多基金指令”下达投资指令，以实现“同时同价”，因产品策略、头寸变化等原因导致无法“同时同价”的，公司每日分析交易流水，并定期通过公平交易系统进行价差监控管理，以加强事后分析。兼任的不同组合间原则上不得进行同日反向交易，遇到特殊情况需要提出申请。风险管理部每日对兼任组合间多个时间窗口下同向及反向交易价差进行监控，强化控制和监测。风险管理部定期对不同投资组合的公平交易情况进行监控和分析，相关投资组合经理对异常交易情况进行说明，风险管理部进行严格复核与独立评估，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，合规法律部对兼任公平交易制度以及其它交易相关规定的贯彻情况进行不定期监察稽核。

本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

4.3.3 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 39 次，是指数投资组合因跟踪指数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

本基金以完全复制中证 1000 指数为投资策略，产品回报主要取决于标的指数收益。2025 年尽管基本面恢复依然较慢，但在宏观底层变量的正向驱动下，A 股市场整体表现优异，中证 1000 指数大涨 27.49%，创下自 2015 年以来的年线收盘新高，沪深 300 指数、中证 500 指数分别收涨 17.66%、30.39%。全年来看 A 股市场交投活跃，下半年日成交金额过 2 万亿成为常态，与此同时市场整体波动率缓慢下降，自 4 月中旬起至年末维持稳步震荡上行的状态，体现为相对更加健康的上涨趋势，这与过往的 A 股市场特性不同。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.036%，期间日跟踪误差为 0.050%，较好地实现了本基金的投资目标。

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 3.1430 元，本报告期基金份额净值增长率为 30.41%，业绩比较基准收益率为 27.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过 2025 年的宏观演绎，当前市场底层逻辑聚焦于中美实力的相对变化，以及 AI 可能带来的影响，经济基本面则相对次要。2025 年前两者均是正向发展，A 股因而整体表现较好。

站在当前时点，底层逻辑方面中美年内未有明显边际变化，暂时中性，AI 边际上依然相对正向，核心是认知人群的扩张仍有超市场预期可能，且技术与应用仍在发展。基本面方面预计将延续缓慢修复的状态，上市公司盈利有望继续改善，这将为市场提供一定支撑。因此全年来看，对 A 股市场维持中性偏好的预期。从区间涨幅和波动率的角度，去年 4 月以来市场走出了历史未有的稳步震荡上行的行情，随着市场逐步成熟、监管预期引导能力提升，2026 年 A 股或有望延续这一状态，但相对稳定系统下，波动率也有阶段性迅速放大的风险，因此年内也需注意交易节奏，或可考虑提升波段操作的频率。

从整体估值水平来看，核心宽基中沪深 300 或仍具备长期配置价值，中证 500、中证 1000 等估值水平相对较高，若遇到短期涨幅过快的阶段，或可适当调整仓位。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规法律部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司合规法律部开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司合规法律部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司合规法律部通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法

合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2026)审字第 70025451_B14 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估华泰柏瑞中证 1000 交易</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,642,518.61	6,214,132.20
结算备付金		4,631,935.04	3,255,276.66
存出保证金		788,370.26	1,273,176.42
交易性金融资产	7.4.7.2	59,543,059.13	165,627,047.65
其中：股票投资		59,543,059.13	165,627,047.65
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		9,855.16	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		66,615,738.20	176,369,632.93
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	7,905.90
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,300.02	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		28,543.48	73,152.60
应付托管费		5,708.71	14,630.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21,796.29	52,829.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	512,978.26	259,478.54
负债合计		573,326.76	407,997.18
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	49,830,537.62	173,146,497.75
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	16,211,873.82	2,815,138.00
净资产合计		66,042,411.44	175,961,635.75
负债和净资产总计		66,615,738.20	176,369,632.93

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.1430 元，基金份额总额 21,012,592.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		25,054,954.21	26,106,450.22
1. 利息收入		100,622.33	137,030.42
其中：存款利息收入	7.4.7.13	100,622.33	137,030.42
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）		21,661,077.08	12,315,351.05
其中：股票投资收益	7.4.7.14	18,978,010.66	8,719,320.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	34,006.29	15,392.57
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	1,814,003.27	1,947,887.64
股利收益	7.4.7.19	835,056.86	1,632,750.64

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）	7.4.7.20	3,260,517.35	13,029,587.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	32,737.45	624,481.71
减：二、营业总支出		893,486.07	1,230,544.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	497,458.91	740,016.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	99,491.78	148,003.24
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		6,535.38	7,018.46
8. 其他费用	7.4.7.23	290,000.00	335,506.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,161,468.14	24,875,905.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,161,468.14	24,875,905.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,161,468.14	24,875,905.37

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	173,146,497.75	-	2,815,138.00	175,961,635.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	173,146,497.75	-	2,815,138.00	175,961,635.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-123,315,960.13	-	13,396,735.82	-109,919,224.31
(一)、综合收益总额	-	-	24,161,468.14	24,161,468.14
(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)	-123,315,960.13	-	-10,764,732.32	-134,080,692.45
其中：1. 基金申购款	161,259,332.39	-	17,592,338.30	178,851,670.69
2. 基金赎回款	-284,575,292.52	-	-28,357,070.62	-312,932,363.14
(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	49,830,537.62	-	16,211,873.82	66,042,411.44
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年12月31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	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22
三、本期增减变动额(减少以“-”	29,044,315.75	-	7,350,578.78	36,394,894.53

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	24,875,905.37	24,875,905.37
(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)	29,044,315.75	-	-17,525,326.59	11,518,989.16
其中：1. 基金申购款	545,374,432.77	-	-57,664,948.04	487,709,484.73
2. 基金赎回款	-516,330,117.02	-	40,139,621.45	-476,190,495.57
(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	173,146,497.75	-	2,815,138.00	175,961,635.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 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[2021]第 235 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,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 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 222,600,550.00 元(含募集股票市值),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(2021)第 0294 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,602,182.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,632.00 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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]118 号核准,本基金 222,602,182.00 份基金份额于 2021 年 3 月 24 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、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、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:投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货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;本基金参与融资业务时,在任何交易日日终,持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内,年化跟踪误差控制在 2%以内。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 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金

的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的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还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市

场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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行为，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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	1,642,518.61	6,214,132.20
等于：本金	1,641,953.21	6,211,087.26
加：应计利息	565.40	3,044.94
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	1,642,518.61	6,214,132.20

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	53,222,392.34	-	59,543,059.13	6,320,666.79
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	53,222,392.34	-	59,543,059.13	6,320,666.79
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	162,074,230.21	-	165,627,047.65	3,552,817.44
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	162,074,230.21	-	165,627,047.65	3,552,817.44

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,706,800.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,706,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,706,800.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,481,480.00	-	-	-
其中：股指期货投资	8,481,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,481,480.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2603	中证 1000 股指期货 2603	4.00	5,951,200.00	244,400.00
合计				244,400.00
减：可抵销期货暂收款				244,400.00
净额				0.00

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

结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 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	8,962.78	69,478.54
其中：交易所市场	8,962.78	69,478.54
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	190,000.00
应退退补款	344,015.48	-
合计	512,978.26	259,478.54

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,012,592.00	173,146,497.75
本期申购	68,000,000.00	161,259,332.39
本期赎回（以“-”号填列）	-120,000,000.00	-284,575,292.52
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	21,012,592.00	49,830,537.62

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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 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	11,899,817.32	-9,084,679.32	2,815,138.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,899,817.32	-9,084,679.32	2,815,138.00
本期利润	20,900,950.79	3,260,517.35	24,161,468.14
本期基金份额交易产生的变动数	-15,030,075.42	4,265,343.10	-10,764,732.32

其中：基金申购款	24,658,904.75	-7,066,566.45	17,592,338.30
基金赎回款	-39,688,980.17	11,331,909.55	-28,357,070.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,770,692.69	-1,558,818.87	16,211,873.82

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	51,457.73	92,830.10
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	48,482.94	40,848.76
其他	681.66	3,351.56
合计	100,622.33	137,030.42

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	13,208,457.38	8,390,339.58
股票投资收益——赎回 差价收入	5,769,553.28	328,980.62
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	18,978,010.66	8,719,320.20

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	195,109,661.49	337,977,960.09
减：卖出股票成本	181,716,579.09	329,060,412.85

总额		
减：交易费用	184,625.02	527,207.66
买卖股票差价收入	13,208,457.38	8,390,339.58

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	312,932,363.14	476,190,495.57
减：现金支付赎回款总额	180,612,782.14	302,179,093.57
减：赎回股票成本总额	126,550,027.72	173,682,421.38
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	5,769,553.28	328,980.62

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	7.77	29.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	33,998.52	15,362.95
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	34,006.29	15,392.57

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	128,011.40	203,404.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	94,000.00	188,000.00
减：应计利息总额	7.77	33.23
减：交易费用	5.11	8.08
买卖债券差价收入	33,998.52	15,362.95

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股指期货投资收益	1,814,003.27	1,947,887.64

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
股票投资产生的股利 收益	835,056.86	1,632,750.64
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	835,056.86	1,632,750.64

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	2,767,849.35	13,231,695.04
股票投资	2,767,849.35	13,231,695.04
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	491,920.00	-201,360.00
权证投资	-	-
期货投资	491,920.00	-201,360.00
3. 其他	748.00	-748.00
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-

合计	3,260,517.35	13,029,587.04
----	--------------	---------------

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	32,737.45	624,481.71
合计	32,737.45	624,481.71

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。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
注册登记费	150,000.00	150,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00	15,506.85
合计	290,000.00	335,506.85

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人、申购赎回代理券商、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、申购赎回代理券商、基金销

	售机构
Heron View Partners LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证监会的相关批复，华泰柏瑞基金管理有限公司已在香港特别行政区政府的公司注册处办理完成香港子公司——华泰柏瑞资产管理（国际）有限公司的注册登记手续，并于 2025 年 9 月 12 日获得香港证券及期货事务监察委员会颁发的第一号（证券交易）、第四号（就证券提供意见）及第九号（提供资产管理）牌照。

3、本基金管理人股东 PineBridge Investment LLC 已于 2025 年 12 月 29 日在特拉华州完成公司名称变更，正式更名为 Heron View Partners LLC。本次更名系法律实体名称调整，未导致基金管理人控制权、股权结构或实际控制关系发生变更。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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 (%)
招商证券	329,582,472.59	100.00	695,248,891.01	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	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 成交总额的比例 (%)
招商证券	128,011.40	100.00	203,404.26	100.00

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31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 (%)
招商证券	65,922.84	100.00	8,962.78	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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 (%)
招商证券	313,606.52	100.00	69,478.54	100.00

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

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	497,458.91	740,016.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,061.64	15,158.59
应支付基金管理人的净管理费	482,397.27	724,857.71

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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	99,491.78	148,003.24

注：支付基金托管人招商证券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：

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	944,541.00	4.4951	944,656.00	1.2938

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.10.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	钧威电子	网下申购	4,833	50,263.20
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,274	47,887.92
华泰联合证券	118062	天准转债	网上配售	40	4,000.00
华泰联合证券	113697	应流转债	网上配售	90	9,000.00
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	688726	拉普拉斯	网下申购	7,527	132,324.66
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	479	13,900.58
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	6,424	72,526.96
招商证券	301631	壹连科技	网下申购	711	51,895.89
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	2,252	50,354.72
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	1,559	33,877.07

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
603508	思维列控	2025 年 12 月 29 日	重要事项未公告	27.82	2026 年 1 月 7 日	27.83	1,400	39,745.15	38,948.00	-
600058	五矿发展	2025 年 12	拟筹划重大资	11.52	2026 年 1 月	12.67	3,100	25,935.88	35,712.00	-

		月 30 日	产重组		15 日					
--	--	-----------	-----	--	------	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 日止持有以上因公布的拟筹划重大资产重组或重要事项未公告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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，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。

7.4.13.2 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 2025 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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 2025 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12。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 2025 年 12 月 31 日，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,642,518.61	-	-	-	-	-	1,642,518.61
结算备付金	4,631,935.04	-	-	-	-	-	4,631,935.04
存出保证金	74,226.26	-	-	-	-	714,144.00	788,370.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	59,543,059.13	59,543,059.13
应收清算款	-	-	-	-	-	9,855.16	9,855.16
资产总计	6,348,679.91	-	-	-	-	60,267,058.29	66,615,738.20

负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,543.48	28,543.48
应付托管费	-	-	-	-	-	5,708.71	5,708.71
应付清算款	-	-	-	-	-	4,300.02	4,300.02
应交税费	-	-	-	-	-	21,796.29	21,796.29
其他负债	-	-	-	-	-	512,978.26	512,978.26
负债总计	-	-	-	-	-	573,326.76	573,326.76
利率敏感度缺口	6,348,679.91	-	-	-	-	59,693,731.53	66,042,411.44
上年度末 2024 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	6,214,132.20	-	-	-	-	-	6,214,132.20
结算备付金	3,255,276.66	-	-	-	-	-	3,255,276.66
存出保证金	285,101.22	-	-	-	-	988,075.20	1,273,176.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	165,627,047.65	165,627,047.65
资产总计	9,754,510.08	-	-	-	-	166,615,122.85	176,369,632.93
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	7,905.90	7,905.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,152.60	73,152.60
应付托管费	-	-	-	-	-	14,630.50	14,630.50
应交税费	-	-	-	-	-	52,829.64	52,829.64
其他负债	-	-	-	-	-	259,478.54	259,478.54
负债总计	-	-	-	-	-	407,997.18	407,997.18
利率敏感度缺口	9,754,510.08	-	-	-	-	166,207,125.67	175,961,635.75

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 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(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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	59,543,059.13	90.16	165,627,047.65	94.13
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	-	-	-7,905.90	-0.00
合计	59,543,059.13	90.16	165,619,141.75	94.12

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资。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。

7.4.13.4.3.2 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(2025年12月31日)	上年度末(2024年12月31日)
	业绩比较基准上升5%	3,231,478.19	8,579,533.75
业绩比较基准下降	-3,231,478.19	-8,579,533.75	

	5%		
--	----	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	59,468,399.13	165,113,248.69
第二层次	74,660.00	180,114.90
第三层次	-	333,684.06
合计	59,543,059.13	165,627,047.65

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	333,684.06	333,684.06
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	85,271.14	85,271.14
转出第三层次	-	661,259.13	661,259.13
当期利得或损失总额	-	242,303.93	242,303.93
其中：计入损益的利得或损失	-	242,303.93	242,303.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	263,625.25	263,625.25
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	182,946.05	182,946.05
转出第三层次	-	335,467.34	335,467.34
当期利得或损失总额	-	222,580.10	222,580.10
其中：计入损益的利得或损失	-	222,580.10	222,580.10
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	333,684.06	333,684.06
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	212,481.30	212,481.30

注：于 2025 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	333,684.06	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.4607~5.7444	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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 2025 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 178,851,670.69 元(2024 年度：487,709,484.73 元)，其中包括以股票支付的申购款 64,107,409.42 元和以现金支付的申购款 114,744,261.27 元(2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 160,255,277.99 元和以现金支付的申购款 327,454,206.74 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	59,543,059.13	89.38
	其中：股票	59,543,059.13	89.38
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	6,274,453.65	9.42
8	其他各项资产	798,225.42	1.20
9	合计	66,615,738.20	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	290,785.20	0.44
B	采矿业	1,511,812.10	2.29
C	制造业	39,885,677.23	60.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,469,842.62	2.23
E	建筑业	696,503.60	1.05
F	批发和零售业	2,005,361.91	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,312,897.80	1.99
H	住宿和餐饮业	78,725.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,929,433.88	10.49
J	金融业	1,591,573.02	2.41
K	房地产业	743,260.00	1.13
L	租赁和商务服务业	960,136.00	1.45
M	科学研究和技术服务业	685,790.22	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	555,092.55	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	34,178.00	0.05
Q	卫生和社会工作	191,602.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	545,900.00	0.83
S	综合	54,488.00	0.08
	合计	59,543,059.13	90.16

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.2 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。

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	300475	香农芯创	2,400	346,416.00	0.52
2	688110	东芯股份	2,415	317,210.25	0.48
3	688498	源杰科技	475	304,945.25	0.46
4	002456	欧菲光	24,100	255,942.00	0.39
5	603083	剑桥科技	1,900	255,322.00	0.39
6	300548	长芯博创	1,600	227,200.00	0.34
7	603516	淳中科技	1,000	223,500.00	0.34
8	600105	永鼎股份	8,200	205,820.00	0.31
9	001309	德明利	880	204,063.20	0.31
10	002497	雅化集团	8,200	202,950.00	0.31
11	688313	仕佳光子	2,271	201,619.38	0.31
12	300456	赛微电子	3,600	201,456.00	0.31
13	000766	通化金马	6,900	189,681.00	0.29
14	300762	上海瀚讯	4,420	184,225.60	0.28
15	603119	浙江荣泰	1,500	173,505.00	0.26
16	688333	铂力特	1,538	171,502.38	0.26
17	600595	中孚实业	19,800	155,430.00	0.24
18	601208	东材科技	5,700	154,413.00	0.23
19	600577	精达股份	12,300	152,889.00	0.23
20	002405	四维图新	16,900	152,269.00	0.23
21	688037	芯源微	1,008	149,698.08	0.23
22	600100	同方股份	16,700	148,964.00	0.23
23	300620	光库科技	1,000	147,050.00	0.22
24	002222	福晶科技	2,610	147,047.40	0.22
25	300568	星源材质	9,600	146,400.00	0.22
26	688200	华峰测控	768	146,073.60	0.22
27	002245	蔚蓝锂芯	8,200	145,960.00	0.22
28	688270	臻镭科技	1,193	145,629.51	0.22
29	002151	北斗星通	3,200	145,376.00	0.22
30	600331	宏达股份	11,300	144,527.00	0.22
31	002487	大金重工	2,700	140,211.00	0.21

32	603236	移远通信	1,454	138,726.14	0.21
33	601777	千里科技	13,000	138,190.00	0.21
34	300666	江丰电子	1,500	138,000.00	0.21
35	603308	应流股份	3,300	137,775.00	0.21
36	300170	汉得信息	7,200	136,224.00	0.21
37	300438	鹏辉能源	2,500	133,050.00	0.20
38	002249	大洋电机	12,200	132,980.00	0.20
39	601677	明泰铝业	8,860	131,039.40	0.20
40	603005	晶方科技	4,656	128,784.96	0.20
41	300102	乾照光电	4,600	126,776.00	0.19
42	300049	福瑞医科	1,800	126,738.00	0.19
43	603667	五洲新春	1,800	125,964.00	0.19
44	688005	容百科技	3,549	125,634.60	0.19
45	600151	航天机电	7,100	124,605.00	0.19
46	300085	银之杰	3,100	124,279.00	0.19
47	300409	道氏技术	5,500	123,695.00	0.19
48	601020	华钰矿业	4,600	123,556.00	0.19
49	688208	道通科技	3,334	122,691.20	0.19
50	002139	拓邦股份	8,900	122,642.00	0.19
51	688343	云天励飞	1,604	122,032.32	0.18
52	002171	楚江新材	9,200	121,992.00	0.18
53	300655	晶瑞电材	7,520	121,297.60	0.18
54	601606	长城军工	2,500	120,300.00	0.18
55	002389	航天彩虹	5,000	119,900.00	0.18
56	600201	生物股份	7,900	119,053.00	0.18
57	002176	江特电机	12,200	118,828.00	0.18
58	300672	国科微	1,100	118,382.00	0.18
59	300953	震裕科技	700	117,614.00	0.18
60	002428	云南锗业	3,700	117,475.00	0.18
61	600388	龙净环保	7,200	117,432.00	0.18
62	300131	英唐智控	8,000	117,280.00	0.18
63	300779	惠城环保	900	117,099.00	0.18
64	000901	航天科技	4,100	116,727.00	0.18
65	688536	思瑞浦	729	116,552.52	0.18
66	300468	四方精创	3,000	116,490.00	0.18
67	688123	聚辰股份	925	116,161.50	0.18
68	688048	长光华芯	925	115,948.75	0.18
69	002611	东方精工	6,000	115,320.00	0.17
70	300459	汤姆猫	25,100	115,209.00	0.17
71	600330	天通股份	8,748	114,861.24	0.17
72	002326	永太科技	4,600	114,632.00	0.17
73	600246	万通发展	9,300	114,390.00	0.17
74	688502	茂莱光学	285	113,729.25	0.17

75	603306	华懋科技	1,800	113,418.00	0.17
76	600114	东睦股份	3,700	113,035.00	0.17
77	603127	昭衍新药	3,200	112,032.00	0.17
78	300253	卫宁健康	12,600	111,132.00	0.17
79	300773	拉卡拉	3,900	111,072.00	0.17
80	301550	斯菱智驱	800	110,960.00	0.17
81	002617	露笑科技	13,600	110,160.00	0.17
82	002400	省广集团	12,400	109,988.00	0.17
83	300083	创世纪	11,900	109,599.00	0.17
84	002149	西部材料	2,400	109,224.00	0.17
85	603063	禾望电气	3,300	109,131.00	0.17
86	601519	大智慧	8,400	108,108.00	0.16
87	002104	恒宝股份	5,000	108,050.00	0.16
88	300088	长信科技	17,800	107,868.00	0.16
89	000969	安泰科技	5,100	107,151.00	0.16
90	300045	华力创通	3,700	106,967.00	0.16
91	002048	宁波华翔	3,400	106,964.00	0.16
92	002484	江海股份	3,600	106,920.00	0.16
93	601126	四方股份	3,500	105,280.00	0.16
94	300182	捷成股份	19,000	104,880.00	0.16
95	688327	云从科技	7,284	104,671.08	0.16
96	000737	北方铜业	6,800	104,652.00	0.16
97	300035	中科电气	4,900	104,321.00	0.16
98	000917	电广传媒	10,100	103,828.00	0.16
99	605090	九丰能源	2,400	103,440.00	0.16
100	600155	华创云信	15,600	103,272.00	0.16
101	688116	天奈科技	2,190	103,258.50	0.16
102	300738	奥飞数据	5,572	103,026.28	0.16
103	300777	中简科技	2,500	102,000.00	0.15
104	001203	大中矿业	3,300	101,145.00	0.15
105	600416	湘电股份	6,400	100,992.00	0.15
106	000875	吉电股份	17,900	100,956.00	0.15
107	600728	佳都科技	15,100	100,868.00	0.15
108	603613	国联股份	3,600	100,800.00	0.15
109	600179	安通控股	18,200	100,464.00	0.15
110	002163	海南发展	4,200	100,128.00	0.15
111	002544	普天科技	2,900	100,021.00	0.15
112	002396	星网锐捷	3,300	99,990.00	0.15
113	300674	宇信科技	4,100	99,466.00	0.15
114	688205	德科立	714	98,160.72	0.15
115	300296	利亚德	15,500	97,960.00	0.15
116	300068	南都电源	6,300	97,902.00	0.15
117	600338	西藏珠峰	6,500	97,760.00	0.15

118	002716	湖南白银	14,100	97,572.00	0.15
119	300229	拓尔思	4,900	97,510.00	0.15
120	600323	瀚蓝环境	3,400	97,240.00	0.15
121	688331	荣昌生物	1,247	97,004.13	0.15
122	300638	广和通	3,260	96,626.40	0.15
123	300007	汉威科技	1,800	96,480.00	0.15
124	002276	万马股份	5,700	96,387.00	0.15
125	688630	芯碁微装	716	96,323.48	0.15
126	300236	上海新阳	1,500	95,640.00	0.14
127	300315	掌趣科技	19,300	95,342.00	0.14
128	002270	华明装备	3,800	95,152.00	0.14
129	000970	中科三环	7,000	94,920.00	0.14
130	300593	新雷能	3,180	94,636.80	0.14
131	603881	数据港	3,106	94,515.58	0.14
132	001301	尚太科技	1,100	94,391.00	0.14
133	300101	振芯科技	3,300	93,819.00	0.14
134	002506	协鑫集成	33,500	93,800.00	0.14
135	000686	东北证券	10,000	93,200.00	0.14
136	301171	易点天下	2,300	93,150.00	0.14
137	601869	长飞光纤	800	93,088.00	0.14
138	002145	钛能化学	18,990	93,051.00	0.14
139	000636	风华高科	5,700	92,796.00	0.14
140	300065	海兰信	5,100	92,667.00	0.14
141	600759	洲际油气	29,600	92,352.00	0.14
142	600761	安徽合力	4,400	91,916.00	0.14
143	002373	千方科技	7,800	91,806.00	0.14
144	600529	山东药玻	4,600	91,678.00	0.14
145	002895	川恒股份	2,500	91,650.00	0.14
146	002317	众生药业	4,800	91,104.00	0.14
147	000811	冰轮环境	4,880	90,377.60	0.14
148	600635	大众公用	13,800	90,252.00	0.14
149	600120	浙江东方	14,600	90,082.00	0.14
150	600259	中稀有色	1,600	90,016.00	0.14
151	000603	盛达资源	2,900	89,784.00	0.14
151	300348	长亮科技	5,800	89,784.00	0.14
152	603300	海南华铁	11,420	89,647.00	0.14
153	600877	电科芯片	5,100	89,505.00	0.14
154	688382	益方生物	3,272	89,129.28	0.13
155	300870	欧陆通	400	88,400.00	0.13
156	300827	上能电气	2,583	88,390.26	0.13
157	688372	伟测科技	810	88,362.90	0.13
158	000422	湖北宜化	6,200	88,102.00	0.13
159	300199	翰宇药业	4,900	87,710.00	0.13

160	002747	埃斯顿	3,700	87,690.00	0.13
161	601636	旗滨集团	14,700	87,171.00	0.13
162	600850	电科数字	2,920	86,548.80	0.13
163	688484	南芯科技	2,126	86,443.16	0.13
164	002268	电科网安	4,200	86,268.00	0.13
165	600859	王府井	5,500	85,415.00	0.13
166	600206	有研新材	4,200	85,386.00	0.13
167	600490	鹏欣资源	11,000	85,030.00	0.13
168	605376	博迁新材	1,300	85,020.00	0.13
169	300811	铂科新材	1,192	85,001.52	0.13
170	300077	国民技术	4,200	84,924.00	0.13
171	601375	中原证券	19,700	84,710.00	0.13
172	002174	游族网络	6,900	84,456.00	0.13
173	300573	兴齐眼药	1,200	84,348.00	0.13
174	301205	联特科技	500	84,255.00	0.13
175	688766	普冉股份	660	83,958.60	0.13
176	605111	新洁能	2,346	83,822.58	0.13
177	002681	奋达科技	12,600	83,790.00	0.13
178	600667	太极实业	10,500	83,685.00	0.13
179	601975	招商南油	27,700	83,654.00	0.13
180	688698	伟创电气	846	83,652.48	0.13
181	301377	鼎泰高科	600	83,460.00	0.13
182	600559	老白干酒	5,200	83,408.00	0.13
183	000681	视觉中国	3,500	83,335.00	0.13
184	002536	飞龙股份	2,800	83,160.00	0.13
185	600986	浙文互联	10,600	82,892.00	0.13
186	600456	宝钛股份	2,100	82,845.00	0.13
187	300850	新强联	2,000	82,740.00	0.13
188	002036	联创电子	7,500	82,650.00	0.13
189	688652	京仪装备	840	82,580.40	0.13
190	301511	德福科技	2,300	82,317.00	0.12
191	603026	石大胜华	1,100	82,291.00	0.12
192	600619	海立股份	3,900	82,290.00	0.12
193	600113	浙江东日	1,300	82,121.00	0.12
194	300775	三角防务	2,700	82,080.00	0.12
195	300184	力源信息	8,200	81,918.00	0.12
196	002545	东方铁塔	4,400	81,180.00	0.12
197	600641	先导基电	4,600	81,144.00	0.12
198	300181	佐力药业	5,000	80,800.00	0.12
198	603358	华达科技	1,600	80,800.00	0.12
199	603360	百傲化学	2,500	80,550.00	0.12
200	002237	恒邦股份	6,000	80,520.00	0.12
201	002807	江阴银行	17,600	80,432.00	0.12

202	688567	孚能科技	5,134	80,347.10	0.12
203	300624	万兴科技	1,137	80,329.05	0.12
204	688548	广钢气体	5,514	80,173.56	0.12
205	688131	皓元医药	1,109	79,936.72	0.12
206	002020	京新药业	4,200	79,716.00	0.12
207	300260	新莱应材	1,400	79,646.00	0.12
208	601528	瑞丰银行	13,970	79,629.00	0.12
209	300009	安科生物	8,300	79,431.00	0.12
210	603305	旭升集团	4,900	79,282.00	0.12
211	000099	中信海直	3,800	78,850.00	0.12
212	000762	西藏矿业	3,000	78,810.00	0.12
213	600258	首旅酒店	4,700	78,725.00	0.12
214	300133	华策影视	9,400	78,208.00	0.12
215	002046	国机精工	1,800	77,724.00	0.12
216	300130	新国都	2,800	77,644.00	0.12
217	002518	科士达	1,600	77,632.00	0.12
218	600596	新安股份	6,757	77,502.79	0.12
219	300008	天海防务	9,800	77,322.00	0.12
220	600872	中炬高新	4,400	77,220.00	0.12
221	603009	北特科技	1,600	77,056.00	0.12
222	000680	山推股份	6,400	76,608.00	0.12
223	688141	杰华特	1,763	76,567.09	0.12
224	600186	莲花控股	12,800	76,544.00	0.12
225	002182	宝武镁业	5,000	76,500.00	0.12
226	002212	天融信	8,400	76,188.00	0.12
227	002701	奥瑞金	12,800	76,160.00	0.12
228	301316	慧博云通	1,700	75,956.00	0.12
229	002368	太极股份	3,100	75,919.00	0.11
230	601778	晶科科技	20,400	75,888.00	0.11
231	300607	拓斯达	2,300	75,762.00	0.11
232	300457	赢合科技	2,700	75,195.00	0.11
233	002354	天娱数科	11,800	75,166.00	0.11
234	002324	普利特	4,700	75,153.00	0.11
235	300455	航天智装	2,500	75,100.00	0.11
236	603997	继峰股份	5,400	75,060.00	0.11
237	000612	焦作万方	6,800	74,936.00	0.11
238	688088	虹软科技	1,512	74,844.00	0.11
239	600446	金证股份	4,700	74,824.00	0.11
240	601137	博威合金	3,500	74,795.00	0.11
241	300657	弘信电子	2,700	74,682.00	0.11
242	600064	南京高科	8,600	74,648.00	0.11
243	300660	江苏雷利	1,360	74,555.20	0.11
244	600366	宁波韵升	5,400	74,466.00	0.11

245	300098	高新兴	12,200	74,420.00	0.11
246	600072	中船科技	6,400	74,368.00	0.11
247	300398	飞凯材料	3,300	73,953.00	0.11
248	688390	固德威	1,189	73,872.57	0.11
249	600629	华建集团	3,400	73,780.00	0.11
250	002507	涪陵榨菜	5,700	73,587.00	0.11
251	688029	南微医学	900	73,404.00	0.11
252	600320	振华重工	14,200	73,130.00	0.11
253	000801	四川九洲	4,300	72,928.00	0.11
254	603323	苏农银行	14,420	72,821.00	0.11
255	688158	优刻得	2,581	72,500.29	0.11
256	002192	融捷股份	1,400	72,450.00	0.11
257	600933	爱柯迪	3,600	72,360.00	0.11
258	002698	博实股份	4,300	72,283.00	0.11
259	000581	威孚高科	3,500	72,170.00	0.11
260	002539	云图控股	6,100	72,102.00	0.11
260	688503	聚和材料	1,182	72,102.00	0.11
261	600835	上海机电	2,400	72,024.00	0.11
262	603662	柯力传感	1,000	72,000.00	0.11
263	002075	沙钢股份	12,500	71,875.00	0.11
264	688403	汇成股份	4,383	71,793.54	0.11
265	688279	峰岬科技	352	71,628.48	0.11
266	002896	中大力德	800	71,488.00	0.11
267	002745	木林森	7,400	70,818.00	0.11
268	603678	火炬电子	2,000	70,640.00	0.11
269	002251	步步高	13,300	70,623.00	0.11
270	688789	宏华数科	862	70,313.34	0.11
271	000778	新兴铸管	16,800	70,224.00	0.11
272	002815	崇达技术	5,100	69,666.00	0.11
273	002015	协鑫能科	7,000	69,650.00	0.11
274	300602	飞荣达	2,100	69,636.00	0.11
275	000555	神州信息	4,200	69,510.00	0.11
276	600633	浙数文化	5,400	69,444.00	0.11
277	002123	梦网科技	5,700	69,312.00	0.10
278	300303	聚飞光电	10,100	69,084.00	0.10
279	600301	华锡有色	1,800	69,048.00	0.10
280	600133	东湖高新	7,600	69,008.00	0.10
281	601187	厦门银行	9,400	68,996.00	0.10
282	002706	良信股份	6,400	68,992.00	0.10
283	301029	怡合达	2,600	68,952.00	0.10
284	600428	中远海特	9,700	68,870.00	0.10
285	600459	贵研铂业	3,700	68,857.00	0.10
286	688433	华曙高科	1,040	68,816.80	0.10

287	300113	顺网科技	3,400	68,816.00	0.10
288	688400	凌云光	1,623	68,782.74	0.10
289	000902	新洋丰	4,400	68,728.00	0.10
290	600550	保变电气	6,500	68,575.00	0.10
291	600718	东软集团	6,800	68,476.00	0.10
292	300682	朗新科技	4,500	68,445.00	0.10
293	600285	羚锐制药	3,300	68,343.00	0.10
294	002936	郑州银行	35,400	68,322.00	0.10
295	600057	厦门象屿	8,000	68,160.00	0.10
296	002779	中坚科技	600	68,136.00	0.10
297	688063	派能科技	1,199	68,127.18	0.10
298	603456	九洲药业	3,800	68,020.00	0.10
299	300378	鼎捷数智	1,500	67,890.00	0.10
300	300618	寒锐钴业	1,500	67,815.00	0.10
301	600867	通化东宝	8,300	67,811.00	0.10
302	000923	河钢资源	3,200	67,744.00	0.10
303	688068	热景生物	418	67,716.00	0.10
304	002948	青岛银行	15,100	67,648.00	0.10
305	002947	恒铭达	1,300	67,626.00	0.10
306	000682	东方电子	5,700	67,602.00	0.10
307	002654	万润科技	4,800	67,536.00	0.10
308	603690	至纯科技	2,140	67,303.00	0.10
309	002006	精工科技	2,900	67,164.00	0.10
310	600552	凯盛科技	5,400	66,960.00	0.10
310	603871	嘉友国际	4,800	66,960.00	0.10
311	300276	三丰智能	6,900	66,930.00	0.10
312	688559	海目星	1,390	66,803.40	0.10
313	688696	极米科技	599	66,776.52	0.10
314	603588	高能环境	8,640	66,700.80	0.10
315	002416	爱施德	5,300	66,674.00	0.10
316	600216	浙江医药	4,800	66,528.00	0.10
317	300166	东方国信	6,500	66,430.00	0.10
318	000035	中国天楹	12,000	66,240.00	0.10
319	300034	钢研高纳	3,380	66,180.40	0.10
320	001227	兰州银行	28,500	66,120.00	0.10
321	688800	瑞可达	795	65,985.00	0.10
322	601609	金田股份	6,100	65,880.00	0.10
323	002097	山河智能	5,300	65,773.00	0.10
324	002170	芭田股份	5,400	65,772.00	0.10
325	000758	中色股份	9,900	65,736.00	0.10
326	600645	中源协和	2,600	65,520.00	0.10
327	600478	科力远	9,507	65,503.23	0.10
328	688362	甬矽电子	2,021	65,500.61	0.10

329	600325	华发股份	15,500	65,410.00	0.10
330	688050	爱博医疗	1,078	65,391.48	0.10
331	301078	孩子王	6,300	65,331.00	0.10
332	603267	鸿远电子	1,200	65,316.00	0.10
333	300357	我武生物	2,300	65,205.00	0.10
334	300693	盛弘股份	1,700	65,076.00	0.10
335	688660	电气风电	3,819	64,961.19	0.10
336	002063	远光软件	10,700	64,949.00	0.10
337	000690	宝新能源	15,500	64,945.00	0.10
338	301293	三博脑科	1,100	64,878.00	0.10
339	301050	雷电微力	1,240	64,728.00	0.10
340	600908	无锡银行	10,900	64,637.00	0.10
341	002675	东诚药业	4,700	64,578.00	0.10
342	603809	豪能股份	4,500	64,575.00	0.10
343	600869	远东股份	8,000	64,400.00	0.10
344	000403	派林生物	4,700	64,343.00	0.10
345	002987	京北方	2,985	64,267.05	0.10
346	688409	富创精密	953	64,232.20	0.10
347	002315	焦点科技	1,400	64,064.00	0.10
348	000688	国城矿业	2,300	63,940.00	0.10
349	000543	皖能电力	8,000	63,600.00	0.10
350	300036	超图软件	3,500	63,560.00	0.10
351	600480	凌云股份	5,170	63,539.30	0.10
352	002839	张家港行	13,900	63,523.00	0.10
353	300747	锐科激光	2,350	63,520.50	0.10
354	600531	豫光金铅	5,400	63,450.00	0.10
355	000420	吉林化纤	14,000	63,420.00	0.10
356	300910	瑞丰新材	1,120	63,336.00	0.10
357	000829	天音控股	5,800	63,278.00	0.10
358	600210	紫江企业	8,600	63,210.00	0.10
359	688321	微芯生物	2,161	63,144.42	0.10
360	300352	北信源	10,300	63,139.00	0.10
361	300185	通裕重工	22,200	63,048.00	0.10
362	300772	运达股份	3,300	62,898.00	0.10
363	688543	国科军工	1,009	62,628.63	0.09
364	600750	江中药业	2,700	62,559.00	0.09
365	601678	滨化股份	14,700	62,328.00	0.09
366	002091	江苏国泰	6,900	62,307.00	0.09
367	002019	亿帆医药	5,200	62,192.00	0.09
368	000676	智度股份	7,200	62,136.00	0.09
369	688779	五矿新能	8,270	61,942.30	0.09
370	002183	怡亚通	13,000	61,880.00	0.09
371	600452	涪陵电力	6,586	61,710.82	0.09

372	300725	药石科技	1,600	61,696.00	0.09
373	600993	马应龙	2,200	61,600.00	0.09
374	300761	立华股份	2,960	61,420.00	0.09
375	600063	皖维高新	10,400	61,256.00	0.09
376	600961	株冶集团	3,800	61,180.00	0.09
377	300598	诚迈科技	1,330	61,140.10	0.09
378	600771	广誉远	3,400	61,132.00	0.09
379	300726	宏达电子	1,200	61,092.00	0.09
380	300180	华峰超纤	8,800	60,984.00	0.09
381	300446	航天智造	2,400	60,816.00	0.09
382	002364	中恒电气	2,300	60,812.00	0.09
383	002537	海联金汇	6,700	60,702.00	0.09
384	603337	杰克科技	1,400	60,662.00	0.09
385	000685	中山公用	5,200	60,580.00	0.09
386	600267	海正药业	6,100	60,329.00	0.09
387	600273	嘉化能源	6,900	60,306.00	0.09
388	300224	正海磁材	3,900	60,294.00	0.09
389	300663	科蓝软件	3,400	59,976.00	0.09
390	002643	万润股份	4,000	59,960.00	0.09
391	300415	伊之密	2,300	59,938.00	0.09
392	603619	中曼石油	2,600	59,930.00	0.09
393	301510	固高科技	1,600	59,920.00	0.09
394	002928	华夏航空	5,400	59,670.00	0.09
395	600389	江山股份	2,350	59,408.00	0.09
396	603876	鼎胜新材	3,940	59,139.40	0.09
397	600864	哈投股份	8,900	59,007.00	0.09
398	001287	中电港	2,600	58,916.00	0.09
399	002979	雷赛智能	1,400	58,898.00	0.09
400	688516	奥特维	1,300	58,838.00	0.09
401	002073	软控股份	7,200	58,680.00	0.09
402	300576	容大感光	1,520	58,596.00	0.09
403	688612	威迈斯	1,777	58,587.69	0.09
404	601963	重庆银行	5,400	58,482.00	0.09
405	300319	麦捷科技	5,000	58,450.00	0.09
406	002338	奥普光电	1,000	58,390.00	0.09
407	600507	方大特钢	9,900	58,311.00	0.09
408	002378	章源钨业	4,110	58,279.80	0.09
409	301217	铜冠铜箔	1,700	58,276.00	0.09
410	300493	润欣科技	2,900	58,261.00	0.09
411	688062	迈威生物	1,513	58,205.11	0.09
412	000628	高新发展	1,300	57,967.00	0.09
413	600399	抚顺特钢	9,900	57,816.00	0.09
414	603505	金石资源	3,090	57,721.20	0.09

415	002468	申通快递	4,300	57,706.00	0.09
416	002100	天康生物	7,800	57,486.00	0.09
417	601860	紫金银行	20,800	57,408.00	0.09
418	002320	海峡股份	4,700	57,199.00	0.09
419	600821	金开新能	11,200	57,120.00	0.09
420	600022	山东钢铁	37,800	57,078.00	0.09
421	002011	盾安环境	4,500	57,060.00	0.09
422	688262	国芯科技	1,878	56,997.30	0.09
423	002010	传化智联	9,800	56,938.00	0.09
424	002891	中宠股份	1,100	56,936.00	0.09
425	002023	海特高新	4,200	56,868.00	0.09
426	600572	康恩贝	12,700	56,642.00	0.09
427	002239	奥特佳	19,000	56,620.00	0.09
428	000061	农产品	5,500	56,595.00	0.09
428	301526	国际复材	8,085	56,595.00	0.09
429	300047	天源迪科	4,500	56,475.00	0.09
430	605020	永和股份	2,100	56,469.00	0.09
431	600353	旭光电子	3,500	56,420.00	0.09
432	603612	索通发展	2,400	56,400.00	0.09
433	600621	华鑫股份	3,700	56,388.00	0.09
434	601222	林洋能源	10,300	56,341.00	0.09
435	688798	艾为电子	739	56,245.29	0.09
436	600509	天富能源	6,800	56,168.00	0.09
437	300327	中颖电子	2,000	56,060.00	0.08
438	300776	帝尔激光	900	55,926.00	0.08
439	002292	奥飞娱乐	6,300	55,755.00	0.08
440	688326	经纬恒润	473	55,577.50	0.08
441	300244	迪安诊断	3,500	55,475.00	0.08
442	603887	城地香江	4,100	55,432.00	0.08
443	688776	国光电气	550	55,407.00	0.08
444	002649	博彦科技	4,200	55,398.00	0.08
445	000837	秦川机床	4,300	55,384.00	0.08
446	300087	荃银高科	4,740	55,363.20	0.08
447	301219	腾远钴业	810	55,306.80	0.08
448	002906	华阳集团	1,800	55,044.00	0.08
449	688686	奥普特	442	54,865.46	0.08
450	000620	盈新发展	20,400	54,672.00	0.08
451	000935	四川双马	2,200	54,648.00	0.08
452	600556	天下秀	9,000	54,630.00	0.08
453	301291	明阳电气	1,311	54,550.71	0.08
454	000833	粤桂股份	2,800	54,488.00	0.08
455	600409	三友化工	8,800	54,472.00	0.08
456	600776	东方通信	3,300	54,450.00	0.08

457	002572	索菲亚	4,000	54,440.00	0.08
458	300079	数码视讯	10,100	54,439.00	0.08
459	600783	鲁信创投	2,200	54,406.00	0.08
460	300595	欧普康视	3,700	54,353.00	0.08
461	688127	蓝特光学	1,411	54,309.39	0.08
462	300337	银邦股份	3,500	54,285.00	0.08
463	002221	东华能源	6,700	54,270.00	0.08
464	000860	顺鑫农业	3,700	54,205.00	0.08
465	688523	航天环宇	968	54,169.28	0.08
466	002003	伟星股份	5,100	54,060.00	0.08
467	002226	江南化工	9,300	54,033.00	0.08
468	002004	华邦健康	11,300	54,014.00	0.08
469	002215	诺普信	5,100	54,009.00	0.08
470	301031	中熔电气	480	53,851.20	0.08
471	600185	珠免集团	7,900	53,799.00	0.08
472	002345	潮宏基	4,300	53,750.00	0.08
473	600056	中国医药	5,200	53,716.00	0.08
474	300075	数字政通	3,500	53,690.00	0.08
475	300525	博思软件	3,800	53,580.00	0.08
476	002017	东信和平	2,400	53,520.00	0.08
477	300363	博腾股份	2,300	53,452.00	0.08
478	603583	捷昌驱动	1,400	53,298.00	0.08
479	600686	金龙汽车	3,000	53,220.00	0.08
480	600996	贵广网络	5,300	53,212.00	0.08
481	601311	骆驼股份	5,800	53,186.00	0.08
482	002233	塔牌集团	5,900	53,159.00	0.08
483	300855	图南股份	1,640	52,972.00	0.08
484	601718	际华集团	15,800	52,930.00	0.08
485	000712	锦龙股份	4,400	52,888.00	0.08
486	002965	祥鑫科技	1,300	52,884.00	0.08
487	002204	大连重工	6,900	52,785.00	0.08
488	600782	新钢股份	13,600	52,768.00	0.08
489	002847	盐津铺子	770	52,598.70	0.08
490	300188	国投智能	3,600	52,596.00	0.08
491	688206	概伦电子	1,506	52,453.98	0.08
492	300026	红日药业	14,900	52,448.00	0.08
493	688596	正帆科技	1,658	52,442.54	0.08
494	300031	宝通科技	2,300	52,279.00	0.08
495	301263	泰恩康	1,800	52,182.00	0.08
496	688016	心脉医疗	569	52,154.54	0.08
497	688439	振华风光	805	52,003.00	0.08
498	605123	派克新材	500	51,950.00	0.08
499	600211	西藏药业	1,220	51,911.00	0.08

500	600315	上海家化	2,300	51,796.00	0.08
501	688147	微导纳米	824	51,738.96	0.08
502	600787	中储股份	9,200	51,704.00	0.08
503	600328	中盐化工	6,260	51,582.40	0.08
504	002690	美亚光电	2,500	51,425.00	0.08
505	600827	百联股份	5,700	51,243.00	0.08
506	603283	赛腾股份	1,180	51,117.60	0.08
507	600037	歌华有线	7,000	51,100.00	0.08
508	600651	飞乐音响	7,000	51,030.00	0.08
509	000089	深圳机场	7,300	51,027.00	0.08
510	600461	洪城环境	5,500	50,985.00	0.08
511	300925	法本信息	2,400	50,976.00	0.08
512	603108	润达医疗	3,400	50,830.00	0.08
513	600773	西藏城投	4,100	50,799.00	0.08
514	603220	中贝通信	2,380	50,694.00	0.08
515	601069	西部黄金	1,900	50,692.00	0.08
516	002099	海翔药业	8,100	50,544.00	0.08
517	688083	中望软件	741	50,469.51	0.08
518	002332	仙琚制药	5,600	50,456.00	0.08
519	002043	兔宝宝	3,500	50,435.00	0.08
520	301345	涛涛车业	200	50,264.00	0.08
521	301095	广立微	700	50,197.00	0.08
522	000156	华数传媒	6,600	49,962.00	0.08
523	601969	海南矿业	4,200	49,896.00	0.08
524	688306	均普智能	4,301	49,891.60	0.08
525	002597	金禾实业	2,400	49,824.00	0.08
526	000503	国新健康	5,600	49,728.00	0.08
527	300294	博雅生物	2,200	49,720.00	0.08
528	600916	中国黄金	6,100	49,715.00	0.08
529	605507	国邦医药	2,000	49,600.00	0.08
530	002550	千红制药	6,300	49,518.00	0.07
531	603663	三祥新材	1,400	49,490.00	0.07
532	601890	亚星锚链	4,800	49,392.00	0.07
533	688332	中科蓝讯	376	49,372.56	0.07
534	301589	诺瓦星云	300	49,365.00	0.07
535	002541	鸿路钢构	3,000	49,320.00	0.07
536	002408	齐翔腾达	10,100	49,288.00	0.07
537	000727	冠捷科技	19,400	49,276.00	0.07
538	002488	金固股份	5,600	49,224.00	0.07
539	600888	新疆众和	6,000	49,140.00	0.07
540	600475	华光环能	2,700	49,059.00	0.07
541	601369	陕鼓动力	4,900	49,049.00	0.07
542	603169	兰石重装	4,600	49,036.00	0.07

543	300821	东岳硅材	4,200	48,972.00	0.07
544	688519	南亚新材	605	48,920.30	0.07
545	600129	太极集团	2,700	48,735.00	0.07
546	600866	星湖科技	7,000	48,650.00	0.07
547	301155	海力风电	600	48,558.00	0.07
548	600587	新华医疗	3,370	48,528.00	0.07
549	000810	创维数字	4,100	48,298.00	0.07
550	300687	赛意信息	2,100	48,237.00	0.07
551	603039	泛微网络	900	48,186.00	0.07
552	300634	彩讯股份	1,900	47,937.00	0.07
553	603393	新天然气	1,800	47,862.00	0.07
554	000795	英洛华	4,800	47,856.00	0.07
555	603218	日月股份	3,600	47,700.00	0.07
556	301035	润丰股份	700	47,607.00	0.07
557	002557	洽洽食品	2,200	47,564.00	0.07
558	002941	新疆交建	3,000	47,550.00	0.07
559	600420	国药现代	4,700	47,470.00	0.07
560	603883	老百姓	3,200	47,360.00	0.07
561	000065	北方国际	3,800	47,348.00	0.07
562	603556	海兴电力	1,300	47,320.00	0.07
563	688515	裕太微	461	47,275.55	0.07
564	688097	博众精工	1,251	47,225.25	0.07
565	600158	中体产业	5,400	47,142.00	0.07
566	600789	鲁抗医药	5,200	47,008.00	0.07
567	002045	国光电器	3,300	46,761.00	0.07
568	600055	万东医疗	3,000	46,740.00	0.07
569	301039	中集车辆	5,100	46,665.00	0.07
570	002096	易普力	3,500	46,620.00	0.07
571	603698	航天工程	1,200	46,500.00	0.07
572	600422	昆药集团	3,700	46,472.00	0.07
573	300323	华灿光电	5,800	46,284.00	0.07
574	002967	广电计量	2,100	46,221.00	0.07
575	688591	泰凌微	1,086	46,220.16	0.07
576	603027	千禾味业	4,696	46,161.68	0.07
577	600717	天津港	10,300	46,041.00	0.07
578	600654	中安科	12,200	45,994.00	0.07
579	688091	上海谊众	974	45,778.00	0.07
580	000589	贵州轮胎	8,800	45,584.00	0.07
581	300723	一品红	1,350	45,292.50	0.07
582	601619	嘉泽新能	10,200	45,288.00	0.07
583	600882	妙可蓝多	1,800	45,252.00	0.07
584	688003	天准科技	768	45,235.20	0.07
585	300226	上海钢联	1,800	45,216.00	0.07

586	000650	仁和药业	8,000	45,200.00	0.07
587	300470	中密控股	1,200	45,120.00	0.07
588	601702	华峰铝业	2,200	45,034.00	0.07
589	300685	艾德生物	2,200	45,012.00	0.07
590	688289	圣湘生物	2,380	45,005.80	0.07
591	600361	创新新材	10,600	44,944.00	0.07
592	000927	中国铁物	17,200	44,892.00	0.07
593	600373	中文传媒	4,800	44,832.00	0.07
594	300580	贝斯特	1,700	44,693.00	0.07
595	300613	富瀚微	970	44,678.20	0.07
596	300232	洲明科技	6,300	44,667.00	0.07
597	688300	联瑞新材	719	44,642.71	0.07
598	600266	城建发展	8,800	44,616.00	0.07
599	300416	苏试试验	2,500	44,600.00	0.07
600	600094	大名城	10,700	44,512.00	0.07
601	600116	三峡水利	6,800	44,472.00	0.07
602	301018	申菱环境	700	44,464.00	0.07
603	002985	北摩高科	1,400	44,422.00	0.07
604	002258	利尔化学	3,400	44,370.00	0.07
605	688006	杭可科技	1,513	44,315.77	0.07
606	603599	广信股份	3,860	44,312.80	0.07
607	603256	宏和科技	1,200	44,172.00	0.07
608	000672	上峰水泥	3,400	44,166.00	0.07
609	600252	中恒集团	16,100	44,114.00	0.07
610	603171	税友股份	800	44,104.00	0.07
611	688106	金宏气体	2,247	44,018.73	0.07
612	688700	东威科技	1,247	43,994.16	0.07
613	688007	光峰科技	2,366	43,936.62	0.07
614	002079	苏州固锟	4,600	43,930.00	0.07
615	002531	天顺风能	6,400	43,904.00	0.07
616	000791	甘肃能源	6,800	43,860.00	0.07
617	002434	万里扬	4,600	43,838.00	0.07
618	000880	潍柴重机	1,600	43,712.00	0.07
619	000600	建投能源	5,100	43,503.00	0.07
620	300360	炬华科技	2,500	43,475.00	0.07
621	002626	金达威	2,200	43,362.00	0.07
622	300841	康华生物	600	43,356.00	0.07
623	688631	莱斯信息	636	43,298.88	0.07
624	688165	埃夫特	1,821	43,266.96	0.07
625	002897	意华股份	800	43,256.00	0.07
626	600269	赣粤高速	8,300	43,077.00	0.07
627	300451	创业慧康	8,900	43,076.00	0.07
628	300678	中科信息	1,400	43,064.00	0.07

629	300027	华谊兄弟	19,800	42,966.00	0.07
630	688658	悦康药业	1,893	42,800.73	0.06
631	002243	力合科创	4,300	42,785.00	0.06
632	002421	达实智能	15,000	42,750.00	0.06
633	000049	德赛电池	1,590	42,739.20	0.06
634	688352	颀中科技	3,382	42,647.02	0.06
635	688139	海尔生物	1,340	42,585.20	0.06
636	300284	苏交科	5,400	42,552.00	0.06
637	301127	武汉天源	2,800	42,532.00	0.06
638	000012	南玻 A	9,600	42,528.00	0.06
639	600458	时代新材	3,200	42,464.00	0.06
640	300770	新媒股份	1,000	42,410.00	0.06
641	300171	东富龙	2,700	42,390.00	0.06
642	300443	金雷股份	1,500	42,195.00	0.06
643	600751	海航科技	11,000	42,130.00	0.06
644	603297	永新光学	400	42,120.00	0.06
645	002254	泰和新材	4,200	42,084.00	0.06
646	300428	立中集团	1,800	42,030.00	0.06
647	600682	南京新百	4,800	41,952.00	0.06
648	002588	史丹利	4,200	41,916.00	0.06
649	600125	铁龙物流	6,500	41,860.00	0.06
650	000966	长源电力	9,800	41,846.00	0.06
651	688690	纳微科技	1,621	41,838.01	0.06
652	000029	深深房 A	1,900	41,838.00	0.06
653	600744	华银电力	7,100	41,748.00	0.06
654	688153	唯捷创芯	1,109	41,742.76	0.06
655	600059	古越龙山	4,500	41,670.00	0.06
656	301487	盟固利	1,900	41,667.00	0.06
657	300482	万孚生物	2,100	41,475.00	0.06
658	002859	洁美科技	1,500	41,400.00	0.06
659	002892	科力尔	3,080	41,333.60	0.06
660	002127	南极电商	12,200	41,114.00	0.06
661	688408	中信博	972	40,930.92	0.06
662	600006	东风股份	5,700	40,926.00	0.06
663	603496	恒为科技	1,500	40,920.00	0.06
664	600033	福建高速	9,900	40,887.00	0.06
665	600623	华谊集团	5,300	40,863.00	0.06
666	300401	花园生物	2,700	40,824.00	0.06
667	603197	保隆科技	1,100	40,689.00	0.06
668	002219	新里程	19,100	40,683.00	0.06
669	603279	景津装备	2,400	40,488.00	0.06
670	000990	诚志股份	5,100	40,392.00	0.06
671	301571	国科天成	700	40,376.00	0.06

672	000928	中钢国际	6,100	40,321.00	0.06
673	601908	京运通	10,300	40,273.00	0.06
674	002093	国脉科技	3,500	40,250.00	0.06
674	603100	川仪股份	1,750	40,250.00	0.06
675	301071	力量钻石	1,120	40,140.80	0.06
676	002881	美格智能	900	40,104.00	0.06
677	600710	苏美达	3,700	39,997.00	0.06
678	688146	中船特气	987	39,874.80	0.06
679	600502	安徽建工	8,500	39,865.00	0.06
680	603533	掌阅科技	1,800	39,816.00	0.06
681	002929	润建股份	1,000	39,810.00	0.06
682	688639	华恒生物	1,218	39,682.44	0.06
683	600597	光明乳业	4,900	39,641.00	0.06
684	300633	开立医疗	1,500	39,630.00	0.06
685	600649	城投控股	8,900	39,605.00	0.06
686	600017	日照港	13,200	39,600.00	0.06
687	002668	TCL 智家	3,800	39,444.00	0.06
688	688717	艾罗能源	640	39,424.00	0.06
689	002761	浙江建投	4,600	39,422.00	0.06
690	600586	金晶科技	7,000	39,410.00	0.06
691	002458	益生股份	4,700	39,386.00	0.06
692	301297	富乐德	1,100	39,380.00	0.06
693	300783	三只松鼠	1,700	39,355.00	0.06
694	300298	三诺生物	2,300	39,353.00	0.06
695	300257	开山股份	2,800	39,340.00	0.06
696	002993	奥海科技	900	39,339.00	0.06
697	688190	云路股份	403	39,252.20	0.06
698	600729	重庆百货	1,500	39,000.00	0.06
699	002867	周大生	3,200	38,976.00	0.06
700	002925	盈趣科技	2,300	38,962.00	0.06
701	603508	思维列控	1,400	38,948.00	0.06
702	301600	慧翰股份	300	38,943.00	0.06
703	301392	汇成真空	300	38,712.00	0.06
704	002081	金螳螂	11,300	38,646.00	0.06
705	002351	漫步者	3,200	38,592.00	0.06
706	002534	西子洁能	2,300	38,571.00	0.06
707	002511	中顺洁柔	4,500	38,520.00	0.06
708	301091	深城交	1,440	38,505.60	0.06
709	688549	中巨芯	4,211	38,404.32	0.06
710	603328	依顿电子	3,500	38,360.00	0.06
711	688150	莱特光电	1,414	38,220.42	0.06
712	600757	长江传媒	4,300	38,184.00	0.06
713	000930	中粮科技	6,600	38,082.00	0.06

714	300463	迈克生物	3,400	38,046.00	0.06
715	002960	青鸟消防	3,616	38,004.16	0.06
716	601200	上海环境	4,720	37,996.00	0.06
717	603118	共进股份	3,300	37,950.00	0.06
718	301061	匠心家居	400	37,920.00	0.06
719	002061	浙江交科	9,520	37,889.60	0.06
720	002194	武汉凡谷	2,900	37,845.00	0.06
721	600575	淮河能源	11,100	37,740.00	0.06
722	002777	久远银海	2,100	37,674.00	0.06
723	605599	菜百股份	2,300	37,651.00	0.06
724	002038	双鹭药业	5,100	37,587.00	0.06
725	002158	汉钟精机	1,500	37,545.00	0.06
726	300119	瑞普生物	2,000	37,540.00	0.06
727	603227	雪峰科技	4,500	37,440.00	0.06
728	688739	成大生物	1,453	37,429.28	0.06
729	600248	陕建股份	10,600	37,418.00	0.06
730	000848	承德露露	4,400	37,400.00	0.06
731	002110	三钢闽光	8,500	37,315.00	0.06
732	688380	中微半导	1,160	37,294.00	0.06
733	301626	苏州天脉	200	37,260.00	0.06
733	600664	哈药股份	10,800	37,260.00	0.06
734	600305	恒顺醋业	4,700	37,224.00	0.06
735	601595	上海电影	1,300	37,219.00	0.06
736	600123	兰花科创	6,290	37,173.90	0.06
737	002125	湘潭电化	2,600	36,816.00	0.06
738	688522	纳睿雷达	922	36,815.46	0.06
739	000767	晋控电力	13,000	36,400.00	0.06
740	000059	华锦股份	6,800	36,380.00	0.06
741	603733	仙鹤股份	1,500	36,255.00	0.05
742	001337	四川黄金	1,300	36,218.00	0.05
743	603477	巨星农牧	2,100	36,141.00	0.05
744	600075	新疆天业	7,300	36,135.00	0.05
745	000950	重药控股	6,200	36,084.00	0.05
746	002498	汉缆股份	9,400	36,002.00	0.05
747	002832	比音勒芬	2,400	35,904.00	0.05
748	603888	新华网	1,840	35,751.20	0.05
749	600058	五矿发展	3,100	35,712.00	0.05
750	002077	大港股份	2,400	35,688.00	0.05
751	601326	秦港股份	10,200	35,598.00	0.05
752	600612	老凤祥	800	35,576.00	0.05
753	600012	皖通高速	2,400	35,568.00	0.05
753	601952	苏垦农发	3,900	35,568.00	0.05
754	000913	钱江摩托	2,300	35,466.00	0.05

755	600395	盘江股份	7,600	35,416.00	0.05
756	000028	国药一致	1,440	35,366.40	0.05
757	000552	甘肃能化	15,300	35,343.00	0.05
758	600292	电投水电	2,700	35,235.00	0.05
759	600963	岳阳林纸	7,500	35,025.00	0.05
760	600928	西安银行	9,400	34,780.00	0.05
761	600675	中华企业	12,800	34,688.00	0.05
762	300151	昌红科技	2,300	34,684.00	0.05
763	002516	旷达科技	5,200	34,268.00	0.05
764	600740	山西焦化	9,100	34,216.00	0.05
765	002913	奥士康	800	34,192.00	0.05
766	300492	华图山鼎	460	34,178.00	0.05
767	603128	华贸物流	5,600	34,160.00	0.05
768	000756	新华制药	2,200	33,902.00	0.05
769	600557	康缘药业	2,400	33,864.00	0.05
770	000813	德展健康	8,800	33,792.00	0.05
771	300134	大富科技	2,700	33,750.00	0.05
772	600167	联美控股	4,800	33,744.00	0.05
773	600812	华北制药	6,100	33,733.00	0.05
774	300913	兆龙互连	640	33,683.20	0.05
775	601900	南方传媒	2,500	33,525.00	0.05
776	603713	密尔克卫	600	33,462.00	0.05
777	600217	中再资环	8,200	33,456.00	0.05
778	002946	新乳业	1,800	33,354.00	0.05
778	300768	迪普科技	1,800	33,354.00	0.05
779	603915	国茂股份	1,800	33,138.00	0.05
780	688575	亚辉龙	2,331	33,100.20	0.05
781	002978	安宁股份	1,000	33,050.00	0.05
782	688432	有研硅	2,656	32,960.96	0.05
783	300705	九典制药	2,200	32,956.00	0.05
784	601163	三角轮胎	2,300	32,867.00	0.05
785	002705	新宝股份	2,300	32,798.00	0.05
786	601500	通用股份	6,800	32,776.00	0.05
787	002605	姚记科技	1,400	32,620.00	0.05
788	688032	禾迈股份	320	32,252.80	0.05
789	603638	艾迪精密	1,700	32,181.00	0.05
790	002727	一心堂	2,500	32,150.00	0.05
791	001914	招商积余	3,000	32,040.00	0.05
792	002635	安洁科技	2,300	31,878.00	0.05
793	300641	正丹股份	1,800	31,770.00	0.05
794	002051	中工国际	3,500	31,745.00	0.05
795	000048	京基智农	1,800	31,680.00	0.05
796	603099	长白山	700	31,605.00	0.05

797	300080	易成新能	6,500	31,590.00	0.05
798	601096	宏盛华源	7,600	31,540.00	0.05
799	603033	三维股份	2,893	31,273.33	0.05
800	301087	可孚医疗	700	31,269.00	0.05
801	600975	新五丰	5,300	31,217.00	0.05
802	000828	东莞控股	2,900	31,204.00	0.05
803	002755	奥赛康	1,900	31,027.00	0.05
804	002737	葵花药业	2,100	31,017.00	0.05
805	600643	爱建集团	5,600	30,968.00	0.05
806	002563	森马服饰	5,700	30,894.00	0.05
807	000557	西部创业	6,200	30,876.00	0.05
808	301175	中科环保	5,200	30,732.00	0.05
809	002612	朗姿股份	1,500	30,660.00	0.05
810	002399	海普瑞	2,600	30,654.00	0.05
811	603919	金徽酒	1,500	30,630.00	0.05
812	301238	瑞泰新材	1,500	30,600.00	0.05
813	301267	华夏眼科	1,700	30,566.00	0.05
814	300809	华辰装备	800	30,456.00	0.05
815	301363	美好医疗	1,260	30,303.00	0.05
816	300579	数字认证	900	30,249.00	0.05
817	603056	德邦股份	2,200	30,074.00	0.05
818	601101	昊华能源	4,200	30,072.00	0.05
819	688586	江航装备	2,275	29,666.00	0.04
820	603013	亚普股份	1,200	29,604.00	0.04
821	300926	博俊科技	900	29,502.00	0.04
822	002489	浙江永强	7,700	29,491.00	0.04
823	300341	麦克奥迪	1,800	29,412.00	0.04
824	301606	绿联科技	500	29,370.00	0.04
825	600861	北京人力	1,600	29,344.00	0.04
826	600163	中闽能源	5,400	29,268.00	0.04
827	603229	奥翔药业	2,944	29,204.48	0.04
828	002697	红旗连锁	4,900	29,106.00	0.04
829	600197	伊力特	2,100	29,064.00	0.04
830	300861	美畅股份	1,940	28,964.20	0.04
831	600640	国脉文化	2,300	28,888.00	0.04
832	002060	广东建工	8,000	28,800.00	0.04
833	603317	天味食品	2,300	28,796.00	0.04
834	300820	英杰电气	600	28,770.00	0.04
835	688584	上海合晶	1,311	28,763.34	0.04
836	600894	广日股份	3,100	28,675.00	0.04
837	688185	康希诺	455	28,596.75	0.04
838	003006	百亚股份	1,300	28,392.00	0.04
839	601033	永兴股份	1,875	28,368.75	0.04

840	301015	百洋医药	1,200	28,320.00	0.04
841	002216	三全食品	2,500	28,225.00	0.04
842	002068	黑猫股份	3,200	28,224.00	0.04
843	603043	广州酒家	1,600	28,208.00	0.04
844	603383	顶点软件	780	28,165.80	0.04
845	601107	四川成渝	4,600	27,968.00	0.04
846	688128	中国电研	959	27,887.72	0.04
847	601801	皖新传媒	4,200	27,636.00	0.04
848	603202	天有为	300	27,543.00	0.04
849	003012	东鹏控股	4,200	27,510.00	0.04
850	301522	上大股份	700	27,419.00	0.04
851	603025	大豪科技	1,520	27,299.20	0.04
852	300127	银河磁体	900	27,297.00	0.04
853	603093	南华期货	1,400	27,286.00	0.04
854	002882	金龙羽	900	27,144.00	0.04
855	002101	广东鸿图	2,200	27,104.00	0.04
856	605555	德昌股份	1,480	27,084.00	0.04
857	301047	义翘神州	400	27,040.00	0.04
858	002651	利君股份	2,300	26,887.00	0.04
859	605333	沪光股份	900	26,847.00	0.04
860	600020	中原高速	6,300	26,838.00	0.04
861	603730	岱美股份	3,059	26,796.84	0.04
862	688107	安路科技	983	26,717.94	0.04
863	600335	国机汽车	4,100	26,691.00	0.04
864	000498	山东路桥	4,400	26,532.00	0.04
865	301327	华宝新能	460	26,528.20	0.04
866	600223	福瑞达	3,600	26,496.00	0.04
867	601949	中国出版	4,100	26,445.00	0.04
868	002390	信邦制药	8,200	26,404.00	0.04
869	600971	恒源煤电	4,200	26,208.00	0.04
870	000567	海德股份	4,081	26,200.02	0.04
871	000597	东北制药	5,000	26,100.00	0.04
872	600810	神马股份	2,900	26,071.00	0.04
873	000550	江铃汽车	1,400	26,040.00	0.04
874	688252	天德钰	1,228	25,996.76	0.04
875	600929	雪天盐业	4,600	25,990.00	0.04
876	600997	开滦股份	4,500	25,875.00	0.04
877	000719	中原传媒	2,200	25,872.00	0.04
878	001339	智微智能	500	25,555.00	0.04
879	002791	坚朗五金	1,200	25,452.00	0.04
880	603355	莱克电气	800	25,384.00	0.04
881	301551	无线传媒	800	25,240.00	0.04
882	301153	中科江南	1,000	24,720.00	0.04

883	600508	上海能源	2,100	24,717.00	0.04
884	600639	浦东金桥	2,400	24,648.00	0.04
884	603530	神马电力	600	24,648.00	0.04
885	301592	六九一二	200	24,440.00	0.04
886	301207	华兰疫苗	1,300	24,219.00	0.04
887	603866	桃李面包	4,600	24,196.00	0.04
888	688209	英集芯	1,210	24,127.40	0.04
889	002267	陕天然气	3,200	24,096.00	0.04
889	600662	外服控股	4,800	24,096.00	0.04
890	601089	福元医药	1,000	24,000.00	0.04
891	603299	苏盐井神	2,300	23,966.00	0.04
892	002041	登海种业	2,500	23,850.00	0.04
893	603327	福蓉科技	2,193	23,815.98	0.04
894	300183	东软载波	1,600	23,728.00	0.04
895	301109	军信股份	1,580	23,700.00	0.04
896	688443	智翔金泰	870	23,698.80	0.04
897	002901	大博医疗	500	23,685.00	0.04
898	688552	航天南湖	652	23,680.64	0.04
899	301000	肇民科技	600	23,622.00	0.04
900	688232	新点软件	945	23,454.90	0.04
901	688348	昱能科技	464	23,380.96	0.04
902	601882	海天精工	1,200	23,352.00	0.04
903	603567	珍宝岛	2,600	23,218.00	0.04
904	603162	海通发展	1,920	23,116.80	0.04
905	600403	大有能源	3,300	23,034.00	0.03
906	002242	九阳股份	2,200	22,968.00	0.03
907	688182	灿勤科技	773	22,818.96	0.03
908	002543	万和电气	2,200	22,462.00	0.03
909	001236	弘业期货	2,100	22,260.00	0.03
910	301325	曼恩斯特	440	22,242.00	0.03
911	300406	九强生物	1,700	22,219.00	0.03
912	300702	天宇股份	940	22,184.00	0.03
913	002840	华统股份	2,300	22,126.00	0.03
914	603826	坤彩科技	1,300	22,100.00	0.03
915	688177	百奥泰	955	22,098.70	0.03
916	688001	华兴源创	731	22,061.58	0.03
917	002302	西部建设	3,600	22,032.00	0.03
918	002053	云南能投	1,900	21,888.00	0.03
919	301268	铭利达	1,200	21,876.00	0.03
920	600903	贵州燃气	3,300	21,813.00	0.03
921	688276	百克生物	1,155	21,783.30	0.03
922	301376	致欧科技	1,193	21,557.51	0.03
923	688337	普源精电	584	21,543.76	0.03

924	601038	一拖股份	1,500	21,255.00	0.03
925	000899	赣能股份	2,100	20,790.00	0.03
926	600657	信达地产	6,000	20,700.00	0.03
927	000058	深赛格	2,200	20,680.00	0.03
928	603072	天和磁材	500	20,345.00	0.03
929	000030	富奥股份	3,500	20,090.00	0.03
930	601083	锦江航运	1,800	20,088.00	0.03
931	301500	飞南资源	1,280	20,083.20	0.03
932	605116	奥锐特	800	20,040.00	0.03
933	601858	中国科传	1,100	19,965.00	0.03
934	301556	托普云农	200	19,608.00	0.03
935	300917	特发服务	500	19,550.00	0.03
936	300856	科思股份	1,440	19,411.20	0.03
937	603193	润本股份	800	19,384.00	0.03
938	301622	英思特	300	19,320.00	0.03
939	301565	中仑新材	800	19,312.00	0.03
940	000885	城发环境	1,400	19,208.00	0.03
941	301215	中汽股份	2,800	19,180.00	0.03
942	002287	奇正藏药	800	18,928.00	0.03
943	301339	通行宝	1,300	18,902.00	0.03
944	600726	华电能源	7,900	18,881.00	0.03
945	688351	微电生理	810	18,751.50	0.03
946	605009	豪悦护理	600	18,540.00	0.03
947	002275	桂林三金	1,300	18,330.00	0.03
948	601003	柳钢股份	3,600	18,108.00	0.03
949	002911	佛燃能源	1,480	17,937.60	0.03
950	603055	台华新材	1,900	17,936.00	0.03
951	600618	氯碱化工	1,500	17,820.00	0.03
952	301004	嘉益股份	340	17,697.00	0.03
953	000761	本钢板材	5,200	17,420.00	0.03
954	001356	富岭股份	1,345	17,377.40	0.03
955	000019	深粮控股	2,400	16,680.00	0.03
956	603983	丸美生物	500	16,575.00	0.03
957	600746	江苏索普	2,400	16,512.00	0.03
958	601022	宁波远洋	1,800	16,506.00	0.02
959	301381	赛维时代	800	16,472.00	0.02
960	603194	中力股份	400	15,724.00	0.02
961	603693	江苏新能	1,320	15,655.20	0.02
962	301458	钧崴电子	484	15,531.56	0.02
963	603395	红四方	500	14,615.00	0.02
964	300755	华致酒行	800	14,096.00	0.02
965	001308	康冠科技	630	13,141.80	0.02
966	003039	顺控发展	800	12,744.00	0.02

967	301508	中机认检	400	12,504.00	0.02
968	301371	敷尔佳	520	12,318.80	0.02
969	601068	中铝国际	2,300	12,167.00	0.02
970	603219	富佳股份	700	11,788.00	0.02
971	605296	神农集团	400	11,728.00	0.02
972	601811	新华文轩	800	10,736.00	0.02
973	605099	共创草坪	300	10,707.00	0.02
974	301275	汉朔科技	200	10,684.00	0.02
975	301631	壹连科技	100	10,355.00	0.02
976	605011	杭州热电	500	10,220.00	0.02
977	603057	紫燕食品	500	10,170.00	0.02
978	301262	海看股份	400	9,956.00	0.02
979	605118	力鼎光电	300	9,033.00	0.01
980	301177	迪阿股份	300	8,661.00	0.01
981	301602	超研股份	400	8,616.00	0.01
982	688726	拉普拉斯	235	8,460.00	0.01
983	603103	横店影视	500	8,290.00	0.01
984	603014	威高血净	200	7,926.00	0.01
985	605198	安德利	200	7,524.00	0.01
986	301658	首航新能	200	5,712.00	0.01
987	603262	技源集团	200	5,698.00	0.01
988	301665	泰禾股份	200	5,648.00	0.01

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002456	欧菲光	1,101,605.00	0.63
2	001309	德明利	592,981.00	0.34
3	002402	和而泰	575,535.00	0.33
4	002126	银轮股份	559,069.00	0.32
5	002405	四维图新	549,978.00	0.31
6	003021	兆威机电	516,397.00	0.29
7	300779	惠城环保	508,127.00	0.29
8	300459	汤姆猫	490,681.00	0.28
9	000766	通化金马	470,995.00	0.27
10	300253	卫宁健康	469,892.00	0.27
11	002139	拓邦股份	469,081.00	0.27
12	300170	汉得信息	464,484.00	0.26

13	002245	蔚蓝锂芯	459,470.00	0.26
14	300738	奥飞数据	451,765.00	0.26
15	002851	麦格米特	444,798.00	0.25
16	002497	雅化集团	425,872.00	0.24
17	300068	南都电源	421,092.00	0.24
18	300762	上海瀚讯	418,083.00	0.24
19	300548	长芯博创	414,048.00	0.24
20	300432	富临精工	412,986.00	0.23

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	002456	欧菲光	1,903,097.00	1.08
2	002402	和而泰	1,256,014.00	0.71
3	002126	银轮股份	1,189,349.00	0.68
4	002130	沃尔核材	983,286.00	0.56
5	002405	四维图新	957,378.00	0.54
6	002851	麦格米特	949,635.00	0.54
7	300458	全志科技	929,258.60	0.53
8	300346	南大光电	900,737.20	0.51
9	300779	惠城环保	862,217.20	0.49
10	300757	罗博特科	850,477.00	0.48
11	000766	通化金马	823,276.00	0.47
12	002139	拓邦股份	809,930.00	0.46
13	300253	卫宁健康	809,864.00	0.46
14	300170	汉得信息	807,280.00	0.46
15	002335	科华数据	807,154.00	0.46
16	300115	长盈精密	788,306.00	0.45
17	300432	富临精工	785,464.76	0.45
18	001309	德明利	781,275.00	0.44
19	003021	兆威机电	768,861.99	0.44
20	300459	汤姆猫	765,905.00	0.44

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	135,307,359.52
卖出股票收入（成交）总额	195,109,661.49

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

8.12.3 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	788,370.26
2	应收清算款	9,855.16
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	798, 225. 42

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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, 359	15, 461. 80	5, 450, 487. 00	25. 94	15, 562, 105. 00	74. 06

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	张易	1, 690, 200. 00	8. 04
2	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司一柏泰华盈常青藤套利 2 号私募证券投资基金	1, 481, 035. 00	7. 05
3	华泰证券股份有限公司	944, 541. 00	4. 50
4	中信证券股份有限公司	655, 787. 00	3. 12
5	申万宏源证券有限公司	582, 359. 00	2. 77
6	刘李明	550, 400. 00	2. 62
7	杨雪海	486, 676. 00	2. 32

8	中国国际金融股份有限公司	464,433.00	2.21
9	马佳斌	450,477.00	2.14
10	方正证券股份有限公司	443,285.00	2.11

9.3 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	0.00	0.0000

9.4 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	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

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的基金份额总量的数量区间（万份）
胡亦清	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月15日） 基金份额总额	222,602,182.00
本报告期期初基金份额总额	73,012,592.00
本报告期基金总申购份额	68,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	120,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,012,592.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

经公司董事会审议通过，田汉卿女士于 2025 年 4 月 30 日起不再担任公司副总经理。

经公司董事会审议通过，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司总经理，董事长贾波先生代为履行总经理职责。

经公司股东书面决定，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司董事。

经公司董事会审议通过，崔春女士于 2025 年 10 月 28 日起担任公司总经理，董事长贾波先生不再代任总经理职务。

经公司股东书面决定，崔春女士于 2025 年 10 月 28 日起担任公司董事。

2025 年 11 月 18 日，公司进行董事会、监事会换届选举，股东批准贾波先生、陆春光先生、Kirk Chester SWEENEY 先生、杨智雅女士、崔春女士担任公司第八届董事会董事，尹雷先生、田中荣治先生、孙茂竹先生、吴冠雄先生担任公司第八届董事会独立董事，刘晓冰先生、卢龙威先生、刘声先生、杨宇先生担任公司第八届监事会监事。李晗女士不再担任公司独立董事，赵景云女士不再担任公司监事。

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：

2025 年 2 月 20 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去蒋伟担任的托管部副总经理职务，另有任用。

2025 年 5 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘王鑫担任托管部副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

11.3 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。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期基金应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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调查或处罚。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人未受监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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 (%)	
招商证券	6	329,582,472.59	100.00	65,922.84	100.00	-
华泰证券	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，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

11.7.2 基金租用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 (%)
招商证券	128,011.40	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	2025年12月25日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范以教育机构退费为由诱导转账诈骗的公告	证监会规定报刊和网站	2025年12月09日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京微动利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	2025年12月02日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从	证监会规定报刊和网站	2025年11月20日

	事非法活动的公告		
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 11 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	2025 年 10 月 29 日
7	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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 09 月 23 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	2025 年 09 月 23 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	2025 年 09 月 05 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)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	2025 年 06 月 04 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 24 日
12	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	2025 年 05 月 14 日
13	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	2025 年 05 月 10 日
14	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	2025 年 05 月 01 日
15	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	2025 年 03 月 19 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 02 月 06 日
17	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	2025 年 01 月 24 日
18	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	2025 年 01 月 03 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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 3 月 31 日