

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60

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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
场内简称	ETF500（扩位证券简称：中证 500ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	604,429,801.00 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	2015 年 6 月 12 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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中证 500 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，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：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，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	大五道口广场 1 号 17 层	
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 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告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	中国证券登记结算有限责任公司 华泰柏瑞基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 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)
本期已实现收益	21,407,593.59
本期利润	60,035,705.74
加权平均基金份额本期利润	0.0887
本期加权平均净值利润率	5.44%
本期基金份额净值增长率	4.84%
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	-191,333,646.27
期末可供分配基金份额利润	-0.3166
期末基金资产净值	1,024,427,529.80
期末基金份额净值	1.6949
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	-14.09%

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。

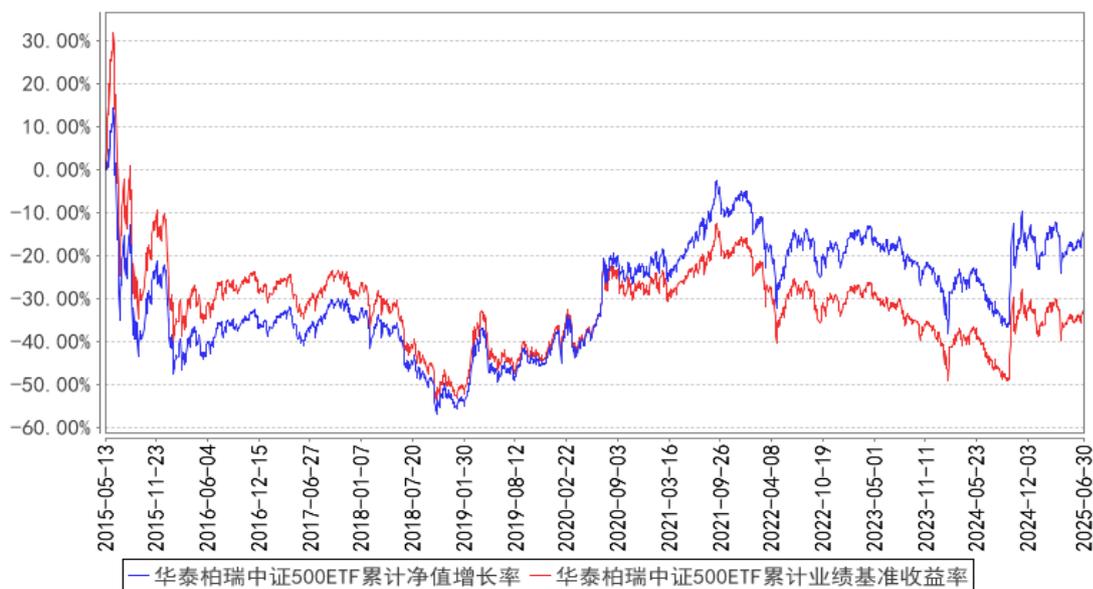
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	5.14%	0.77%	4.31%	0.79%	0.83%	-0.02%
过去三个月	2.21%	1.50%	0.98%	1.50%	1.23%	0.00%
过去六个月	4.84%	1.35%	3.31%	1.36%	1.53%	-0.01%
过去一年	23.06%	1.71%	19.68%	1.72%	3.38%	-0.01%
过去三年	1.12%	1.34%	-8.35%	1.35%	9.47%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-14.09%	1.59%	-32.36%	1.61%	18.27%	-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500ETF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 2015 年 5 月 13 日至 2025 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、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		
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	6 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。
柳军	副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2015 年 5 月 13 日	2025 年 1 月 23 日	24 年	副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技

					<p>100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
胡亦清	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	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</p>

					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。
--	--	--	--	--	---

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	8	3,007,484,075.70	2025 年 1 月 23 日
	私募资产管理计划	6	937,248,424.08	2019 年 7 月 25 日
	其他组合	-	-	-
	合计	14	3,944,732,499.78	-

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 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

本基金以完全复制中证 500 指数为投资策略，产品回报主要取决于标的指数收益。2025 年上半年 A 股市场经历了波动收敛、回归常规状态的过程。一季度市场主要影响变量是 DeepSeek 带来的国内投资者对于 AI 理解的颠覆性变化，二季度在短暂的关税冲击后，指数便逐步回升，同时波动率稳定在低位，6 月下旬起核心宽基指数走出了一定的缓慢上行态势，上证指数于 7 月创下年内收盘新高。最终上半年沪深 300 微涨 0.03%，中证 500 涨 3.31%，中证 1000 涨 6.69%，中小盘表现整体略强。

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 0.02%，期间日跟踪误差为 0.03%，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 1.6949 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.84%，业绩比较基准收益率为 3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近两月地缘冲击边际弱化，基本面继续缓慢修复，在相对成功的预期引导下，投资者对于经济的信心已基本夯实，叠加技术周期带来的推动力，底层逻辑依然维持正向。

当前市场状态与半年前比也发生了显著的变化，受宏观事件性的影响大幅缩减，市场更多以我为主，投资者相对更关注上市公司业绩相关的信息与预期变化，成交也较为活跃。本轮上涨前期市场仍呈现一定的犹豫，体现在涨速相对较慢，主因还是难觅与短期大涨匹配的逻辑，但雅江水电站项目的公布和“反内卷”的持续展开给上行提供了抓手，指数趋势逐步走好，朝右侧区间迈进。从市场位置来看，尽管价值水平较之前有所下降，但仍处于合理区间，结合业绩改善的预期和上行的趋势，市场可能具备拔估值的空间。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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；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还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金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。截止本报告期末，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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	22,958,732.30	19,975,429.55
结算备付金		12,426,350.05	11,205,972.12
存出保证金		3,770,986.20	3,927,919.52
交易性金融资产	6.4.7.2	986,279,881.14	1,214,583,397.91
其中：股票投资		986,277,981.02	1,214,583,397.91
基金投资		-	-
债券投资		1,900.12	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,025,435,949.69	1,249,692,719.10
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		71,075.69	2,306,756.29
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		124,752.36	163,813.65
应付托管费		41,584.12	54,604.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	99,364.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	771,007.72	734,766.95
负债合计		1,008,419.89	3,359,306.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,215,761,176.07	1,550,662,326.60
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-191,333,646.27	-304,328,913.60
净资产合计		1,024,427,529.80	1,246,333,413.00
负债和净资产总计		1,025,435,949.69	1,249,692,719.10

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6949 元，基金份额总额 604,429,801.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 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 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、营业总收入		61,304,138.72	-37,198,293.77
1. 利息收入		97,858.65	420,948.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	97,858.65	85,781.12
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		-	335,166.97
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,215,073.07	-16,925,320.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,254,333.93	-23,599,603.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	74,965.39	26,324.74
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-3,826.81	-371,842.83
股利收益	6.4.7.19	9,889,600.56	7,019,801.11
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	38,628,112.15	-20,689,242.68
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	363,094.85	-4,678.44
减：二、营业总支出		1,268,432.98	742,845.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	823,179.62	422,965.04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	274,393.28	140,988.35
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,034.77	3,482.19
8. 其他费用	6.4.7.23	169,825.31	175,409.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,035,705.74	-37,941,138.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,035,705.74	-37,941,138.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		60,035,705.74	-37,941,138.96

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 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 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	净资产合计
一、上期期末净资产	1,550,662,326.60	-	-304,328,913.60	1,246,333,413.00

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,550,662,326.60	-	-304,328,913.60	1,246,333,413.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-334,901,150.53	-	112,995,267.33	-221,905,883.20
(一)、综合收益总额	-	-	60,035,705.74	60,035,705.74
(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)	-334,901,150.53	-	52,959,561.59	-281,941,588.94
其中：1. 基金申购款	181,027,648.96	-	-37,053,938.32	143,973,710.64
2. 基金赎回款	-515,928,799.49	-	90,013,499.91	-425,915,299.58
(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	1,215,761,176.07	-	-191,333,646.27	1,024,427,529.80
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	781,294,818.50	-	-203,606,418.17	577,688,400.33
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	781,294,818.50	-	-203,606,418.17	577,688,400.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,034,254.96	-	-44,618,561.77	-38,584,306.81
(一)、综合收益总额	-	-	-37,941,138.96	-37,941,138.96
(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)	6,034,254.96	-	-6,677,422.81	-643,167.85
其中：1. 基金申购款	129,736,481.75	-	-41,603,752.12	88,132,729.63
2. 基金赎回款	-123,702,226.79	-	34,926,329.31	-88,775,897.48
(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	787,329,073.46	-	-248,224,979.94	539,104,093.52

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 500 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[2015]508 号《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》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 500 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 873,771,921.00 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(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,140.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于 2015 年 6 月 3 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.49716235,并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意,本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 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发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、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、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%,且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》,本基金自 2019 年 10 月 16 日起,新增投资范围:本基金可根据法律法规的规定,参与转融通证券出借业务。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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	22,958,732.30
等于：本金	22,956,498.97
加：应计利息	2,233.33
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	22,958,732.30

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	961,631,764.02	-	986,277,981.02	24,646,217.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,900.00	0.12	1,900.12	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,900.00	0.12	1,900.12	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	961,633,664.02	0.12	986,279,881.14	24,646,217.00	

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	28,642,760.00	-	-	-
其中：股指期货投资	28,642,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	28,642,760.00	-	-	-

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
IC2509	中证 500 股指期货 2509	26.00	30,034,160.00	1,391,400.00
合计				1,391,400.00
减：可抵销期货暂收款				1,391,400.00
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。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	56,124.76
其中：交易所市场	56,124.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应退退补款	625,622.81
合计	771,007.72

6.4.7.10 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	770,929,801.00	1,550,662,326.60
本期申购	90,000,000.00	181,027,648.96
本期赎回（以“-”号填列）	-256,500,000.00	-515,928,799.49
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	604,429,801.00	1,215,761,176.07
-----	----------------	------------------

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	197,272,518.71	-501,601,432.31	-304,328,913.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	197,272,518.71	-501,601,432.31	-304,328,913.60
本期利润	21,407,593.59	38,628,112.15	60,035,705.74
本期基金份额交易产生的变动数	-44,582,893.99	97,542,455.58	52,959,561.59
其中：基金申购款	23,717,739.99	-60,771,678.31	-37,053,938.32
基金赎回款	-68,300,633.98	158,314,133.89	90,013,499.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	174,097,218.31	-365,430,864.58	-191,333,646.27

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	31,919.29
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	65,434.91
其他	504.45
合计	97,858.65

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	12,495,351.81
股票投资收益——赎回差价收入	-241,017.88
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	12,254,333.93

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	340,024,847.03
减：卖出股票成本总额	327,220,730.09
减：交易费用	308,765.13
买卖股票差价收入	12,495,351.81

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	425,915,299.58
减：现金支付赎回款总额	239,227,439.58
减：赎回股票成本总额	186,928,877.88
减：交易费用	-
赎回差价收入	-241,017.88

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	48.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	74,916.89
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	74,965.39

6.4.7.15.2 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6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	518,487.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	443,500.00
减：应计利息总额	49.93
减：交易费用	20.72
买卖债券差价收入	74,916.89

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	-3,826.81

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	9,889,600.56
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	9,889,600.56

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	36,638,832.15
股票投资	36,638,832.15
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	1,989,280.00
权证投资	-
期货投资	1,989,280.00
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	38,628,112.15

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	-
替代损益	363,094.85

合计	363,094.85
----	------------

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	78,452.15
银行划款手续费	1,736.34
存托服务费	376.67
合计	169,825.31

注：1. 指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

2. 根据《关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担。

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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
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
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	62,544,925.60	11.91	88,429,065.63	39.59

6.4.10.1.2 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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 (%)

华泰证券	-	-	39,790.66	28.89
------	---	---	-----------	-------

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	12,510.34	11.91	5,964.92	10.63
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	75,937.09	69.09	28,118.12	50.97

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。

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	823,179.62
其中：应支付销售机构的客户维护 费	212.23	-
应支付基金管理人的净管理费	822,967.39	422,965.04

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 0.15% 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 × 0.15% / 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	274,393.28	140,988.35

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-~-	-	-	-	-
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	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	30,697,149.00	3.10~3.40	3.20	42,946.42	83,888.00	81.52

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自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30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 (%)
华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	362,070,861.00	59.9029	476,017,661.00	61.7459
华泰证券股份有限公司	1,662,747.00	0.2751	1,662,829.00	0.2157

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
中国银行	22,958,732.30	31,919.29	16,704,679.31	27,899.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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	301458	钧威电子	网下申购	7,005	72,852.00
中银国际证券	603409	汇通控股	网下申购	1,000	24,180.00
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合证券	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合证券	127108	太能转债	优先配售	3,012	301,200.00
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	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	9,786	153,542.34
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00

华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

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
001335	信凯科技	2025年4月2日	6个月	新股锁定期内	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股锁定期内	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股锁定期内	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月以上	新股锁定期内	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股锁定期内	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联	2025年1月	6个月	新股锁定	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-

	机械	20 日		期内							
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股 锁定 期内	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-	
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 锁定 期内	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-	
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-	
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股 锁定 期内	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	含证 券送 配	
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股 锁定 期内	39.92	45.22	350	9,620.72	15,827.00	含证 券送 配	
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁定 期内	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-	
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股 锁定 期内	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-	
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-	
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-	
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-	
301602	超研	2025 年 1 月	6 个月	新股 锁定	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-	

	股份	15 日		期内						
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
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	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	93.50	90.66	163	15,240.50	14,777.58	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-

603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股锁定期内	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股锁定期内	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025年6月5日	6个月	新股锁定期内	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股锁定期内	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股锁定期内	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股锁定期内	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股锁定期内	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期内	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	含证 券送 配
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股锁定期内	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股锁定期内	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股锁定期内	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影	2025	6个月	新股	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

	石 创 新	年6月 4日		锁 定 期 内						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位 ： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
123257	安 克 转 债	2025 年6月 16日	1个月	配 债 未 上 市	100.00	100.01	19	1,900.00	1,900.12	-

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

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0002%(2024 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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	22,958,732.30	-	-	-	-	-	22,958,732.30
结算备付金	12,426,350.05	-	-	-	-	-	12,426,350.05
存出保证金	166,887.00	-	-	-	-	3,604,099.20	3,770,986.20
交易性金融资产	-	-	-	-	1,900.12	986,277,981.02	986,279,881.14
资产总计	35,551,969.35	-	-	-	1,900.12	989,882,080.22	1,025,435,949.69
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,752.36	124,752.36
应付托管费	-	-	-	-	-	41,584.12	41,584.12
应付清算款	-	-	-	-	-	71,075.69	71,075.69
其他负债	-	-	-	-	-	771,007.72	771,007.72
负债总计	-	-	-	-	-	1,008,419.89	1,008,419.89
利率敏感度缺口	35,551,969.35	-	-	-	1,900.12	988,873,660.33	1,024,427,529.80
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	19,975,429.5	-	-	-	-	-	19,975,429.5

	5						5
结算备付金	11,205,972.12	-	-	-	-	-	11,205,972.12
存出保证金	386,469.92	-	-	-	-	3,541,449.60	3,927,919.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,214,583.397.91	1,214,583.397.91
资产总计	31,567,871.59	-	-	-	-	1,218,124,847.51	1,249,692,719.10
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	163,813.65	163,813.65
应付托管费	-	-	-	-	-	54,604.55	54,604.55
应付清算款	-	-	-	-	-	2,306,756.29	2,306,756.29
应交税费	-	-	-	-	-	99,364.66	99,364.66
其他负债	-	-	-	-	-	734,766.95	734,766.95
负债总计	-	-	-	-	-	3,359,306.10	3,359,306.10
利率敏感度缺口	31,567,871.59	-	-	-	-	1,214,765,541.41	1,246,333,313.00

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0002% (2024 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (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	986,277,981.02	96.28	1,214,583,397.91	97.45
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	986,277,981.02	96.28	1,214,583,397.91	97.45

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%	50,660,533.07	61,646,767.95
业绩比较基准下降5%	-50,660,533.07	-61,646,767.95	

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	985,777,183.30	1,213,911,695.55
第二层次	17,285.66	27,736.50
第三层次	485,412.18	643,965.86
合计	986,279,881.14	1,214,583,397.91

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

(1) 基金申购款

于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 143,973,710.64 元（2024 年度：808,416,977.94 元），其中包括以股票支付的申购款 61,939,469.49 元和以现金支付的申购款 82,034,241.15 元（2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 349,083,393.75 元和以现金支付的申购款 459,333,584.19 元）。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	986,277,981.02	96.18
	其中：股票	986,277,981.02	96.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,900.12	0.00
	其中：债券	1,900.12	0.00
	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	35,385,082.35	3.45
8	其他各项资产	3,770,986.20	0.37
9	合计	1,025,435,949.69	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,468,242.36	0.24
B	采矿业	35,823,131.26	3.50
C	制造业	623,223,248.69	60.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,797,932.97	3.10
E	建筑业	8,676,221.80	0.85
F	批发和零售业	21,579,017.95	2.11
G	交通运输、仓储和邮政业	16,205,792.80	1.58
H	住宿和餐饮业	2,640,873.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,932,473.16	8.97
J	金融业	97,209,966.53	9.49
K	房地产业	12,187,102.66	1.19
L	租赁和商务服务业	8,409,342.48	0.82

M	科学研究和技术服务业	6,713,028.18	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	4,155,034.24	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,029,392.00	0.20
Q	卫生和社会工作	4,547,963.56	0.44
R	文化、体育和娱乐业	13,819,041.56	1.35
S	综合	2,359,378.10	0.23
	合计	985,777,183.30	96.23

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	470,150.52	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	28,403.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	500,797.72	0.05

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	81,500	10,951,970.00	1.07
2	000988	华工科技	135,755	6,381,842.55	0.62
3	600988	赤峰黄金	223,600	5,563,168.00	0.54
4	300339	润和软件	106,800	5,428,644.00	0.53
5	002966	苏州银行	597,700	5,247,806.00	0.51
6	600839	四川长虹	496,880	4,829,673.60	0.47
7	601555	东吴证券	534,830	4,679,762.50	0.46
8	688521	芯原股份	48,192	4,650,528.00	0.45
9	601162	天风证券	933,100	4,600,183.00	0.45
10	689009	九号公司	76,536	4,528,635.12	0.44
11	002517	恺英网络	230,200	4,445,162.00	0.43
12	002340	格林美	689,824	4,380,382.40	0.43
13	002195	岩山科技	764,500	4,304,135.00	0.42
14	002558	巨人网络	181,800	4,281,390.00	0.42
15	603893	瑞芯微	27,700	4,206,522.00	0.41
16	002261	拓维信息	135,700	4,199,915.00	0.41
17	002156	通富微电	162,100	4,153,002.00	0.41
18	600487	亨通光电	265,400	4,060,620.00	0.40
19	600157	永泰能源	2,989,600	4,006,064.00	0.39
20	002797	第一创业	564,800	3,998,784.00	0.39
21	300207	欣旺达	199,000	3,991,940.00	0.39
22	688213	思特威	38,757	3,961,740.54	0.39
23	300251	光线传媒	194,600	3,944,542.00	0.39
24	300803	指南针	48,350	3,899,911.00	0.38
25	688120	华海清科	22,852	3,855,132.40	0.38
26	000066	中国长城	260,100	3,849,480.00	0.38
27	688777	中控技术	85,380	3,834,415.80	0.37
28	688608	恒玄科技	10,917	3,798,897.66	0.37
29	600096	云天化	172,200	3,783,234.00	0.37
30	600536	中国软件	80,213	3,751,562.01	0.37
31	002273	水晶光电	186,878	3,731,953.66	0.36
32	601168	西部矿业	224,203	3,728,495.89	0.36
33	600879	航天电子	355,654	3,723,697.38	0.36
34	002465	海格通信	267,077	3,723,053.38	0.36
35	601099	太平洋	917,300	3,604,989.00	0.35
36	000831	中国稀土	99,300	3,586,716.00	0.35

37	600352	浙江龙盛	350,500	3,561,080.00	0.35
38	002294	信立泰	74,900	3,545,017.00	0.35
39	300017	网宿科技	329,700	3,534,384.00	0.35
40	600885	宏发股份	157,038	3,503,517.78	0.34
41	688002	睿创微纳	50,193	3,499,455.96	0.34
42	688235	百济神州	14,947	3,492,217.08	0.34
43	688617	惠泰医疗	11,741	3,487,077.00	0.34
44	002185	华天科技	345,000	3,484,500.00	0.34
45	601108	财通证券	438,000	3,464,580.00	0.34
46	300450	先导智能	139,100	3,456,635.00	0.34
47	000933	神火股份	200,300	3,332,992.00	0.33
48	601128	常熟银行	446,963	3,294,117.31	0.32
49	688099	晶晨股份	46,384	3,293,727.84	0.32
50	601577	长沙银行	325,100	3,231,494.00	0.32
51	600079	人福医药	153,700	3,224,626.00	0.31
52	002595	豪迈科技	54,200	3,209,724.00	0.31
53	002281	光迅科技	64,545	3,183,359.40	0.31
54	603129	春风动力	14,700	3,182,550.00	0.31
55	002155	湖南黄金	177,504	3,168,446.40	0.31
56	300223	北京君正	45,700	3,162,440.00	0.31
57	002085	万丰奥威	198,500	3,154,165.00	0.31
58	688469	芯联集成	660,361	3,149,921.97	0.31
59	000423	东阿阿胶	60,000	3,138,000.00	0.31
60	000997	新大陆	96,900	3,137,622.00	0.31
61	688122	西部超导	60,452	3,136,249.76	0.31
62	300058	蓝色光标	476,233	3,124,088.48	0.30
63	002738	中矿资源	97,000	3,119,520.00	0.30
64	002532	天山铝业	375,200	3,117,912.00	0.30
65	300002	神州泰岳	263,900	3,114,020.00	0.30
66	000783	长江证券	447,200	3,099,096.00	0.30
67	002472	双环传动	91,700	3,071,033.00	0.30
68	600109	国金证券	349,800	3,067,746.00	0.30
69	002130	沃尔核材	128,400	3,058,488.00	0.30
70	300474	景嘉微	41,800	3,051,400.00	0.30
71	002138	顺络电子	108,200	3,042,584.00	0.30
72	603596	伯特利	57,580	3,033,890.20	0.30
73	002078	太阳纸业	225,374	3,033,534.04	0.30
74	300454	深信服	32,000	3,013,760.00	0.29
75	002436	兴森科技	227,200	3,008,128.00	0.29
76	688525	佰维存储	44,452	2,996,064.80	0.29
77	601933	永辉超市	610,300	2,990,470.00	0.29
78	688072	拓荆科技	19,309	2,967,986.39	0.29
79	300765	新诺威	57,200	2,956,668.00	0.29

80	002410	广联达	219,000	2,936,790.00	0.29
81	600143	金发科技	284,400	2,932,164.00	0.29
82	600862	中航高科	112,289	2,928,497.12	0.29
83	300136	信维通信	130,600	2,925,440.00	0.29
84	600580	卧龙电驱	147,590	2,917,854.30	0.28
85	300458	全志科技	73,300	2,909,277.00	0.28
86	601198	东兴证券	260,600	2,905,690.00	0.28
87	300024	机器人	169,000	2,903,420.00	0.28
88	002353	杰瑞股份	82,842	2,899,470.00	0.28
89	002065	东华软件	301,700	2,896,320.00	0.28
90	603606	东方电缆	56,000	2,895,760.00	0.28
91	300395	菲利华	56,600	2,892,260.00	0.28
92	002223	鱼跃医疗	81,155	2,889,118.00	0.28
93	600298	安琪酵母	82,000	2,883,940.00	0.28
94	688578	艾力斯	30,961	2,880,611.44	0.28
95	300054	鼎龙股份	100,300	2,876,604.00	0.28
96	600873	梅花生物	268,700	2,872,403.00	0.28
97	002202	金风科技	278,800	2,857,700.00	0.28
98	002850	科达利	25,200	2,851,884.00	0.28
99	300496	中科创达	49,800	2,849,556.00	0.28
100	002673	西部证券	361,500	2,848,620.00	0.28
101	000034	神州数码	75,500	2,841,820.00	0.28
102	601615	明阳智能	245,000	2,815,050.00	0.27
103	300346	南大光电	88,000	2,784,320.00	0.27
104	000728	国元证券	352,700	2,782,803.00	0.27
105	300383	光环新网	193,400	2,765,620.00	0.27
106	002624	完美世界	182,300	2,765,491.00	0.27
107	002851	麦格米特	55,100	2,762,714.00	0.27
108	002008	大族激光	113,200	2,758,684.00	0.27
109	000021	深科技	145,665	2,729,762.10	0.27
110	600363	联创光电	46,200	2,694,846.00	0.26
111	600549	厦门钨业	128,619	2,690,709.48	0.26
112	688220	翱捷科技	34,228	2,680,052.40	0.26
113	603087	甘李药业	48,800	2,673,264.00	0.26
114	600895	张江高科	103,576	2,661,903.20	0.26
115	000426	兴业银锡	167,700	2,649,660.00	0.26
116	300012	华测检测	226,300	2,645,447.00	0.26
117	603160	汇顶科技	37,200	2,642,316.00	0.26
118	000733	振华科技	52,600	2,632,630.00	0.26
119	300604	长川科技	58,600	2,631,726.00	0.26
120	603605	珀莱雅	31,700	2,624,443.00	0.26
121	300857	协创数据	30,300	2,607,618.00	0.25
122	300115	长盈精密	120,700	2,582,980.00	0.25

123	688361	中科飞测	30,644	2,579,918.36	0.25
124	603659	璞泰来	135,500	2,544,690.00	0.25
125	601216	君正集团	453,900	2,505,528.00	0.24
126	300699	光威复材	78,400	2,482,928.00	0.24
127	600392	盛和资源	188,500	2,482,545.00	0.24
128	000750	国海证券	602,442	2,482,061.04	0.24
129	601665	齐鲁银行	392,000	2,477,440.00	0.24
130	002444	巨星科技	96,833	2,470,209.83	0.24
131	300037	新宙邦	70,140	2,468,928.00	0.24
132	600171	上海贝岭	71,900	2,462,575.00	0.24
133	601997	贵阳银行	394,100	2,459,184.00	0.24
134	000519	中兵红箭	112,286	2,457,940.54	0.24
135	000932	华菱钢铁	558,560	2,457,664.00	0.24
136	000729	燕京啤酒	189,510	2,450,364.30	0.24
137	688180	君实生物	71,987	2,446,118.26	0.24
138	300003	乐普医疗	176,400	2,430,792.00	0.24
139	600153	建发股份	234,400	2,430,728.00	0.24
140	300627	华测导航	69,420	2,429,700.00	0.24
141	600060	海信视像	104,882	2,414,383.64	0.24
142	300073	当升科技	54,900	2,408,463.00	0.24
143	601717	郑煤机	144,802	2,406,609.24	0.23
144	601990	南京证券	297,220	2,401,537.60	0.23
145	000878	云南铜业	188,614	2,399,170.08	0.23
146	601233	桐昆股份	226,300	2,398,780.00	0.23
147	688052	纳芯微	13,741	2,397,667.09	0.23
148	601696	中银证券	224,000	2,394,560.00	0.23
149	605589	圣泉集团	86,200	2,392,050.00	0.23
150	300001	特锐德	98,650	2,364,640.50	0.23
151	300142	沃森生物	214,500	2,359,500.00	0.23
152	600673	东阳光	202,870	2,359,378.10	0.23
153	002821	凯莱英	26,700	2,356,275.00	0.23
154	603979	金诚信	50,700	2,354,508.00	0.23
155	002414	高德红外	229,000	2,347,250.00	0.23
156	600369	西南证券	534,500	2,325,075.00	0.23
157	600699	均胜电子	133,140	2,321,961.60	0.23
158	688065	凯赛生物	48,999	2,307,852.90	0.23
159	300373	扬杰科技	44,090	2,288,271.00	0.22
160	600118	中国卫星	79,700	2,277,029.00	0.22
161	600177	雅戈尔	311,200	2,271,760.00	0.22
162	600521	华海药业	121,600	2,265,408.00	0.22
163	600398	海澜之家	323,700	2,252,952.00	0.22
164	002152	广电运通	167,569	2,252,127.36	0.22
165	000893	亚钾国际	74,700	2,251,458.00	0.22

166	300748	金力永磁	92,800	2,212,352.00	0.22
167	600704	物产中大	419,100	2,208,657.00	0.22
168	600435	北方导航	141,445	2,205,127.55	0.22
169	688027	国盾量子	8,018	2,205,030.18	0.22
170	600909	华安证券	376,790	2,196,685.70	0.21
171	600316	洪都航空	58,253	2,196,138.10	0.21
172	000738	航发控制	105,700	2,193,275.00	0.21
173	002837	英维克	73,800	2,192,598.00	0.21
174	000623	吉林敖东	129,200	2,189,940.00	0.21
175	603345	安井食品	27,200	2,187,424.00	0.21
176	688385	复旦微电	44,342	2,184,730.34	0.21
177	688249	晶合集成	107,666	2,182,389.82	0.21
178	002007	华兰生物	139,100	2,179,697.00	0.21
179	600497	驰宏锌锗	410,546	2,171,788.34	0.21
180	603179	新泉股份	46,100	2,165,317.00	0.21
181	002318	久立特材	92,500	2,163,575.00	0.21
182	002958	青农商行	598,800	2,161,668.00	0.21
183	000009	中国宝安	243,283	2,160,353.04	0.21
184	002044	美年健康	419,800	2,157,772.00	0.21
185	600765	中航重机	127,586	2,153,651.68	0.21
186	600038	中直股份	54,800	2,126,788.00	0.21
187	600141	兴发集团	103,311	2,120,974.83	0.21
188	603228	景旺电子	50,640	2,118,777.60	0.21
189	002409	雅克科技	38,400	2,100,096.00	0.21
190	000400	许继电气	96,440	2,099,498.80	0.20
191	688188	柏楚电子	15,888	2,091,814.08	0.20
192	600155	华创阳安	298,974	2,080,859.04	0.20
193	002683	广东宏大	60,700	2,060,158.00	0.20
194	300919	中伟股份	62,400	2,051,712.00	0.20
195	000960	锡业股份	133,400	2,041,020.00	0.20
196	002607	中公教育	663,200	2,029,392.00	0.20
197	600637	东方明珠	271,400	2,027,358.00	0.20
198	600563	法拉电子	18,578	2,026,674.02	0.20
199	300724	捷佳伟创	37,300	2,025,390.00	0.20
200	600498	烽火通信	96,100	2,020,983.00	0.20
201	603939	益丰药房	81,812	2,001,939.64	0.20
202	600529	山东药玻	89,700	1,985,958.00	0.19
203	600562	国睿科技	62,876	1,979,965.24	0.19
204	600884	杉杉股份	208,700	1,974,302.00	0.19
205	000528	柳工	205,000	1,970,050.00	0.19
206	001696	宗申动力	87,500	1,964,375.00	0.19
207	002841	视源股份	56,700	1,961,820.00	0.19
208	002739	万达电影	170,900	1,953,387.00	0.19

209	000039	中集集团	248,476	1,953,021.36	0.19
210	300558	贝达药业	33,700	1,952,915.00	0.19
211	300757	罗博特科	12,900	1,934,613.00	0.19
212	002653	海思科	45,400	1,916,788.00	0.19
213	002926	华西证券	212,400	1,898,856.00	0.19
214	002025	航天电器	36,800	1,891,888.00	0.18
215	600901	江苏金租	312,160	1,891,689.60	0.18
216	688017	绿的谐波	15,134	1,890,085.26	0.18
217	600486	扬农化工	32,560	1,888,480.00	0.18
218	688568	中科星图	52,430	1,888,004.30	0.18
219	301358	湖南裕能	60,500	1,886,995.00	0.18
220	300623	捷捷微电	63,200	1,883,360.00	0.18
221	002385	大北农	463,300	1,871,732.00	0.18
222	000887	中鼎股份	105,821	1,861,391.39	0.18
223	688114	华大智造	28,708	1,861,139.64	0.18
224	300285	国瓷材料	106,900	1,854,715.00	0.18
225	000415	渤海租赁	550,200	1,832,166.00	0.18
226	300763	锦浪科技	31,900	1,830,741.00	0.18
227	300144	宋城演艺	212,300	1,815,165.00	0.18
228	002939	长城证券	216,500	1,814,270.00	0.18
229	600863	内蒙华电	439,800	1,807,578.00	0.18
230	600820	隧道股份	295,600	1,803,160.00	0.18
231	002568	百润股份	70,300	1,800,383.00	0.18
232	600008	首创环保	593,400	1,792,068.00	0.17
233	000723	美锦能源	414,100	1,788,912.00	0.17
234	603486	科沃斯	30,600	1,781,838.00	0.17
235	600132	重庆啤酒	32,300	1,779,730.00	0.17
236	000513	丽珠集团	49,106	1,769,780.24	0.17
237	002080	中材科技	90,700	1,768,650.00	0.17
238	600390	五矿资本	302,400	1,762,992.00	0.17
239	600516	方大炭素	379,000	1,758,560.00	0.17
240	603568	伟明环保	92,147	1,758,164.76	0.17
241	002064	华峰化学	265,800	1,756,938.00	0.17
242	688582	芯动联科	26,030	1,749,216.00	0.17
243	600763	通策医疗	42,252	1,744,162.56	0.17
244	600998	九州通	339,032	1,742,624.48	0.17
245	000703	恒逸石化	295,500	1,737,540.00	0.17
246	600166	福田汽车	640,102	1,734,676.42	0.17
247	688538	和辉光电	734,399	1,718,493.66	0.17
248	600170	上海建工	718,400	1,716,976.00	0.17
249	002262	恩华药业	82,300	1,710,194.00	0.17
250	300487	蓝晓科技	33,950	1,707,685.00	0.17
251	300679	电连技术	37,600	1,706,288.00	0.17

252	601179	中国西电	276,251	1,696,181.14	0.17
253	002500	山西证券	290,397	1,695,918.48	0.17
254	603589	口子窖	48,700	1,694,760.00	0.17
255	600208	新湖中宝	569,700	1,686,312.00	0.16
256	000683	博源化工	350,600	1,679,374.00	0.16
257	603816	顾家家居	65,800	1,679,216.00	0.16
258	605358	立昂微	71,992	1,677,413.60	0.16
259	600312	平高电气	108,900	1,675,971.00	0.16
260	002203	海亮股份	161,700	1,668,744.00	0.16
261	601155	新城控股	121,900	1,667,592.00	0.16
262	300676	华大基因	33,500	1,667,295.00	0.16
263	600021	上海电力	189,345	1,664,342.55	0.16
264	688183	生益电子	32,421	1,659,955.20	0.16
265	002312	川发龙蟒	144,000	1,653,120.00	0.16
266	002244	滨江集团	167,892	1,636,947.00	0.16
267	002432	九安医疗	44,900	1,635,707.00	0.16
268	600126	杭钢股份	181,138	1,630,242.00	0.16
269	600380	健康元	147,752	1,629,704.56	0.16
270	000591	太阳能	369,700	1,622,983.00	0.16
271	600583	海油工程	297,000	1,621,620.00	0.16
272	601000	唐山港	399,343	1,621,332.58	0.16
273	600348	华阳股份	243,131	1,619,252.46	0.16
274	000060	中金岭南	352,500	1,614,450.00	0.16
275	688278	特宝生物	22,373	1,613,317.03	0.16
276	000403	派林生物	88,550	1,605,411.50	0.16
277	000629	钒钛股份	626,000	1,602,560.00	0.16
278	603338	浙江鼎力	33,800	1,602,120.00	0.16
279	600872	中炬高新	84,100	1,597,900.00	0.16
280	603885	吉祥航空	118,575	1,597,205.25	0.16
281	000830	鲁西化工	153,933	1,585,509.90	0.15
282	000921	海信家电	61,600	1,583,120.00	0.15
283	601991	大唐发电	499,200	1,582,464.00	0.15
284	002603	以岭药业	111,900	1,577,790.00	0.15
285	002984	森麒麟	83,800	1,571,250.00	0.15
286	600535	天士力	100,300	1,569,695.00	0.15
287	603379	三美股份	32,580	1,567,749.60	0.15
288	300567	精测电子	25,800	1,563,738.00	0.15
289	600816	ST 安信	529,600	1,562,320.00	0.15
290	002439	启明星辰	97,000	1,551,030.00	0.15
291	600985	淮北矿业	136,700	1,550,178.00	0.15
292	002056	横店东磁	109,143	1,544,373.45	0.15
293	600095	湘财股份	153,800	1,542,614.00	0.15
294	300146	汤臣倍健	136,500	1,534,260.00	0.15

295	688728	格科微	98,958	1,523,953.20	0.15
296	002423	中粮资本	124,300	1,520,189.00	0.15
297	603927	中科软	78,448	1,517,184.32	0.15
298	600499	科达制造	154,800	1,517,040.00	0.15
299	600970	中材国际	176,760	1,516,600.80	0.15
300	600685	中船防务	55,700	1,514,483.00	0.15
301	301308	江波龙	17,300	1,513,577.00	0.15
302	601016	节能风电	523,450	1,512,770.50	0.15
303	601880	辽港股份	1,008,100	1,512,150.00	0.15
304	603000	人民网	74,270	1,500,996.70	0.15
305	000636	风华高科	108,974	1,497,302.76	0.15
306	300390	天华新能	78,420	1,495,469.40	0.15
307	601611	中国核建	162,600	1,494,294.00	0.15
308	600511	国药股份	51,095	1,489,930.20	0.15
309	688297	中无人机	27,883	1,488,952.20	0.15
310	601666	平煤股份	200,211	1,483,563.51	0.14
311	000958	电投产融	216,600	1,481,544.00	0.14
312	000563	陕国投 A	412,446	1,472,432.22	0.14
313	603298	杭叉集团	70,200	1,470,690.00	0.14
314	600859	王府井	105,529	1,465,797.81	0.14
315	300212	易华录	67,320	1,464,883.20	0.14
316	603077	和邦生物	832,985	1,457,723.75	0.14
317	601456	国联证券	140,700	1,456,245.00	0.14
318	688520	神州细胞	24,307	1,454,773.95	0.14
319	600655	豫园股份	261,900	1,453,545.00	0.14
320	688301	奕瑞科技	16,590	1,453,449.90	0.14
321	603737	三棵树	39,432	1,453,069.20	0.14
322	600004	白云机场	159,500	1,451,450.00	0.14
323	000598	兴蓉环境	201,172	1,450,450.12	0.14
324	000155	川能动力	147,500	1,448,450.00	0.14
325	603899	晨光股份	49,900	1,446,601.00	0.14
326	600325	华发股份	295,600	1,439,572.00	0.14
327	600483	福能股份	149,200	1,438,288.00	0.14
328	000062	深圳华强	53,400	1,434,324.00	0.14
329	600131	国网信通	81,000	1,433,700.00	0.14
330	601966	玲珑轮胎	97,600	1,431,792.00	0.14
331	601958	金钼股份	130,700	1,429,858.00	0.14
332	603156	养元饮品	67,400	1,426,184.00	0.14
333	300677	英科医疗	60,060	1,422,220.80	0.14
334	000050	深天马 A	165,800	1,412,616.00	0.14
335	600378	昊华科技	51,900	1,404,933.00	0.14
336	688234	天岳先进	23,895	1,399,052.25	0.14
337	600282	南钢股份	331,954	1,394,206.80	0.14

338	000987	越秀资本	202,970	1,392,374.20	0.14
339	002756	永兴材料	43,700	1,387,475.00	0.14
340	600598	北大荒	96,210	1,387,348.20	0.14
341	002507	涪陵榨菜	108,400	1,386,436.00	0.14
342	600271	航天信息	149,400	1,380,456.00	0.13
343	600663	陆家嘴	155,611	1,378,713.46	0.13
344	300601	康泰生物	90,600	1,376,214.00	0.13
345	300529	健帆生物	63,800	1,376,166.00	0.13
346	601001	晋控煤业	112,100	1,369,862.00	0.13
347	600754	锦江酒店	60,700	1,362,108.00	0.13
348	600739	辽宁成大	123,800	1,361,800.00	0.13
349	002773	康弘药业	47,000	1,361,590.00	0.13
350	688363	华熙生物	26,506	1,361,083.10	0.13
351	600737	中粮糖业	143,393	1,355,063.85	0.13
352	000559	万向钱潮	177,101	1,354,822.65	0.13
353	601918	新集能源	209,700	1,354,662.00	0.13
354	300751	迈为股份	19,300	1,342,508.00	0.13
355	603290	斯达半导	16,500	1,340,955.00	0.13
356	600582	天地科技	222,400	1,332,176.00	0.13
357	002429	兆驰股份	302,900	1,326,702.00	0.13
358	300070	碧水源	292,000	1,314,000.00	0.13
359	600566	济川药业	49,900	1,313,867.00	0.13
360	688772	珠海冠宇	91,821	1,312,122.09	0.13
361	000951	中国重汽	74,600	1,311,468.00	0.13
362	002120	韵达股份	195,300	1,308,510.00	0.13
363	601866	中远海发	529,151	1,307,002.97	0.13
364	601231	环旭电子	89,000	1,302,070.00	0.13
365	600867	通化东宝	158,300	1,298,060.00	0.13
366	688778	厦钨新能	23,167	1,295,498.64	0.13
367	600764	中国海防	38,100	1,295,400.00	0.13
368	688561	奇安信	37,770	1,283,424.60	0.13
369	603688	石英股份	36,350	1,280,247.00	0.12
370	600258	首旅酒店	90,500	1,278,765.00	0.12
371	002430	杭氧股份	65,700	1,275,894.00	0.12
372	600329	达仁堂	38,235	1,275,519.60	0.12
373	300888	稳健医疗	31,020	1,274,922.00	0.12
374	601098	中南传媒	97,113	1,274,122.56	0.12
375	301536	星辰科技	21,000	1,266,300.00	0.12
376	600995	南网储能	129,400	1,265,532.00	0.12
377	003031	中瓷电子	23,680	1,260,012.80	0.12
378	603728	鸣志电器	21,900	1,258,593.00	0.12
379	601212	白银有色	399,200	1,249,496.00	0.12
380	600707	彩虹股份	192,900	1,246,134.00	0.12

381	601333	广深铁路	430,800	1,245,012.00	0.12
382	300735	光弘科技	49,000	1,229,900.00	0.12
383	000032	深桑达 A	60,500	1,223,915.00	0.12
384	000027	深圳能源	191,476	1,221,616.88	0.12
385	600578	京能电力	269,900	1,211,851.00	0.12
386	603341	龙旗科技	29,800	1,210,774.00	0.12
387	603858	步长制药	74,298	1,206,599.52	0.12
388	000709	河钢股份	557,200	1,203,552.00	0.12
389	002299	圣农发展	83,942	1,199,531.18	0.12
390	002508	老板电器	62,900	1,195,729.00	0.12
391	688676	金盘科技	35,695	1,193,997.75	0.12
392	603529	爱玛科技	34,600	1,190,240.00	0.12
393	000967	盈峰环境	171,000	1,188,450.00	0.12
394	600906	财达证券	174,200	1,188,044.00	0.12
395	300573	兴齐眼药	22,840	1,182,883.60	0.12
396	000883	湖北能源	262,100	1,182,071.00	0.12
397	002831	裕同科技	50,441	1,181,328.22	0.12
398	301498	乖宝宠物	10,800	1,181,196.00	0.12
399	002670	国盛金控	78,176	1,176,548.80	0.11
400	600517	国网英大	230,300	1,174,530.00	0.11
401	600848	上海临港	129,300	1,172,751.00	0.11
402	600546	山煤国际	133,900	1,168,947.00	0.11
403	601399	国机重装	388,300	1,164,900.00	0.11
404	600959	江苏有线	336,038	1,155,970.72	0.11
405	688318	财富趋势	9,982	1,147,131.44	0.11
406	601928	凤凰传媒	102,100	1,140,457.00	0.11
407	601156	东航物流	85,700	1,121,813.00	0.11
408	600968	海油发展	273,900	1,117,512.00	0.11
409	600808	马钢股份	322,935	1,114,125.75	0.11
410	000739	普洛药业	78,800	1,103,200.00	0.11
411	600528	中铁工业	149,300	1,101,834.00	0.11
412	300595	欧普康视	72,100	1,100,967.00	0.11
413	000825	太钢不锈	306,200	1,099,258.00	0.11
414	002572	索菲亚	77,800	1,089,978.00	0.11
415	301301	川宁生物	90,400	1,088,416.00	0.11
416	002266	浙富控股	351,581	1,082,869.48	0.11
417	601636	旗滨集团	215,900	1,081,659.00	0.11
418	601118	海南橡胶	229,003	1,080,894.16	0.11
419	601608	中信重工	247,000	1,079,390.00	0.11
420	603225	新风鸣	101,100	1,076,715.00	0.11
421	600801	华新水泥	90,825	1,075,368.00	0.10
422	600977	中国电影	99,800	1,069,856.00	0.10
423	600871	石化油服	547,500	1,067,625.00	0.10

424	688563	航材股份	18,596	1,053,091.48	0.10
425	600062	华润双鹤	56,357	1,051,621.62	0.10
426	601598	中国外运	212,800	1,049,104.00	0.10
427	688387	信科移动	183,145	1,034,769.25	0.10
428	600056	中国医药	99,913	1,033,100.42	0.10
429	601106	中国一重	368,000	1,030,400.00	0.10
430	603650	彤程新材	31,876	1,024,813.40	0.10
431	000785	居然智家	335,200	1,022,360.00	0.10
432	603565	中谷物流	106,600	1,018,030.00	0.10
433	000543	皖能电力	143,900	1,007,300.00	0.10
434	603233	大参林	60,508	986,280.40	0.10
435	300957	贝泰妮	22,100	977,262.00	0.10
436	688702	盛科通信	15,980	976,058.40	0.10
437	000582	北部湾港	118,300	975,975.00	0.10
438	600373	中文传媒	94,300	968,461.00	0.09
439	600925	苏能股份	185,100	968,073.00	0.09
440	601965	中国汽研	54,400	965,600.00	0.09
441	002153	石基信息	109,932	952,011.12	0.09
442	600606	绿地控股	565,200	921,276.00	0.09
443	000537	中绿电	109,600	916,256.00	0.09
444	688281	华秦科技	14,889	900,933.39	0.09
445	002372	伟星新材	86,020	891,167.20	0.09
446	601568	北元集团	213,640	886,606.00	0.09
447	000429	粤高速 A	66,200	882,446.00	0.09
448	600098	广州发展	140,900	880,625.00	0.09
449	688425	铁建重工	214,738	876,131.04	0.09
450	001286	陕西能源	100,200	871,740.00	0.09
451	600612	老凤祥	17,500	870,625.00	0.08
452	600361	创新新材	217,700	868,623.00	0.08
453	003022	联泓新科	54,300	859,569.00	0.08
454	603658	安图生物	22,800	855,000.00	0.08
455	688349	三一重能	33,803	843,046.82	0.08
456	600688	上海石化	293,400	836,190.00	0.08
457	000937	冀中能源	142,148	817,351.00	0.08
458	301165	锐捷网络	13,140	807,584.40	0.08
459	601019	山东出版	84,500	800,215.00	0.08
460	000898	鞍钢股份	321,800	746,576.00	0.07
461	002608	江苏国信	101,000	740,330.00	0.07
462	601139	深圳燃气	115,900	737,124.00	0.07
463	688248	南网科技	23,383	735,629.18	0.07
464	600032	浙江新能	97,000	733,320.00	0.07
465	600339	中油工程	223,300	730,191.00	0.07
466	603707	健友股份	64,643	720,769.45	0.07

467	600720	中交设计	92,800	717,344.00	0.07
468	000959	首钢股份	209,800	713,320.00	0.07
469	688100	威胜信息	19,163	709,989.15	0.07
470	600928	西安银行	178,800	700,896.00	0.07
471	003035	南网能源	152,300	699,057.00	0.07
472	600295	鄂尔多斯	79,400	691,574.00	0.07
473	688032	禾迈股份	6,855	684,540.30	0.07
474	688475	萤石网络	21,653	682,502.56	0.07
475	601228	广州港	203,400	656,982.00	0.06
476	603556	海兴电力	25,600	652,032.00	0.06
477	688172	燕东微	33,075	650,254.50	0.06
478	301267	华夏眼科	33,700	646,029.00	0.06
479	688375	国博电子	10,716	643,067.16	0.06
480	002461	珠江啤酒	55,800	629,982.00	0.06
481	603786	科博达	11,200	620,592.00	0.06
482	600927	永安期货	39,300	582,033.00	0.06
483	002563	森马服饰	108,400	570,184.00	0.06
484	601061	中信金属	71,900	568,729.00	0.06
485	000539	粤电力 A	120,000	544,800.00	0.05
486	600007	中国国贸	26,400	543,312.00	0.05
487	600299	安迪苏	54,500	525,925.00	0.05
488	688819	天能股份	18,749	520,472.24	0.05
489	300140	节能环境	83,500	515,195.00	0.05
490	002945	华林证券	35,700	513,009.00	0.05
491	603826	坤彩科技	25,860	506,080.20	0.05
492	001213	中铁特货	113,000	458,780.00	0.04
493	601921	浙版传媒	56,100	452,166.00	0.04
494	601858	中国科传	20,600	400,670.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	11,852	367,530.52	0.04
496	601158	重庆水务	77,300	358,672.00	0.04
497	600956	新天绿能	41,411	319,692.92	0.03
498	001389	广合科技	4,900	287,973.00	0.03
499	688295	中复神鹰	13,619	283,275.20	0.03
500	603868	飞科电器	6,666	239,109.42	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
3	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
4	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00

5	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
6	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
7	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
8	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
9	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
10	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
11	603202	天有为	163	14,777.58	0.00
12	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
13	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
14	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
15	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
16	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
17	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
18	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
19	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
20	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
21	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
22	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
23	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
24	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
25	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
26	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
27	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
28	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
29	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
30	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
31	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
32	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
33	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
34	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
35	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
36	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
37	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
38	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
39	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
40	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	688608	恒玄科技	4,123,902.57	0.33

2	688235	百济神州	3,842,689.14	0.31
3	000933	神火股份	3,462,770.00	0.28
4	300450	先导智能	3,175,232.00	0.25
5	002130	沃尔核材	2,975,635.00	0.24
6	300454	深信服	2,946,384.10	0.24
7	300458	全志科技	2,931,433.00	0.24
8	600363	联创光电	2,817,292.00	0.23
9	300346	南大光电	2,711,568.60	0.22
10	002851	麦格米特	2,651,580.00	0.21
11	300115	长盈精密	2,585,726.00	0.21
12	300857	协创数据	2,581,150.80	0.21
13	300251	光线传媒	2,361,284.00	0.19
14	600171	上海贝岭	2,357,408.00	0.19
15	605589	圣泉集团	2,357,038.00	0.19
16	002007	华兰生物	2,332,833.00	0.19
17	603659	璞泰来	2,320,654.00	0.19
18	300627	华测导航	2,255,016.00	0.18
19	688027	国盾量子	2,177,901.97	0.17
20	000528	柳工	2,051,307.00	0.16

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002625	光启技术	11,495,496.00	0.92
2	600418	江淮汽车	10,325,936.00	0.83
3	002384	东山精密	8,426,602.00	0.68
4	301236	软通动力	6,227,392.00	0.50
5	300251	光线传媒	4,726,582.00	0.38
6	300866	安克创新	4,697,580.00	0.38
7	302132	中航成飞	4,273,749.00	0.34
8	002128	电投能源	4,162,510.34	0.33
9	688047	龙芯中科	3,471,096.32	0.28
10	300339	润和软件	2,867,720.00	0.23
11	002407	多氟多	2,698,583.80	0.22
12	000818	航锦科技	2,483,429.00	0.20
13	000988	华工科技	2,454,238.00	0.20
14	002202	金风科技	2,424,127.00	0.19
15	300476	胜宏科技	2,344,777.00	0.19
16	600642	申能股份	2,344,570.40	0.19
17	688536	思瑞浦	2,311,463.87	0.19
18	601567	三星医疗	2,308,652.00	0.19
19	002850	科达利	2,142,130.00	0.17
20	603444	吉比特	2,121,810.60	0.17

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	187,265,889.44
卖出股票收入（成交）总额	340,024,847.03

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,900.12	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,900.12	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	19	1,900.12	0.00

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

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。

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，东吴证券（601555）在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

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	3,770,986.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,770,986.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.01	新股锁定期内
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定期内
3	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股锁定期内
4	301458	钧崴电子	23,911.11	0.00	新股锁定期内
5	301275	汉朔科技	22,307.43	0.00	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
9,446	63,987.91	39,775,927.00	6.58	202,583,013.00	33.52	362,070,861.00	59.90

8.2 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	赵熙逸	33,875,378.00	5.60
2	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司—柏泰华盈常青藤套利 2 号私募证券投资基金	12,469,300.00	2.06
3	陈轶珺	3,564,000.00	0.59
4	横琴淳臻投资管理中心 (有限合伙) — 淳臻 FOF 成长 1 期私募证券投资基金	2,976,700.00	0.49
5	天津鸿道投资管理有	2,963,300.00	0.49

	限责任公司—天津鸿道—淳臻 FOF1 期私募证券投资基金		
6	王春燕	2,797,000.00	0.46
7	方正证券股份有限公司	2,670,969.00	0.44
8	中国人寿保险股份有限公司	1,912,300.00	0.32
9	王秋玲	1,878,600.00	0.31
10	香港中央结算有限公司	1,852,258.00	0.31
11	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	362,070,861.00	59.90

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

8.3 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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日）基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	770,929,801.00
本报告期基金总申购份额	90,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	256,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	604,429,801.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

经公司董事会审议通过，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。

基金托管人重大人事变动：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
广发证券	4	133,830,880.53	25.48	26,766.84	25.48	-

方正证券	2	113,485,499.66	21.60	22,699.06	21.60	-
银河证券	5	101,001,711.57	19.23	20,201.85	19.23	-
华泰证券	4	62,544,925.60	11.91	12,510.34	11.91	-
华鑫证券	1	42,634,096.25	8.12	8,527.81	8.12	-
中金公司	2	37,835,370.47	7.20	7,568.06	7.20	-
中信证券	4	33,265,505.44	6.33	6,653.54	6.33	-
申万宏源	2	693,195.53	0.13	138.68	0.13	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	3	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

(1) 具有相应的业务经营资格；

(2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；

(4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需

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

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

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

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，租用证券公司交易单元的变更情况：退租诚通证券、大同证券、华福证券、华龙证券、申港证券、天风证券、西南证券、湘财证券、长城证券、中银国际。

4、国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

5、国联证券股份有限公司与民生证券股份有限公司因重大资产重组。根据《国联民生证券股份有限公司关于公司名称及注册资本完成工商变更登记的公告》，自 2025 年 2 月 7 日起，国联证券股份有限公司中文名称变更为“国联民生证券股份有限公司”。

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 (%)
广发证券	468,411.08	90.34	-	-	-	-
方正证券	50,076.46	9.66	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下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 14 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 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 05 月 01 日
7	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指	证监会规定报刊和网站	2025 年 04 月 24 日

	数证券投资基金提供主做市服务的公告		
8	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
9	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 03 月 20 日
10	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 03 月 19 日
11	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 02 月 26 日
12	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 02 月 06 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 500 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 01 月 24 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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	20250101-20250630;	476,017,661.00	17,353,200.00	131,300,000.00	362,070,861.00	59.90
产品特有风险							
<p>本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金</p>							

将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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