

华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53

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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强	
基金主代码	019240	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 19 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	100,141,689.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019240	019241
报告期末下属分级基金的份额总额	70,740,664.07 份	29,401,025.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时 力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 8% 。
投资策略	1、股票投资策略 本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。 2、债券投资策略 3、资产支持证券投资策略 4、衍生品投资策略 5、存托凭证投资策略 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率 \times 95% + 人民币活期存款税后利率 \times 5% 。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 刘万方	张姗
	联系电话 021-38601777	400-61-95555
	电子邮箱 cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-0001	400-61-95555
传真	021-38601799	0755-83195201
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄 证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄	深圳市深南大道 7088 号招商银

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	3,180,457.95	1,516,032.61
本期利润	8,780,238.16	3,842,901.36
加权平均基金份额本期利润	0.1230	0.1130
本期加权平均净值利润率	11.30%	10.45%
本期基金份额净值增长率	10.25%	10.02%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	11,131,109.62	4,384,477.63
期末可供分配基金份额利润	0.1574	0.1491
期末基金资产净值	81,871,773.69	33,785,503.49

期末基金份额净值	1.1574	1.1491
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	15.74%	14.91%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.25%	0.87%	5.20%	0.89%	0.05%	-0.02%
过去三个月	4.31%	1.71%	2.03%	1.73%	2.28%	-0.02%
过去六个月	10.25%	1.52%	6.44%	1.56%	3.81%	-0.04%
过去一年	40.00%	1.81%	28.45%	1.87%	11.55%	-0.06%
自基金合同生效起至今	15.74%	1.71%	4.65%	1.76%	11.09%	-0.05%

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.20%	0.87%	5.20%	0.89%	0.00%	-0.02%
过去三个月	4.20%	1.71%	2.03%	1.73%	2.17%	-0.02%
过去六个月	10.02%	1.51%	6.44%	1.56%	3.58%	-0.05%
过去一年	39.44%	1.81%	28.45%	1.87%	10.99%	-0.06%
自基金合同	14.91%	1.71%	4.65%	1.76%	10.26%	-0.05%

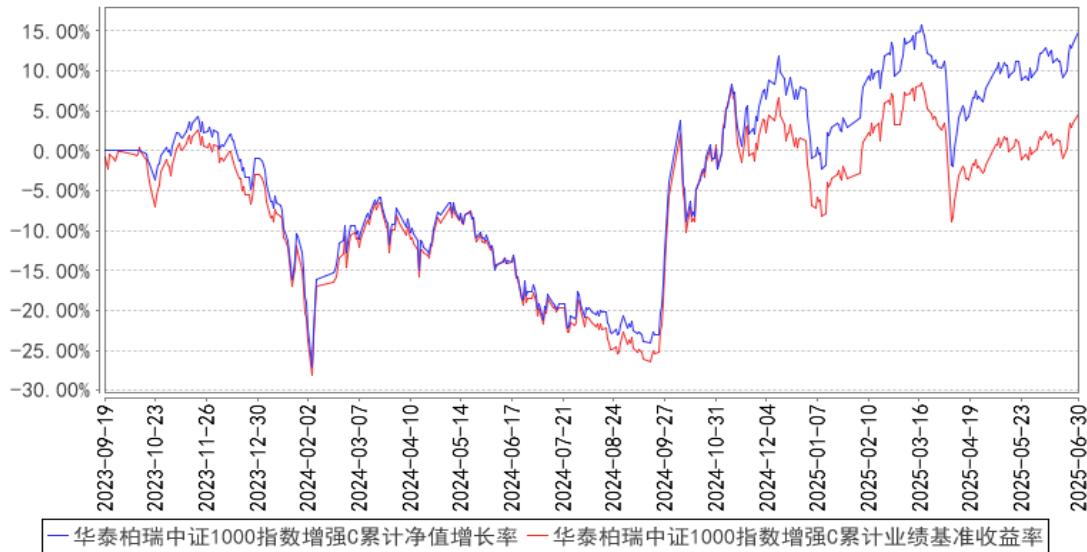
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

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



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



注：A 类图示日期为 2023 年 9 月 19 日至 2025 年 06 月 30 日。C 类图示日期为 2023 年 9 月 19 日至 2025 年 06 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、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）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 6 月 30 日，公司旗下管理 179 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
笪笪	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 19 日	-	11 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和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。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 次，都为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

2025 年上半年，A 股持续反弹后受到关税冲击，快速下跌后持续上涨并创年内新高，市场情绪从谨慎转向积极，主题温和轮动，前期强势的 AI、机器人等板块低位震荡，小微盘风格和军工、创新药、内需消费等板块相对较强，临近季末市场显著回暖，并开始关注基本面改善和进一步的政策变动。海外方面，贸易冲突与地缘政治风险阶段性缓和，但对市场的潜在冲击预计将长期存在，跨境资金流动仍然活跃，宏观不确定性持续存在。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别上涨 1.01%和 0.03%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别上涨 0.53%和 1.46%；中小市值指数中证 1000 和中证 2000 同期涨幅分别为 6.69%和 15.24%。横向比较来看，科创板强于创业板，中小市值表现优于大盘。

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，结合对市场的研判，采取比较

稳健的投资策略，股票仓位保持在较高水平，超额收益受仓位影响相对较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1574 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.25%，同期业绩比较基准收益率为 6.44%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1491 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.02%，同期业绩比较基准收益率为 6.44%。

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，一系列增量政策的落地仍然值得期待，基本面的改善逐步显现。中央政治局会议表态发布，提出中国将实施“适度宽松”的货币政策，2011 年以来首次改变货币政策立场。上半年国内经济增长已经超出全年目标水平，地缘政治冲突、贸易冲突等风险阶段性出清，深化改革政策预期加强。

我们认为市场情绪和预期将随着进一步的改革政策转向谨慎乐观，在股票市场整体估值处在合理区间的前提下，市场后续有望进入更加理性的上升区间。虽然贸易冲突、地缘政治等风险因素可能将长期存在，但我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力，相信新质生产力的长期优势。在不出现极端情况的前提下，我们对未来几个季度的 A 股股票市场持谨慎乐观的态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，在经历短期剧烈的反弹后，市场将会重新回到轮动的行情，绩优和有主题热度的股票更容易受到资金的关注，有利于技术面因子通过捕捉资金流特征，获取超额。另一方面，基本面因子挑选出绩优低估，且具有不错成长性的股票，增加模型的稳定性。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值仍有吸引力，经济基本面向好。我们在坚持控制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,604,813.13	12,208,738.81
结算备付金		2,125,328.49	426,646.47
存出保证金		603,782.40	571,756.80
交易性金融资产	6.4.7.2	104,262,905.89	123,381,633.19
其中：股票投资		104,262,905.89	123,381,633.19

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,336,912.93	377,053.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		117,933,742.84	136,965,828.48
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,101,275.81	538,298.60
应付管理人报酬		73,370.30	99,502.79
应付托管费		18,342.59	24,875.69
应付销售服务费		11,375.77	15,731.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	72,101.19	155,041.47
负债合计		2,276,465.66	833,450.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	100,141,689.93	129,892,296.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	15,515,587.25	6,240,082.08
净资产合计		115,657,277.18	136,132,378.43
负债和净资产总计		117,933,742.84	136,965,828.48

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 100,141,689.93 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1574 元，基金份额总额 70,740,664.07 份；下属 C 类基金份额净值 1.1491 元，基金份额总额 29,401,025.86 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业收入		13,342,299.41	-43,333,758.79
1. 利息收入		16,556.08	27,295.83
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	16,556.08	27,295.83
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）		5,162,128.60	-41,047,722.58
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	4,153,015.66	-42,693,896.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	-	-
资产支持证券投 资收益	6. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	151,637.53	79,360.36
股利收益	6. 4. 7. 19	857,475.41	1,566,813.71
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	7,926,648.96	-2,468,131.40
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	236,965.77	154,799.36
减：二、营业总支出		719,159.89	1,379,198.86

1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	456, 461. 21	921, 068. 20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	114, 115. 23	230, 267. 06
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	73, 298. 72	138, 919. 18
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		784. 73	1, 408. 40
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	74, 500. 00	87, 536. 02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12, 623, 139. 52	-44, 712, 957. 65
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12, 623, 139. 52	-44, 712, 957. 65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12, 623, 139. 52	-44, 712, 957. 65

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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
一、上期期末净资产	129, 892, 296. 35	-	6, 240, 082. 08	136, 132, 378. 43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	129, 892, 296. 35	-	6, 240, 082. 08	136, 132, 378. 43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-29, 750, 606. 42	-	9, 275, 505. 17	-20, 475, 101. 25
(一)、综合收益总额	-	-	12, 623, 139. 52	12, 623, 139. 52
(二)、本期基金份额交易产生的	-29, 750, 606. 42	-	-3, 347, 634. 35	-33, 098, 240. 77

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	75,091,779.69	-	7,187,262.95	82,279,042.64
2. 基金赎 回款	- 104,842,386.11	-	-10,534,897.30	-115,377,283.41
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	100,141,689.93	-	15,515,587.25	115,657,277.18
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	286,646,006.76	-	-2,568,861.13	284,077,145.63
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	286,646,006.76	-	-2,568,861.13	284,077,145.63
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-48,458,569.27	-	-38,896,500.73	-87,355,070.00
(一)、综合收益 总额	-	-	-44,712,957.65	-44,712,957.65
(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)	-48,458,569.27	-	5,816,456.92	-42,642,112.35
其中：1. 基金申 购款	27,771,515.74	-	-2,770,168.05	25,001,347.69

2. 基金赎回 回款	-76,230,085.01	-	8,586,624.97	-67,643,460.04
(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	238,187,437.49	-	-41,465,361.86	196,722,075.63

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：

贾波

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 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1780 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 347,748,610.52 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0486 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 347,898,709.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 150,099.06 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时

不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)、货币市场工具(含同业存单)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产的投资比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于非现金资产基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95% + 人民币活期存款税后利率 \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2025 年 8 月 29 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[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、非货币期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	9,604,813.13
等于：本金	9,604,241.61
加：应计利息	571.52
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		9,604,813.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	102,060,072.82	-	104,262,905.89	2,202,833.07
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	102,060,072.82	-	104,262,905.89	2,202,833.07

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 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	4,806,080.00	-	-	
其中： 股指期货 投资	4,806,080.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	4,806,080.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2507	中证 1000 股指期货 2507	4.00	5,031,520.00	225,440.00
合计				225,440.00
减: 可抵销期货暂收款				225,440.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注: 本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注: 本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注: 本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注: 无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注: 本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注: 本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注: 本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注: 本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注: 本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	197.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	71,904.06
合计	72,101.19

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,382,327.60	88,382,327.60
本期申购	59,603,358.49	59,603,358.49
本期赎回（以“-”号填列）	-77,245,022.02	-77,245,022.02
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	70,740,664.07	70,740,664.07

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	41,509,968.75	41,509,968.75
本期申购	15,488,421.20	15,488,421.20
本期赎回（以“-”号填列）	-27,597,364.09	-27,597,364.09
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	29,401,025.86	29,401,025.86

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,698,147.65	-7,299,968.16	4,398,179.49
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,698,147.65	-7,299,968.16	4,398,179.49
本期利润	3,180,457.95	5,599,780.21	8,780,238.16
本期基金份额交易产生的变动数	-1,787,621.21	-259,686.82	-2,047,308.03
其中：基金申购款	9,555,591.44	-3,701,335.32	5,854,256.12
基金赎回款	-11,343,212.65	3,441,648.50	-7,901,564.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,090,984.39	-1,959,874.77	11,131,109.62

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,253,289.68	-3,411,387.09	1,841,902.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,253,289.68	-3,411,387.09	1,841,902.59
本期利润	1,516,032.61	2,326,868.75	3,842,901.36
本期基金份额交易产生的变动数	-1,572,295.87	271,969.55	-1,300,326.32
其中：基金申购款	2,313,080.94	-980,074.11	1,333,006.83
基金赎回款	-3,885,376.81	1,252,043.66	-2,633,333.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,197,026.42	-812,548.79	4,384,477.63

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,145.41
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	6,410.67
其他	-
合计	16,556.08

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,153,015.66
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,153,015.66

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	469,197,832.95
减：卖出股票成本总额	464,583,305.13
减：交易费用	461,512.16
买卖股票差价收入	4,153,015.66

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	151,637.53

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	857,475.41

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	857,475.41

6.4.7.20 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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,360,528.96
股票投资	7,360,528.96
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	566,120.00
权证投资	-
期货投资	566,120.00
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	7,926,648.96

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	236,732.59
基金转换费收入	233.18
合计	236,965.77

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类基金份额不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。C 类基金份额的赎回费全额计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,595.94
合计	74,500.00

6.4.7.24 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，不需要进行分部报告的披露。

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 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	456,461.21	921,068.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	180,301.84	364,798.10
应支付基金管理人的净管理费	276,159.37	556,270.10

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80 % 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80 % / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	114,115.23	230,267.06

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20 % 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20 % / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	合计
招商银行股份有限公司	-	36,304.92	36,304.92
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	100.56	100.56
合计	-	36,405.48	36,405.48
上年度可比期间			
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	合计
招商银行股份有限公司	-	66,977.04	66,977.04
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	326.94	326.94
合计	-	67,303.98	67,303.98

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	3,454,656.54	6,574.00	3,257,961.17	3,552.45

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	301458	钧崴电子	网下申购	4,203	43,711.20
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	688709	成都华微	网下申购	4,562	71,577.78
华泰联合证券有限责任公司	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券有限责任公司	603341	龙旗科技	网下申购	1,296	33,696.00
华泰联合证券有限责任公司	603312	西典新能	网下申购	1,010	29,310.20
华泰联合证券有限责任公司	301587	中瑞股份	网下申购	2,934	63,755.82

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（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	5.30	14.44	358	1,897.40	5,169.52	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	7.40	20.21	240	1,776.00	4,850.40	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	28.33	44.98	115	3,257.95	5,172.70	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	27.50	56.19	106	2,915.00	5,956.14	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	10.40	34.11	421	4,378.40	14,360.31	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	41.90	77.87	94	2,807.30	7,319.78	-
301501	恒鑫	2025 年 3	6 个月	新股锁定	39.92	45.22	99	2,714.56	4,476.78	-

	生活	月 11 日		期内						
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	4.92	18.99	584	2,873.28	11,090.16	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	11.80	33.85	339	4,000.20	11,475.15	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	6.70	24.80	536	3,591.20	13,292.80	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月以上	新股锁定期内	12.30	54.45	118	1,451.40	6,425.10	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6	重大事项	38.05	2025 年 7	39.98	9,000	233,947.74	342,450.00	-

		月 30 日	停牌		月 11 日				
--	--	-----------	----	--	-----------	--	--	--	--

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现超越标的指数的投资收益，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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

度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2025 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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 06 月 30 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。

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 2025 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	9,604,813.13	-	-	-	-	-	9,604,813.13
结算备付金	2,125,328.49	-	-	-	-	-	2,125,328.49
存出保证金	-	-	-	-	-	603,782.40	603,782.40
交易性金融资	-	-	-	-	-	104,262,90	104,262,905.

资产						5.89	89
应收申购款	-	-	-	-	-	1,336,912.93	1,336,912.93
资产总计	11,730,141.62	-	-	-	-	106,203,601.22	117,933,742.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,101,275.81	2,101,275.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,370.30	73,370.30
应付托管费	-	-	-	-	-	18,342.59	18,342.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,375.77	11,375.77
其他负债	-	-	-	-	-	72,101.19	72,101.19
负债总计	-	-	-	-	-	2,276,465.66	2,276,465.66
利率敏感度缺口	11,730,141.62	-	-	-	-	103,927,135.56	115,657,277.18
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	12,208,738.81	-	-	-	-	-	12,208,738.81
结算备付金	426,646.47	-	-	-	-	-	426,646.47
存出保证金	571,756.80	-	-	-	-	-	571,756.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	123,381,633.19	123,381,633.19
应收申购款	-	-	-	-	-	377,053.21	377,053.21
资产总计	13,207,142.08	-	-	-	-	123,758,686.40	136,965,828.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	538,298.60	538,298.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	99,502.79	99,502.79
应付托管费	-	-	-	-	-	24,875.69	24,875.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,731.50	15,731.50
其他负债	-	-	-	-	-	155,041.47	155,041.47
负债总计	-	-	-	-	-	833,450.05	833,450.05
利率敏感度缺口	13,207,142.08	-	-	-	-	122,925,236.35	136,132,378.43

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 2025 年 06 月 30 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)。

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 2025 年 6 月 30 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	104,262,905.89	90.15	123,381,633.19	90.63
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	104,262,905.89	90.15	123,381,633.19	90.63

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 (2025 年 6 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	5,240,576.28	6,251,277.10
	业绩比较基准下降 5%	-5,240,576.28	-6,251,277.10

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	103,827,087.05	122,893,609.78
第二层次	342,450.00	14,415.60
第三层次	93,368.84	473,607.81
合计	104,262,905.89	123,381,633.19

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 2025 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(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	104,262,905.89	88.41
	其中：股票	104,262,905.89	88.41
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	11,730,141.62	9.95
8	其他各项资产	1,940,695.33	1.65
9	合计	117,933,742.84	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

A	农、林、牧、渔业	1,643,624.00	1.42
B	采矿业	1,616,102.00	1.40
C	制造业	67,456,970.16	58.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,249,492.00	1.94
E	建筑业	844,544.00	0.73
F	批发和零售业	4,289,795.00	3.71
G	交通运输、仓储和邮政业	1,530,107.00	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,761,880.58	11.03
J	金融业	3,380,176.00	2.92
K	房地产业	2,222,419.00	1.92
L	租赁和商务服务业	479,476.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	2,382,353.15	2.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,998,160.00	1.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,407,807.00	1.22
S	综合	-	-
	合计	104,262,905.89	90.15

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000657	中钨高新	94,700	1,123,142.00	0.97
2	300363	博腾股份	54,100	924,028.00	0.80
3	002378	章源钨业	116,600	922,306.00	0.80
4	002258	利尔化学	81,900	904,176.00	0.78
5	603477	巨星农牧	43,300	891,114.00	0.77
6	002487	大金重工	26,400	868,560.00	0.75
7	600550	保变电气	97,600	839,360.00	0.73
8	603337	杰克股份	23,100	828,828.00	0.72
9	300548	长芯博创	12,400	827,948.00	0.72
10	603881	数据港	32,380	827,309.00	0.72
11	300702	天宇股份	35,300	821,078.00	0.71
12	300777	中简科技	22,200	804,750.00	0.70
13	601519	大智慧	77,000	784,630.00	0.68

14	300119	瑞普生物	40,400	784,568.00	0.68
15	300502	新易盛	6,160	782,443.20	0.68
16	002315	焦点科技	16,700	763,023.00	0.66
17	000756	新华制药	50,900	759,428.00	0.66
18	603766	隆鑫通用	59,300	756,668.00	0.65
19	002245	蔚蓝锂芯	56,600	726,178.00	0.63
20	603083	剑桥科技	15,300	723,690.00	0.63
21	000672	上峰水泥	91,400	722,060.00	0.62
22	002967	广电计量	40,400	710,636.00	0.61
23	002727	一心堂	43,100	704,254.00	0.61
24	002249	大洋电机	106,000	697,480.00	0.60
25	688403	汇成股份	66,400	689,896.00	0.60
26	300598	诚迈科技	16,000	680,800.00	0.59
27	600059	吉越龙山	59,600	650,236.00	0.56
28	600323	瀚蓝环境	26,600	647,710.00	0.56
29	000603	盛达资源	43,400	646,226.00	0.56
30	000420	吉林化纤	165,600	645,840.00	0.56
31	300570	太辰光	6,700	645,746.00	0.56
32	300738	奥飞数据	30,700	642,551.00	0.56
33	300446	航天智造	36,600	633,912.00	0.55
34	002096	易普力	50,100	621,741.00	0.54
35	002174	游族网络	50,000	606,500.00	0.52
36	002006	精工科技	36,700	602,981.00	0.52
37	600216	浙江医药	40,500	598,995.00	0.52
38	301061	匠心家居	7,600	589,304.00	0.51
39	688131	皓元医药	12,000	580,200.00	0.50
40	002215	诺普信	55,800	576,414.00	0.50
41	300470	中密控股	15,600	573,612.00	0.50
42	300261	雅本化学	79,900	571,285.00	0.49
43	300009	安科生物	67,300	563,301.00	0.49
44	001914	招商积余	45,000	556,650.00	0.48
45	301297	富乐德	13,400	553,822.00	0.48
46	600641	万业企业	39,700	551,036.00	0.48
47	600552	凯盛科技	47,200	533,360.00	0.46
48	300134	大富科技	43,600	533,228.00	0.46
49	688183	生益电子	10,400	532,480.00	0.46
50	000719	中原传媒	42,600	528,666.00	0.46
51	002588	史丹利	59,400	523,314.00	0.45
52	300762	上海瀚讯	23,100	522,753.00	0.45
53	300972	万辰集团	2,900	522,696.00	0.45
54	603013	亚普股份	29,000	501,120.00	0.43
55	002690	美亚光电	29,700	501,039.00	0.43
56	002048	宁波华翔	27,100	498,911.00	0.43

57	600602	云赛智联	24,600	496,182.00	0.43
58	605296	神农集团	15,800	485,692.00	0.42
59	605507	国邦医药	24,400	482,388.00	0.42
60	300432	富临精工	36,600	478,362.00	0.41
61	688270	臻镭科技	10,200	474,912.00	0.41
62	688200	华峰测控	3,289	474,273.80	0.41
63	301606	绿联科技	9,200	473,156.00	0.41
64	300602	飞荣达	22,300	472,983.00	0.41
65	002326	永太科技	36,500	469,755.00	0.41
66	688088	虹软科技	9,700	468,025.00	0.40
67	002761	浙江建投	52,500	465,675.00	0.40
68	600064	南京高科	60,300	464,913.00	0.40
69	001203	大中矿业	49,000	463,050.00	0.40
70	688018	乐鑫科技	3,160	461,676.00	0.40
71	603693	江苏新能	33,800	455,624.00	0.39
72	600882	妙可蓝多	14,700	448,791.00	0.39
73	300687	赛意信息	16,100	447,258.00	0.39
74	300257	开山股份	44,100	444,087.00	0.38
75	600490	鹏欣资源	100,900	442,951.00	0.38
76	300113	顺网科技	22,000	434,720.00	0.38
77	300133	华策影视	57,700	433,327.00	0.37
78	000156	华数传媒	54,500	432,730.00	0.37
79	300184	力源信息	44,000	432,080.00	0.37
80	688536	思瑞浦	3,100	430,032.00	0.37
81	002891	中宠股份	6,900	426,903.00	0.37
82	300641	正丹股份	18,700	426,173.00	0.37
83	002019	亿帆医药	32,800	426,072.00	0.37
84	600908	无锡银行	66,700	420,877.00	0.36
85	300824	北鼎股份	34,700	413,971.00	0.36
86	300181	佐力药业	23,800	412,454.00	0.36
87	300643	万通智控	19,200	410,496.00	0.35
88	301155	海力风电	5,700	409,830.00	0.35
89	600770	综艺股份	77,200	409,160.00	0.35
90	002985	北摩高科	13,400	405,350.00	0.35
91	300083	创世纪	48,800	401,136.00	0.35
92	603888	新华网	16,600	397,404.00	0.34
93	300624	万兴科技	6,400	397,120.00	0.34
94	001287	中电港	21,500	393,665.00	0.34
95	688185	康希诺	6,600	393,558.00	0.34
96	000099	中信海直	17,900	389,862.00	0.34
97	300401	花园生物	25,600	389,376.00	0.34
98	300236	上海新阳	9,900	384,120.00	0.33
99	601033	永兴股份	24,100	381,021.00	0.33

100	688484	南芯科技	9,600	379,680.00	0.33
101	002901	大博医疗	10,400	376,896.00	0.33
102	301078	孩子王	28,700	375,109.00	0.32
103	002204	大连重工	62,600	373,722.00	0.32
104	600006	东风股份	51,000	368,730.00	0.32
105	002518	科士达	16,000	361,440.00	0.31
106	000885	城发环境	27,100	360,972.00	0.31
107	600874	创业环保	59,700	356,409.00	0.31
108	002701	奥瑞金	59,900	356,405.00	0.31
109	300166	东方国信	32,500	354,250.00	0.31
110	688322	奥比中光	6,000	354,060.00	0.31
111	601595	上海电影	11,600	343,824.00	0.30
112	000988	华工科技	7,300	343,173.00	0.30
113	688313	仕佳光子	9,000	342,450.00	0.30
114	002434	万里扬	45,900	336,447.00	0.29
115	301076	新瀚新材	9,600	333,888.00	0.29
116	002139	拓邦股份	24,000	331,440.00	0.29
117	600389	江山股份	17,700	329,220.00	0.28
118	300303	聚飞光电	51,900	329,046.00	0.28
119	000600	建投能源	47,500	328,225.00	0.28
120	600750	江中药业	15,000	327,450.00	0.28
121	601187	厦门银行	48,200	327,278.00	0.28
122	603236	移远通信	3,800	326,040.00	0.28
123	000061	农产品	50,700	323,973.00	0.28
124	688327	云从科技	23,200	319,928.00	0.28
125	600114	东睦股份	15,700	319,338.00	0.28
126	001367	海森药业	14,600	318,426.00	0.28
127	002222	福晶科技	9,100	311,220.00	0.27
128	688019	安集科技	2,048	310,886.40	0.27
129	002803	吉宏股份	21,700	309,442.00	0.27
130	000935	四川双马	16,900	307,918.00	0.27
131	000030	富奥股份	52,100	306,869.00	0.27
132	603985	恒润股份	19,600	305,368.00	0.26
133	002368	太极股份	12,900	302,118.00	0.26
134	300348	长亮科技	17,100	297,369.00	0.26
135	601107	四川成渝	49,100	295,582.00	0.26
136	000962	东方钽业	18,000	295,380.00	0.26
137	601963	重庆银行	26,600	288,876.00	0.25
138	002881	美格智能	6,200	287,680.00	0.25
139	600718	东软集团	29,200	284,700.00	0.25
140	002755	奥赛康	17,400	278,052.00	0.24
141	300953	震裕科技	2,740	277,699.00	0.24
142	600577	精达股份	37,300	277,512.00	0.24

143	002298	中电鑫龙	40,500	274,995.00	0.24
144	000686	东北证券	35,800	273,154.00	0.24
145	601083	锦江航运	24,500	272,195.00	0.24
146	600649	城投控股	63,400	271,986.00	0.24
147	688630	芯碁微装	3,405	270,254.85	0.23
148	300493	润欣科技	12,700	270,129.00	0.23
149	300994	久祺股份	17,200	269,008.00	0.23
150	300224	正海磁材	18,900	267,435.00	0.23
151	002099	海翔药业	48,600	267,300.00	0.23
152	300761	立华股份	14,200	266,818.00	0.23
153	300443	金雷股份	11,700	264,420.00	0.23
154	600055	万东医疗	15,300	264,384.00	0.23
155	301316	慧博云通	6,100	262,788.00	0.23
156	603636	南威软件	20,500	259,120.00	0.22
157	002317	众生药业	17,200	258,172.00	0.22
158	002948	青岛银行	51,500	256,470.00	0.22
159	000766	通化金马	10,000	253,700.00	0.22
160	600186	莲花控股	41,900	251,400.00	0.22
161	300850	新强联	7,000	250,740.00	0.22
162	300315	掌趣科技	41,200	250,084.00	0.22
163	002706	良信股份	28,000	249,480.00	0.22
164	002051	中工国际	28,800	248,544.00	0.21
165	002681	奋达科技	36,400	246,428.00	0.21
166	603612	索通发展	13,400	246,292.00	0.21
167	603583	捷昌驱动	6,700	244,684.00	0.21
168	603218	日月股份	19,100	242,379.00	0.21
169	603109	神驰机电	8,600	240,284.00	0.21
170	601330	绿色动力	31,300	239,132.00	0.21
171	300596	利安隆	8,300	238,791.00	0.21
172	300357	我武生物	11,500	237,360.00	0.21
173	000737	北方铜业	21,800	236,748.00	0.20
174	002079	苏州固锝	24,200	235,950.00	0.20
175	002335	科华数据	5,500	234,740.00	0.20
176	000899	赣能股份	27,100	233,873.00	0.20
177	301348	蓝箭电子	9,900	232,947.00	0.20
178	002811	郑中设计	21,900	231,264.00	0.20
179	002839	张家港行	51,000	229,500.00	0.20
180	300748	金力永磁	9,600	228,864.00	0.20
181	002003	伟星股份	20,900	228,019.00	0.20
182	603267	鸿远电子	4,500	226,215.00	0.20
183	300416	苏试试验	15,700	224,981.00	0.19
184	002239	奥特佳	77,300	224,170.00	0.19
185	600459	贵研铂业	14,300	221,793.00	0.19

186	603699	纽威股份	7,100	221,307.00	0.19
187	300308	中际旭创	1,500	218,790.00	0.19
188	603192	汇得科技	10,100	211,090.00	0.18
189	603983	丸美生物	5,000	210,650.00	0.18
190	688548	广钢气体	21,000	210,420.00	0.18
191	300383	光环新网	14,700	210,210.00	0.18
192	603876	鼎胜新材	23,100	209,979.00	0.18
193	600391	航发科技	7,100	207,320.00	0.18
194	301175	中科环保	40,100	207,317.00	0.18
195	688443	智翔金泰	7,450	206,663.00	0.18
196	300656	民德电子	7,600	203,148.00	0.18
197	688332	中科蓝讯	1,948	200,799.84	0.17
198	688252	天德钰	8,200	199,916.00	0.17
199	300466	赛摩智能	18,800	196,084.00	0.17
200	301029	怡合达	8,300	189,738.00	0.16
201	002929	润建股份	4,000	189,040.00	0.16
202	300069	金利华电	9,900	188,991.00	0.16
203	002091	江苏国泰	25,900	188,293.00	0.16
204	002907	华森制药	11,300	188,145.00	0.16
205	002324	普利特	17,600	187,088.00	0.16
206	002777	久远银海	10,200	186,252.00	0.16
207	000025	特力 A	10,800	185,760.00	0.16
208	600037	歌华有线	24,300	185,652.00	0.16
209	300558	贝达药业	3,200	185,440.00	0.16
210	300475	香农芯创	5,200	185,276.00	0.16
211	603040	新坐标	4,600	184,782.00	0.16
212	300253	卫宁健康	17,300	183,380.00	0.16
213	002815	崇达技术	16,000	181,280.00	0.16
214	001696	宗申动力	8,000	179,600.00	0.16
215	600621	华鑫股份	11,700	179,127.00	0.15
216	688586	江航装备	15,800	177,750.00	0.15
217	301510	固高科技	5,900	177,295.00	0.15
218	688306	均普智能	18,000	177,120.00	0.15
219	002516	旷达科技	33,900	174,585.00	0.15
220	600780	通宝能源	29,100	172,563.00	0.15
221	002202	金风科技	16,700	171,175.00	0.15
222	603056	德邦股份	10,700	170,344.00	0.15
223	605009	豪悦护理	4,260	169,462.80	0.15
224	600211	西藏药业	4,600	169,372.00	0.15
225	603456	九洲药业	11,100	168,831.00	0.15
226	002539	云图控股	17,800	166,964.00	0.14
227	002534	西子洁能	14,800	166,352.00	0.14
228	600990	四创电子	5,900	165,436.00	0.14

229	300913	兆龙互连	3,420	160,124.40	0.14
230	600523	贵航股份	10,800	159,732.00	0.14
231	603900	莱绅通灵	14,000	159,600.00	0.14
232	000426	兴业银锡	10,100	159,580.00	0.14
233	601881	中国银河	9,300	159,495.00	0.14
234	600475	华光环能	15,200	158,384.00	0.14
235	600422	昆药集团	10,900	155,979.00	0.13
236	002354	天娱数科	24,500	155,575.00	0.13
237	002468	申通快递	14,400	153,936.00	0.13
238	002152	广电运通	11,400	153,216.00	0.13
239	000681	视觉中国	7,400	149,036.00	0.13
240	000791	甘肃能源	23,200	148,016.00	0.13
241	300032	金龙机电	27,900	146,754.00	0.13
242	300079	数码视讯	24,300	142,155.00	0.12
243	600746	江苏索普	18,200	142,142.00	0.12
244	300680	隆盛科技	3,700	140,267.00	0.12
245	600592	龙溪股份	5,800	140,070.00	0.12
246	688432	有研硅	12,656	139,722.24	0.12
247	000893	亚钾国际	4,600	138,644.00	0.12
248	002080	中材科技	7,100	138,450.00	0.12
249	688232	新点软件	4,600	138,184.00	0.12
250	688380	中微半导	5,000	135,500.00	0.12
251	600320	振华重工	30,900	135,033.00	0.12
252	600416	湘电股份	10,000	134,400.00	0.12
253	002915	中欣氟材	7,500	134,100.00	0.12
254	300319	麦捷科技	12,300	132,102.00	0.11
255	001339	智微智能	2,700	130,491.00	0.11
256	300723	一品红	2,600	130,312.00	0.11
257	300041	回天新材	13,700	129,054.00	0.11
258	605198	安德利	3,200	128,992.00	0.11
259	300403	汉字集团	8,400	127,596.00	0.11
260	002352	顺丰控股	2,600	126,776.00	0.11
261	603008	喜临门	7,100	124,108.00	0.11
262	605376	博迁新材	3,200	122,656.00	0.11
263	600020	中原高速	25,400	121,412.00	0.10
264	002251	步步高	24,900	121,263.00	0.10
265	600675	中华企业	42,100	121,248.00	0.10
266	300168	万达信息	15,700	120,419.00	0.10
267	002399	海普瑞	10,000	119,100.00	0.10
268	000058	深赛格	14,300	118,833.00	0.10
269	300879	大叶股份	3,000	117,840.00	0.10
270	688428	诺诚健华	4,800	117,264.00	0.10
271	002237	恒邦股份	9,800	115,640.00	0.10

272	000965	天保基建	29,200	113,296.00	0.10
273	300803	指南针	1,400	112,924.00	0.10
274	002655	共达电声	8,700	112,752.00	0.10
275	688668	鼎通科技	1,800	112,428.00	0.10
276	300753	爱朋医疗	3,400	112,132.00	0.10
277	600259	广晟有色	2,100	111,552.00	0.10
278	605080	浙江自然	4,000	111,200.00	0.10
279	600775	南京熊猫	10,200	111,078.00	0.10
280	000028	国药一致	4,400	109,692.00	0.09
281	002697	红旗连锁	20,500	109,675.00	0.09
282	688690	纳微科技	4,800	109,584.00	0.09
283	300430	诚益通	5,200	108,420.00	0.09
284	300634	彩讯股份	4,000	108,400.00	0.09
285	688385	复旦微电	2,192	107,999.84	0.09
286	300421	力星股份	7,200	107,856.00	0.09
287	300476	胜宏科技	800	107,504.00	0.09
288	300296	利亚德	17,600	107,360.00	0.09
289	600185	珠免集团	18,100	106,247.00	0.09
290	600316	洪都航空	2,800	105,560.00	0.09
291	600480	凌云股份	8,580	104,418.60	0.09
292	000975	山金国际	5,500	104,170.00	0.09
293	002221	东华能源	10,700	103,362.00	0.09
294	300499	高澜股份	5,800	103,240.00	0.09
295	002600	领益智造	12,000	103,080.00	0.09
296	300035	中科电气	6,100	102,968.00	0.09
297	603978	深圳新星	5,700	102,828.00	0.09
298	002668	TCL 智家	10,500	102,585.00	0.09
299	002996	顺博合金	13,900	102,304.00	0.09
300	600988	赤峰黄金	4,100	102,008.00	0.09
301	601811	新华文轩	7,000	101,990.00	0.09
302	002736	国信证券	8,800	101,376.00	0.09
303	600326	西藏天路	11,800	101,008.00	0.09
304	600570	恒生电子	3,000	100,620.00	0.09
305	600789	鲁抗医药	10,000	100,100.00	0.09
306	002947	恒铭达	3,000	99,570.00	0.09
307	301171	易点天下	3,700	98,901.00	0.09
308	002791	坚朗五金	4,600	98,440.00	0.09
309	688141	杰华特	3,001	97,772.58	0.08
310	002090	金智科技	10,000	95,800.00	0.08
311	002993	奥海科技	2,300	95,381.00	0.08
312	688321	微芯生物	4,000	95,120.00	0.08
313	300415	伊之密	4,700	94,705.00	0.08
314	000837	秦川机床	7,800	93,756.00	0.08

315	000559	万向钱潮	12,000	91,800.00	0.08
316	300170	汉得信息	5,300	91,213.00	0.08
317	603067	振华股份	5,760	87,782.40	0.08
318	601528	瑞丰银行	15,100	87,429.00	0.08
319	600728	佳都科技	15,800	86,110.00	0.07
320	601579	会稽山	4,200	83,622.00	0.07
321	300871	回盛生物	4,000	83,600.00	0.07
322	600461	洪城环境	8,600	82,904.00	0.07
323	300747	锐科激光	3,500	82,880.00	0.07
324	603809	豪能股份	5,400	82,620.00	0.07
325	688173	希荻微	6,000	81,960.00	0.07
326	601777	千里科技	9,500	80,655.00	0.07
327	300857	协创数据	900	77,454.00	0.07
328	002842	翔鹭钨业	9,200	76,820.00	0.07
329	300393	中来股份	13,300	76,608.00	0.07
330	300534	陇神戎发	7,900	76,314.00	0.07
331	002009	天奇股份	4,900	75,411.00	0.07
332	002151	北斗星通	2,600	74,594.00	0.06
333	002821	凯莱英	800	70,600.00	0.06
334	301558	三态股份	7,600	68,476.00	0.06
335	600587	新华医疗	4,500	68,130.00	0.06
336	603063	禾望电气	2,000	67,720.00	0.06
337	300424	航新科技	3,900	67,548.00	0.06
338	000902	新洋丰	4,800	66,384.00	0.06
339	301215	中汽股份	10,700	66,340.00	0.06
340	002913	奥士康	2,200	64,702.00	0.06
341	300185	通裕重工	21,800	62,348.00	0.05
342	000767	晋控电力	21,400	61,204.00	0.05
343	601068	中铝国际	13,300	60,781.00	0.05
344	002020	京新药业	4,600	60,030.00	0.05
345	300652	雷迪克	1,000	58,890.00	0.05
346	002294	信立泰	1,200	56,796.00	0.05
347	603630	拉芳家化	2,400	53,808.00	0.05
348	002036	联创电子	4,900	52,969.00	0.05
349	688351	微电生理	2,673	52,658.10	0.05
350	600063	皖维高新	11,300	51,754.00	0.04
351	601236	红塔证券	6,100	51,667.00	0.04
352	600793	宜宾纸业	2,000	51,540.00	0.04
353	603997	继峰股份	3,900	50,856.00	0.04
354	603039	泛微网络	900	50,130.00	0.04
355	002936	郑州银行	22,700	46,762.00	0.04
356	688048	长光华芯	785	45,325.90	0.04
357	601882	海天精工	2,300	43,930.00	0.04

358	688787	海天瑞声	400	42,472.00	0.04
359	300696	爱乐达	1,800	40,644.00	0.04
360	002941	新疆交建	3,600	40,104.00	0.03
361	300809	华辰装备	1,000	37,580.00	0.03
362	002959	小熊电器	800	37,152.00	0.03
363	600861	北京人力	1,900	36,670.00	0.03
364	000818	航锦科技	1,600	36,000.00	0.03
365	601319	中国人保	4,100	35,711.00	0.03
366	300017	网宿科技	3,300	35,376.00	0.03
367	600773	西藏城投	3,500	35,210.00	0.03
368	603518	锦泓集团	3,500	34,580.00	0.03
369	600595	中孚实业	7,700	33,726.00	0.03
370	002560	通达股份	4,200	33,180.00	0.03
371	603296	华勤技术	400	32,272.00	0.03
372	002491	通鼎互联	5,500	31,240.00	0.03
373	002140	东华科技	3,200	29,440.00	0.03
374	688206	概伦电子	1,000	29,080.00	0.03
375	300858	科拓生物	1,800	28,062.00	0.02
376	600313	农发种业	4,400	27,544.00	0.02
377	002979	雷赛智能	600	26,568.00	0.02
378	002463	沪电股份	600	25,548.00	0.02
379	002611	东方精工	2,100	25,326.00	0.02
380	300456	赛微电子	1,400	24,066.00	0.02
381	601969	海南矿业	3,200	23,200.00	0.02
382	300768	迪普科技	1,300	22,295.00	0.02
383	600160	巨化股份	700	20,076.00	0.02
384	600976	健民集团	500	19,605.00	0.02
385	688591	泰凌微	400	19,160.00	0.02
386	002284	亚太股份	1,700	18,785.00	0.02
387	300183	东软载波	1,000	16,810.00	0.01
388	002807	江阴银行	3,400	16,150.00	0.01
389	002286	保龄宝	1,400	15,862.00	0.01
390	600812	华北制药	2,500	15,450.00	0.01
391	301458	钧崴电子	421	14,360.31	0.01
392	002489	浙江永强	3,900	14,274.00	0.01
393	000566	海南海药	2,300	13,524.00	0.01
394	301602	超研股份	536	13,292.80	0.01
395	300039	上海凯宝	2,000	12,120.00	0.01
396	002428	云南锗业	600	11,940.00	0.01
397	301260	格力博	600	11,832.00	0.01
398	301601	惠通科技	339	11,475.15	0.01
399	301535	浙江华远	584	11,090.16	0.01
400	301112	信邦智能	300	10,890.00	0.01

401	002943	宇晶股份	400	10,500.00	0.01
402	002735	王子新材	700	10,367.00	0.01
403	600877	电科芯片	800	10,144.00	0.01
404	603118	共进股份	900	10,143.00	0.01
405	300088	长信科技	1,700	10,132.00	0.01
406	603690	至纯科技	400	9,996.00	0.01
407	300661	圣邦股份	130	9,460.10	0.01
408	600783	鲁信创投	700	8,750.00	0.01
409	600388	龙净环保	700	8,400.00	0.01
410	002270	华明装备	500	8,370.00	0.01
411	002011	盾安环境	700	8,120.00	0.01
412	301479	弘景光电	94	7,319.78	0.01
413	603072	天和磁材	118	6,425.10	0.01
414	002978	安宁股份	200	6,316.00	0.01
415	301275	汉朔科技	106	5,956.14	0.01
416	002731	萃华珠宝	400	5,840.00	0.01
417	301173	毓恬冠佳	115	5,172.70	0.00
418	001356	富岭股份	358	5,169.52	0.00
419	001382	新亚电缆	240	4,850.40	0.00
420	300451	创业慧康	800	4,520.00	0.00
421	301501	恒鑫生活	99	4,476.78	0.00
422	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
423	600721	百花医药	500	3,635.00	0.00
424	603199	九华旅游	100	3,624.00	0.00
425	000019	深粮控股	400	2,664.00	0.00
426	002825	纳尔股份	200	1,996.00	0.00
427	600246	万通发展	300	1,833.00	0.00
428	600531	豫光金铅	200	1,548.00	0.00
429	002267	陕天然气	200	1,514.00	0.00
430	600697	欧亚集团	100	1,210.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688327	云从科技	2,066,425.48	1.52
2	600301	华锡有色	1,687,685.00	1.24
3	301078	孩子王	1,622,270.00	1.19
4	601519	大智慧	1,611,778.00	1.18
5	603477	巨星农牧	1,611,511.00	1.18
6	600059	古越龙山	1,561,689.99	1.15
7	300432	富临精工	1,532,885.20	1.13
8	002761	浙江建投	1,503,038.00	1.10

9	688018	乐鑫科技	1,477,927.59	1.09
10	300570	太辰光	1,439,286.00	1.06
11	601083	锦江航运	1,429,735.00	1.05
12	300777	中简科技	1,410,320.00	1.04
13	300113	顺网科技	1,380,483.00	1.01
14	600710	苏美达	1,362,382.00	1.00
15	300702	天宇股份	1,347,324.00	0.99
16	603583	捷昌驱动	1,277,113.00	0.94
17	002891	中宠股份	1,271,565.00	0.93
18	002326	永太科技	1,259,404.00	0.93
19	688322	奥比中光	1,242,202.06	0.91
20	300850	新强联	1,232,059.00	0.91

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	688327	云从科技	1,808,060.10	1.33
2	301078	孩子王	1,696,361.24	1.25
3	600301	华锡有色	1,670,678.00	1.23
4	300850	新强联	1,423,543.00	1.05
5	301205	联特科技	1,380,960.00	1.01
6	300079	数码视讯	1,377,372.00	1.01
7	300674	宇信科技	1,357,354.00	1.00
8	300088	长信科技	1,352,718.26	0.99
9	300475	香农芯创	1,345,287.00	0.99
10	002183	怡亚通	1,338,459.00	0.98
11	002967	广电计量	1,329,753.00	0.98
12	301238	瑞泰新材	1,320,386.00	0.97
13	002204	大连重工	1,315,399.00	0.97
14	600710	苏美达	1,298,282.00	0.95
15	603466	风语筑	1,288,498.00	0.95
16	600728	佳都科技	1,243,545.00	0.91
17	300035	中科电气	1,242,889.00	0.91
18	600961	株冶集团	1,236,133.00	0.91
19	601083	锦江航运	1,205,269.00	0.89
20	002338	奥普光电	1,205,176.00	0.89

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	438,104,048.87
卖出股票收入（成交）总额	469,197,832.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，巨星农牧（603477）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

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

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有被监管部门立案调查的情形，也没有

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

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	603,782.40
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,336,912.93
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,940,695.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	747	94,699.68	5,709,944.22	8.07	65,030,719.85	91.93
华泰柏瑞中证 1000	596	49,330.58	551,720.86	1.88	28,849,305.00	98.12

指数增强 C						
合计	1,326	75,521.64	6,261,665.08	6.25	93,880,024.85	93.75

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	0.00	0.0000
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	35,998.52	0.1224
	合计	35,998.52	0.0359

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 19 日) 基金份额总额	237,197,469.05	110,701,240.53
本报告期期初基金 份额总额	88,382,327.60	41,509,968.75
本报告期基金总申 购份额	59,603,358.49	15,488,421.20
减：本报告期基金 总赎回份额	77,245,022.02	27,597,364.09
本报告期基金拆分 变动份额	-	-

本报告期期末基金 份额总额	70,740,664.07	29,401,025.86
------------------	---------------	---------------

§ 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。

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

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
中金财富证券	3	906,985,238 .47	100.00	168,596.47	100.00	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当综合考虑下列因素：

- (1) 具有相应的业务经营资格；
- (2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的人员，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。

10.7.2 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(%)
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下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 06 月 04 日
2	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 05 月 24 日
3	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 14 日
4	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
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	2025 年 05 月 01 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	证监会规定报刊和网站	2025 年 3 月 31 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期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 01 月 03 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

2025 年 8 月 30 日