

华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资 基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	80
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	80
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	80
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	80
§ 9 基金份额持有人信息	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3 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	82
§ 10 开放式基金份额变动	82
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8 其他重大事件	85
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	86
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	87
13.3 查阅方式	87

§ 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	354,034,654.90 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	290,069,988.43 份	63,964,666.47 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×95%+人民币活期存款税后利率×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 号楼 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄	深圳市深南大道 7088 号招商银

	证大五道口广场 1 号楼 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 21 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年 9 月 19 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 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	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	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	54,254,524.05	15,502,899.89	2,931,649.39	564,423.88	3,473,947.75	1,637,927.73
本期利润	65,853,437.52	18,651,241.32	3,797,478.94	903,812.05	-1,091,066.99	-500,651.14
加权平均基金份额本期利润	0.4683	0.4156	0.0236	0.0130	-0.0047	-0.0047
本期加权平均净值利润率	35.33%	32.67%	2.65%	1.46%	-0.47%	-0.47%

本期 基金 份额 净值 增长 率	41.25%	40.69%	5.89%	5.47%	-0.86%	-0.98%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末 可供 分配 利润	133,203,008.27	28,529,483.89	4,398,179.49	1,841,902.59	-1,734,231.02	-834,630.11
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.4592	0.4460	0.0498	0.0444	-0.0086	-0.0098
期末 基金 资产 净值	430,129,041.32	93,987,042.02	92,780,507.09	43,351,871.34	199,353,746.63	84,723,399.00
期末 基金 份额 净值	1.4828	1.4694	1.0498	1.0444	0.9914	0.9902
3.1. 3 累 计期 末指 标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	48.28%	46.94%	4.98%	4.44%	-0.86%	-0.98%

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

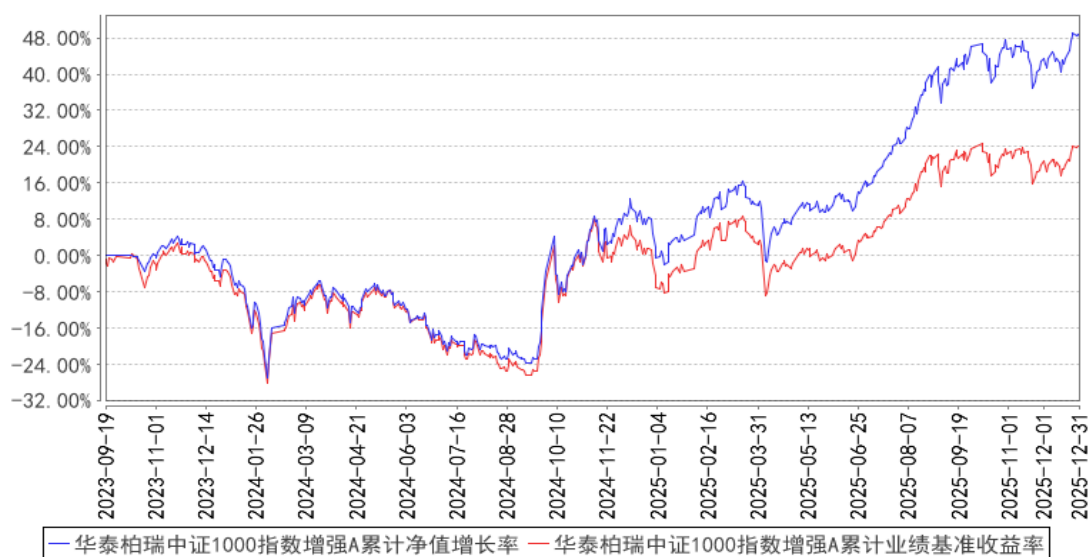
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.58%	1.16%	0.28%	1.07%	1.30%	0.09%
过去六个月	28.11%	1.11%	18.49%	1.06%	9.62%	0.05%
过去一年	41.25%	1.32%	26.12%	1.32%	15.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	48.28%	1.60%	23.99%	1.63%	24.29%	-0.03%

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

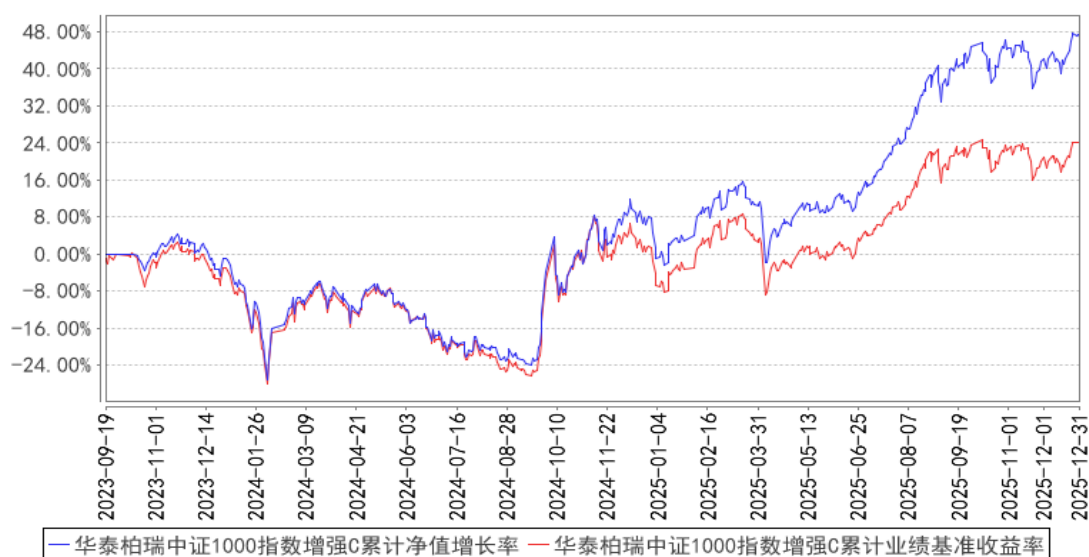
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.49%	1.16%	0.28%	1.07%	1.21%	0.09%
过去六个月	27.87%	1.11%	18.49%	1.06%	9.38%	0.05%
过去一年	40.69%	1.32%	26.12%	1.32%	14.57%	0.00%
自基金合同生效起至今	46.94%	1.60%	23.99%	1.63%	22.95%	-0.03%

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



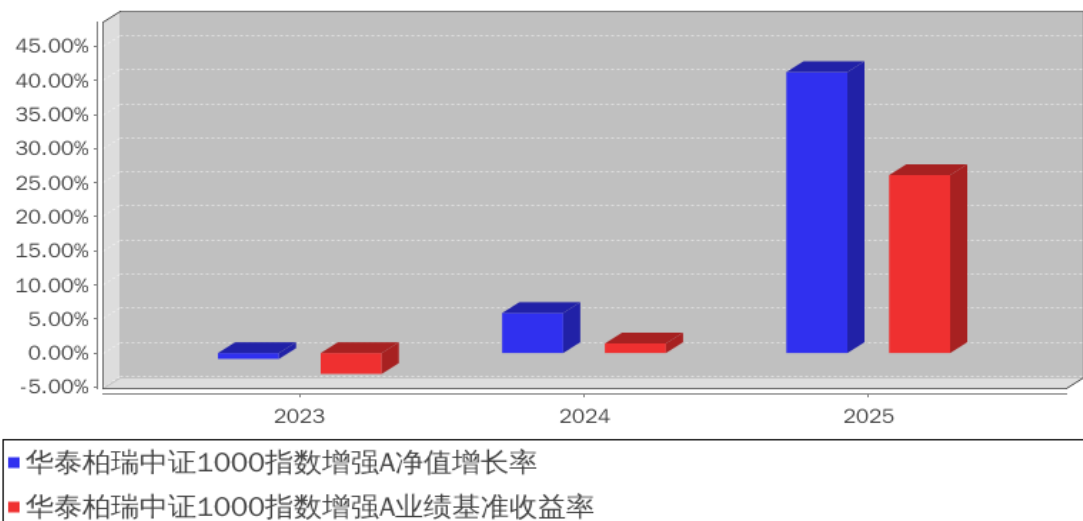
华泰柏瑞中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



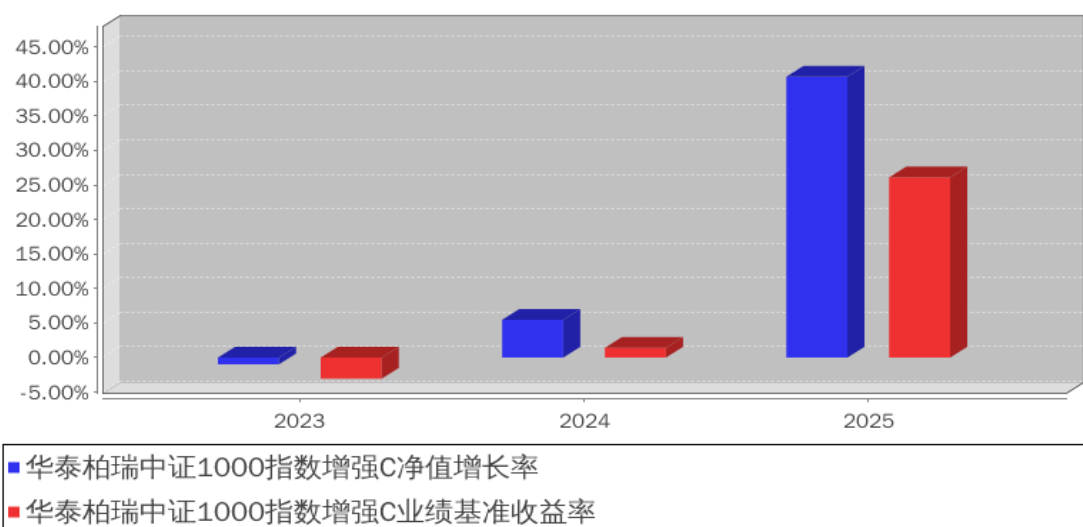
注：A类图示日期为2023年9月19日至2025年12月31日。C类图示日期为2023年9月19日至2025年12月31日。

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

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



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



注：基金合同生效日为 2023 年 9 月 19 日，2023 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批

准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成 为华泰证券股份有限公司、Heron View Partners LLC 和苏州新区高新技术产业股份有限公司， 出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2025 年 12 月 31 日，公司旗下管理 190 只基金，其中包括 股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
笪篁	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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资 基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基 金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最 大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损 害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 39 次，是指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年，A 股震荡攀升，上证指数一度站上 4000 点，主要指数均创出多年新高。年初 Deepseek 的出现大超市场预期，AI 引领科创行情贯穿全年。四月关税冲击造成出口产业链短期波动剧烈，同时也反映出中国经济的强大韧性。市场反弹持续到三季度末，此后进入区间震荡。年末随着海外流动性担忧逐渐消退，市场风险偏好再度提升。整体看，全年各板块虽有分化，但股市活跃度维持在高位。以人工智能和商业航天为代表的高科技板块表现较好，同时有色金属等资源品表现较为活跃，而红利和消费相关行业表现相对稳健。

本报告期，代表大市值公司的沪深 300 上涨 17.66%；代表中小市值公司的中证 500、中证 1000 和中证 2000 指数同期涨幅分别为 30.39%、27.49%和 36.42%。横向比较来看，股价弹性较大的中小市值公司，在本年度跑赢大市值和高股息类上市公司。

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 1.4828 元，本报告期基金份额净值增长率为 41.25%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%，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 1.4694 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.69%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，A 股市场面临的国内外不利因素预计将逐步减小。2025 年，尽管遭遇特朗普关税事件冲击，得益于新质生产力的提质增效和创新驱动，国内经济韧性进一步加强。我们预计央行将继续实行较为宽松的货币政策，企业和居民的信贷需求有望企稳回升。同时我们预期财政发力，以旧换新等扩内需政策将延续，并加强对科技创新等产业方向的引导。海外，美国的贸易与外交政策给全球经济发展带来不确定性，但中长期我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力。2025 年初以来，一系列突破性的自主创新科技成果，以及国内经济在各种宏观不确定中所展现的强大韧性，增强了市场对于中国经济的信心。在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的上升区间。

量化策略方面，在经历 2025 年底的震荡轮动之后，我们倾向于开年随着增量资金的进场，市场将逐渐走出分歧，酝酿新一轮上涨趋势。这期间，有主题热度以及基本面优秀的股票更容易受到资金的关注，也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 股市场整体估值合理，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规法律部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独

立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P01007 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年

	度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计

	准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	胡小骏	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 21 楼	
审计报告日期	2026 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
-----	-----	-------------------------	--------------------------

资 产:			
货币资金	7.4.7.1	53,149,777.75	12,208,738.81
结算备付金		4,753,056.50	426,646.47
存出保证金		3,425,928.00	571,756.80
交易性金融资产	7.4.7.2	458,709,898.41	123,381,633.19
其中：股票投资		458,709,898.41	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		39,060,970.78	377,053.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		559,099,631.44	136,965,828.48
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		34,301,946.09	538,298.60
应付管理人报酬		348,804.12	99,502.79
应付托管费		87,201.01	24,875.69
应付销售服务费		32,106.01	15,731.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,869.00	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	202,621.87	155,041.47
负债合计		34,983,548.10	833,450.05

净资产：			
实收基金	7.4.7.10	354,034,654.90	129,892,296.35
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	170,081,428.44	6,240,082.08
净资产合计		524,116,083.34	136,132,378.43
负债和净资产总计		559,099,631.44	136,965,828.48

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 354,034,654.90 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.4828 元，基金份额总额 290,069,988.43 份；下属 C 类基金份额净值 1.4694 元，基金份额总额 63,964,666.47 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		87,335,917.12	7,182,379.73
1. 利息收入		69,384.03	48,357.77
其中：存款利息收入	7.4.7.13	69,384.03	48,357.77
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）		68,591,859.73	5,546,486.34
其中：股票投资收益	7.4.7.14	63,338,739.34	1,828,887.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	3,493,440.76	1,409,220.12
股利收益	7.4.7.19	1,759,679.63	2,308,378.72
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	7.4.7.20	14,747,254.90	1,205,217.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	3,927,418.46	382,317.90
减：二、营业总支出		2,831,238.28	2,481,088.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,944,159.91	1,651,935.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	486,039.90	412,983.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	228,007.25	249,540.00
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		12,602.05	5,301.30
8. 其他费用	7.4.7.23	160,429.17	161,327.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		84,504,678.84	4,701,290.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		84,504,678.84	4,701,290.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		84,504,678.84	4,701,290.99

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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	129,892,296.35	-	6,240,082.08	136,132,378.43

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	224,142,358.55	-	163,841,346.36	387,983,704.91
(一)、综合收益总额	-	-	84,504,678.84	84,504,678.84
(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)	224,142,358.55	-	79,336,667.52	303,479,026.07
其中：1. 基金申购款	868,091,968.34	-	305,128,447.71	1,173,220,416.05
2. 基金赎回款	-643,949,609.79	-	-225,791,780.19	-869,741,389.98
(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	354,034,654.90	-	170,081,428.44	524,116,083.34
项目	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	-156,753,710.41	-	8,808,943.21	-147,944,767.20

(一)、综合收益总额	-	-	4,701,290.99	4,701,290.99
(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)	- 156,753,710.41	-	4,107,652.22	-152,646,058.19
其中：1. 基金申购款	88,388,686.44	-	-2,595,388.89	85,793,297.55
2. 基金赎回款	- 245,142,396.85	-	6,703,041.11	-238,439,355.74
(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	129,892,296.35	-	6,240,082.08	136,132,378.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 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)的资产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 2026 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并

未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，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。对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	53,149,777.75	12,208,738.81
等于：本金	53,146,344.07	12,207,871.66
加：应计利息	3,433.68	867.15
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	53,149,777.75	12,208,738.81

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		450,676,352.73	-	458,709,898.41	8,033,545.68
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		450,676,352.73	-	458,709,898.41	8,033,545.68
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		128,539,329.08	-	123,381,633.19	-5,157,695.89
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	128,539,329.08	-	123,381,633.19	-5,157,695.89

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	27,334,066.67	-	-	-
其中：股指期货投资	27,334,066.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	27,334,066.67	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,105,320.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,105,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,105,320.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2601	中证 1000 股指期货 2601	10.00	15,159,200.00	740,853.33
IM2603	中证 1000 股指期货 2603	9.00	13,390,200.00	474,480.00
合计				1,215,333.33
减：可抵销期货暂收款				1,215,333.33
净额				0.00

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

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	47,621.87	41.47
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	155,000.00	155,000.00
合计	202,621.87	155,041.47

7.4.7.10 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 12 月 31 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	733,133,364.70	733,133,364.70
本期赎回（以“-”号填列）	-531,445,703.87	-531,445,703.87
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	290,069,988.43	290,069,988.43

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 12 月 31 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	134,958,603.64	134,958,603.64

本期赎回（以“-”号填列）	-112,503,905.92	-112,503,905.92
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	63,964,666.47	63,964,666.47

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

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	54,254,524.05	11,598,913.47	65,853,437.52
本期基金份额交易产生的变动数	67,250,336.57	2,557,099.31	69,807,435.88
其中：基金申购款	242,790,120.30	17,216,940.60	260,007,060.90
基金赎回款	-175,539,783.73	-14,659,841.29	-190,199,625.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,203,008.27	6,856,044.62	140,059,052.89

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	15,502,899.89	3,148,341.43	18,651,241.32
本期基金份额交易产生的变动数	7,773,294.32	1,755,937.32	9,529,231.64
其中：基金申购款	41,836,065.56	3,285,321.25	45,121,386.81
基金赎回款	-34,062,771.24	-1,529,383.93	-35,592,155.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,529,483.89	1,492,891.66	30,022,375.55

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,274.00	34,440.05
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	26,110.03	13,917.72
其他	-	-
合计	69,384.03	48,357.77

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	63,338,739.34	1,828,887.50
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	63,338,739.34	1,828,887.50

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,171,711,888.81	2,647,505,930.70
减：卖出股票成本总额	2,106,137,583.57	2,642,624,008.87
减：交易费用	2,235,565.90	3,053,034.33
买卖股票差价收入	63,338,739.34	1,828,887.50

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——买卖债券差价收入。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

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

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	3,493,440.76	1,409,220.12

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,759,679.63	2,308,378.72
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	1,759,679.63	2,308,378.72

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	13,191,241.57	1,545,897.72
股票投资	13,191,241.57	1,545,897.72
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	1,556,013.33	-340,680.00
权证投资	-	-
期货投资	1,556,013.33	-340,680.00
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	14,747,254.90	1,205,217.72

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	3,921,558.26	377,912.75
基金转换费收入	5,860.20	4,405.15
合计	3,927,418.46	382,317.90

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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。

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。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00	35,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	5,429.17	6,327.49
合计	160,429.17	161,327.49

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

证券”)	
华泰柏瑞资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,944,159.91	1,651,935.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	796,138.79	693,402.40
应支付基金管理人的净管理费	1,148,021.12	958,533.56

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 X 0.80 % / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	486,039.90	412,983.99

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 X 0.20 % / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	69,743.04	69,743.04
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	277.28	277.28
合计	-	70,020.32	70,020.32
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期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	-	122,426.26	122,426.26
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	1,110.30	1,110.30
合计	-	123,536.56	123,536.56

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 0.40%的年费率计提，计算方法如下：

H = E X 0.40% ÷ 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	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	24,191,056.30	32,434.24	5,868,544.31	9,727.95

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日
--

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	301458	钧威电子	网下申购	4,203	43,711.20
华泰联合证券	603370	华新精科	网下申购	794	14,768.40
华泰联合证券	603092	德力佳	网下申购	1,150	53,682.00
华泰联合证券	688802	沐曦股份	网下申购	1,843	192,888.38
上年度可比期间					
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	4,562	71,577.78
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券	688726	拉普拉斯	网下申购	7,979	140,270.82
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	1,296	33,696.00
华泰联合证券	301606	绿联科技	网下申购	2,406	51,031.26
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	1,010	29,310.20
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	6,477	73,125.33
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	2,059	46,039.24
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	2,934	63,755.82

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	15.43	56.94	84	1,296.12	4,782.96	-
001233	海安	2025 年 11	6 个月	新股锁定	48.00	51.88	279	13,392.00	14,474.52	-

	集团	月 18 日		期内						
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	17.89	45.36	1,655	29,607.95	75,070.80	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	42.28	56.08	89	3,762.92	4,991.12	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	6.85	12.89	855	5,856.75	11,020.95	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	13.75	18.53	980	13,475.00	18,159.40	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	28.91	55.11	101	2,919.91	5,566.11	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大	2025 年 7 月	6 个月	新股锁定	14.66	40.99	167	2,448.22	6,845.33	-

	电 力	月 16 日		期 内						
301632	广 东 建 科	2025 年 8 月 5 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	6.56	23.68	326	2,138.56	7,719.68	-
301638	南 网 数 字	2025 年 11 月 11 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	5.69	14.21	1,736	9,877.84	24,668.56	-
301667	纳 百 川	2025 年 12 月 10 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊 创 瑞 通	2025 年 9 月 15 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新 广 益	2025 年 12 月 24 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道 生 天 合	2025 年 10 月 9 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德 力 佳	2025 年 10 月 30 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	46.68	55.66	115	5,368.20	6,400.90	-
603175	超 颖 电 子	2025 年 10 月 17 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡 华 科 技	2025 年 12 月 16 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603334	丰 倍 生 物	2025 年 10 月 29 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华 新	2025 年 8 月	6 个 月	新 股 锁 定	18.60	46.35	80	1,488.00	3,708.00	-

	精科	月 27 日		期内						
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	46.36	59.06	91	4,218.76	5,374.46	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	17.78	25.11	2,160	38,404.80	54,237.60	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	29.06	52.62	1,375	39,957.50	72,352.50	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	8.62	18.36	5,259	45,332.58	96,555.24	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	新股锁定期内	83.06	117.07	1,304	108,310.24	152,659.28	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月以上	新股锁定期内	114.28	416.02	1,624	185,590.72	675,616.48	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	26.68	42.25	409	10,912.12	17,280.25	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	新股锁定期内	104.66	399.40	1,198	125,382.68	478,481.20	-
688805	健信	2025 年 12 月	6 个月	新股锁定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-

	超导	月 17 日		期内						
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	85.09	203.31	158	13,444.22	32,122.98	-

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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为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，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	53,149,777.75	-	-	-	-	-	53,149,777.75
结算备付金	4,753,056.50	-	-	-	-	-	4,753,056.50
存出保证金	-	-	-	-	-	3,425,928.00	3,425,928.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	458,709,898.41	458,709,898.41
应收申购款	-	-	-	-	-	39,060,970.78	39,060,970.78
资产总计	57,902,834.25	-	-	-	-	501,196,797.19	559,099,631.44
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,301,946.09	34,301,946.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	348,804.12	348,804.12
应付托管费	-	-	-	-	-	87,201.01	87,201.01
应付销售服务	-	-	-	-	-	32,106.01	32,106.01

费							
应交税费	-	-	-	-	-	10,869.00	10,869.00
其他负债	-	-	-	-	-	202,621.87	202,621.87
负债总计	-	-	-	-	-	34,983,548.10	34,983,548.10
利率敏感度缺口	57,902,834.25	-	-	-	-	466,213,249.09	524,116,083.34
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	458,709,898.41	87.52	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	458,709,898.41	87.52	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 7.4.7.3）。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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	23,915,142.02	6,251,277.10
	业绩比较基准下降	-23,915,142.02	-6,251,277.10

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	456,801,858.45	122,893,609.78
第二层次	-	14,415.60
第三层次	1,908,039.96	473,607.81
合计	458,709,898.41	123,381,633.19

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。
--

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

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

期初余额	-	473,607.81	473,607.81
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	754,690.76	754,690.76
转出第三层次	-	642,983.32	642,983.32
当期利得或损失总额	-	1,322,724.71	1,322,724.71
其中：计入损益的利得或损失	-	1,322,724.71	1,322,724.71
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,908,039.96	1,908,039.96
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,186,538.29	1,186,538.29
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	150,364.24	150,364.24
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	305,230.95	305,230.95
转出第三层次	-	339,372.04	339,372.04
当期利得或损失总额	-	357,384.66	357,384.66
其中：计入损益的利得或损失	-	357,384.66	357,384.66
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	473,607.81	473,607.81
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	289,930.36	289,930.36

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2025 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	1,908,039.96	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1920~3.0323	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	473,607.81	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665~5.7444	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	458,709,898.41	82.04
	其中：股票	458,709,898.41	82.04
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	57,902,834.25	10.36
8	其他各项资产	42,486,898.78	7.60
9	合计	559,099,631.44	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	2,039,668.00	0.39
B	采矿业	19,912,523.80	3.80
C	制造业	308,653,082.93	58.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,204,110.00	0.80
E	建筑业	4,436,960.00	0.85
F	批发和零售业	12,915,912.44	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	6,057,730.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,971,800.56	8.96
J	金融业	17,727,610.00	3.38
K	房地产业	5,218,687.00	1.00
L	租赁和商务服务业	5,175,583.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	15,862,465.68	3.03
N	水利、环境和公共设施管理业	3,106,132.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,619,740.00	0.31
Q	卫生和社会工作	2,453,673.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	1,223,594.00	0.23
S	综合	1,130,626.00	0.22
	合计	458,709,898.41	87.52

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000555	神州信息	278,100	4,602,555.00	0.88

2	002612	朗姿股份	219,400	4,484,536.00	0.86
3	002222	福晶科技	76,100	4,287,474.00	0.82
4	300775	三角防务	139,300	4,234,720.00	0.81
5	301171	易点天下	103,400	4,187,700.00	0.80
6	002507	涪陵榨菜	318,500	4,111,835.00	0.78
7	002006	精工科技	164,400	3,807,504.00	0.73
8	601126	四方股份	126,100	3,793,088.00	0.72
9	301215	中汽股份	552,500	3,784,625.00	0.72
10	002004	华邦健康	782,900	3,742,262.00	0.71
11	300850	新强联	87,977	3,639,608.49	0.69
12	300438	鹏辉能源	67,600	3,597,672.00	0.69
13	300768	迪普科技	192,100	3,559,613.00	0.68
14	688498	源杰科技	5,518	3,542,500.82	0.68
15	000935	四川双马	141,200	3,507,408.00	0.67
16	603308	应流股份	81,600	3,406,800.00	0.65
17	301207	华兰疫苗	181,700	3,385,071.00	0.65
18	300573	兴齐眼药	47,700	3,352,833.00	0.64
19	002967	广电计量	151,500	3,334,515.00	0.64
20	300319	麦捷科技	282,500	3,302,425.00	0.63
21	300725	药石科技	84,400	3,254,464.00	0.62
22	603025	大豪科技	177,700	3,191,492.00	0.61
23	600338	西藏珠峰	212,200	3,191,488.00	0.61
24	688372	伟测科技	28,112	3,066,738.08	0.59
25	603358	华达科技	57,800	2,918,900.00	0.56
26	301031	中熔电气	25,500	2,860,845.00	0.55
27	002216	三全食品	252,500	2,850,725.00	0.54
28	600686	金龙汽车	160,000	2,838,400.00	0.54
29	002839	张家港行	611,800	2,795,926.00	0.53
30	601890	亚星锚链	271,400	2,792,706.00	0.53
31	300036	超图软件	151,700	2,754,872.00	0.53
32	002487	大金重工	52,700	2,736,711.00	0.52
33	002497	雅化集团	109,800	2,717,550.00	0.52
34	601963	重庆银行	246,800	2,672,844.00	0.51
35	301029	怡合达	100,300	2,659,956.00	0.51
36	001301	尚太科技	30,400	2,608,624.00	0.50
37	002950	奥美医疗	237,700	2,595,684.00	0.50
38	002516	旷达科技	387,000	2,550,330.00	0.49
39	688146	中船特气	62,594	2,528,797.60	0.48
40	688123	聚辰股份	20,000	2,511,600.00	0.48
41	603220	中贝通信	117,800	2,509,140.00	0.48
42	601069	西部黄金	94,000	2,507,920.00	0.48
43	000612	焦作万方	224,300	2,471,786.00	0.47
44	002545	东方铁塔	133,700	2,466,765.00	0.47

45	603496	恒为科技	89,500	2,441,560.00	0.47
46	600114	东睦股份	78,600	2,401,230.00	0.46
47	000603	盛达资源	77,400	2,396,304.00	0.46
48	300409	道氏技术	105,500	2,372,695.00	0.45
49	301316	慧博云通	52,900	2,363,572.00	0.45
50	002091	江苏国泰	261,400	2,360,442.00	0.45
51	600996	贵广网络	234,000	2,349,360.00	0.45
52	300428	立中集团	98,400	2,297,640.00	0.44
53	600773	西藏城投	184,800	2,289,672.00	0.44
54	600572	康恩贝	500,600	2,232,676.00	0.43
55	002075	沙钢股份	383,400	2,204,550.00	0.42
56	002941	新疆交建	138,200	2,190,470.00	0.42
57	002023	海特高新	161,600	2,188,064.00	0.42
58	000049	德赛电池	80,600	2,166,528.00	0.41
59	601038	一拖股份	152,800	2,165,176.00	0.41
60	603612	索通发展	91,000	2,138,500.00	0.41
61	603505	金石资源	114,200	2,133,256.00	0.41
62	301589	诺瓦星云	12,900	2,122,695.00	0.41
63	300008	天海防务	264,400	2,086,116.00	0.40
64	603283	赛腾股份	48,100	2,083,692.00	0.40
65	600645	中源协和	82,100	2,068,920.00	0.39
66	300620	光库科技	14,000	2,058,700.00	0.39
67	000581	威孚高科	99,800	2,057,876.00	0.39
68	002911	佛燃能源	169,400	2,053,128.00	0.39
69	000589	贵州轮胎	393,500	2,038,330.00	0.39
70	002279	久其软件	252,000	2,013,480.00	0.38
71	688400	凌云光	47,324	2,005,591.12	0.38
72	600618	氯碱化工	167,200	1,986,336.00	0.38
73	688209	英集芯	99,000	1,974,060.00	0.38
74	002020	京新药业	103,900	1,972,022.00	0.38
75	300034	钢研高纳	100,300	1,963,874.00	0.37
76	002096	易普力	146,600	1,952,712.00	0.37
77	688549	中巨芯	212,600	1,938,912.00	0.37
78	300047	天源迪科	153,600	1,927,680.00	0.37
79	603583	捷昌驱动	50,100	1,907,307.00	0.36
80	002803	吉宏股份	115,600	1,891,216.00	0.36
81	688352	顾中科技	149,760	1,888,473.60	0.36
82	300779	惠城环保	14,200	1,847,562.00	0.35
83	001287	中电港	80,500	1,824,130.00	0.35
84	603730	岱美股份	208,000	1,822,080.00	0.35
85	001203	大中矿业	58,600	1,796,090.00	0.34
86	688262	国芯科技	58,600	1,778,510.00	0.34
87	301297	富乐德	49,500	1,772,100.00	0.34

88	300184	力源信息	175,600	1,754,244.00	0.33
89	601519	大智慧	134,700	1,733,589.00	0.33
90	001337	四川黄金	62,100	1,730,106.00	0.33
91	688233	神工股份	24,600	1,722,738.00	0.33
92	601107	四川成渝	282,400	1,716,992.00	0.33
93	001309	德明利	7,400	1,715,986.00	0.33
94	002077	大港股份	114,800	1,707,076.00	0.33
95	603171	税友股份	30,900	1,703,517.00	0.33
96	688127	蓝特光学	43,400	1,670,466.00	0.32
97	688313	仕佳光子	18,800	1,669,064.00	0.32
98	300357	我武生物	57,300	1,624,455.00	0.31
99	300492	华图山鼎	21,800	1,619,740.00	0.31
100	300598	诚迈科技	35,200	1,618,144.00	0.31
101	300811	铂科新材	22,600	1,611,606.00	0.31
102	300595	欧普康视	109,000	1,601,210.00	0.31
103	688432	有研硅	128,600	1,595,926.00	0.30
104	300624	万兴科技	22,500	1,589,625.00	0.30
105	601326	秦港股份	451,800	1,576,782.00	0.30
106	301267	华夏眼科	85,950	1,545,381.00	0.29
107	300080	易成新能	314,400	1,527,984.00	0.29
108	000686	东北证券	163,900	1,527,548.00	0.29
109	003012	东鹏控股	233,100	1,526,805.00	0.29
110	000019	深粮控股	219,100	1,522,745.00	0.29
111	000902	新洋丰	97,300	1,519,826.00	0.29
112	605277	新亚电子	68,900	1,515,800.00	0.29
113	601163	三角轮胎	104,800	1,497,592.00	0.29
114	002593	日上集团	253,200	1,496,412.00	0.29
115	688698	伟创电气	15,096	1,492,692.48	0.28
116	600933	爱柯迪	73,900	1,485,390.00	0.28
117	600100	同方股份	165,300	1,474,476.00	0.28
118	300762	上海瀚讯	35,300	1,471,304.00	0.28
119	002975	博杰股份	18,800	1,447,600.00	0.28
120	300127	银河磁体	47,600	1,443,708.00	0.28
121	002626	金达威	73,200	1,442,772.00	0.28
122	000650	仁和药业	255,200	1,441,880.00	0.28
123	600596	新安股份	124,800	1,431,456.00	0.27
124	002192	融捷股份	27,600	1,428,300.00	0.27
125	002097	山河智能	113,800	1,412,258.00	0.27
126	688062	迈威生物	36,192	1,392,306.24	0.27
127	002654	万润科技	98,800	1,390,116.00	0.27
128	002151	北斗星通	29,700	1,349,271.00	0.26
129	605020	永和股份	50,000	1,344,500.00	0.26
130	600361	创新新材	313,100	1,327,544.00	0.25

131	600246	万通发展	107,200	1,318,560.00	0.25
132	300475	香农芯创	9,100	1,313,494.00	0.25
133	300296	利亚德	204,900	1,294,968.00	0.25
134	300693	盛弘股份	33,800	1,293,864.00	0.25
135	002233	塔牌集团	141,400	1,274,014.00	0.24
136	600750	江中药业	54,921	1,272,519.57	0.24
137	000636	风华高科	77,900	1,268,212.00	0.24
138	000923	河钢资源	59,100	1,251,147.00	0.24
139	688536	思瑞浦	7,800	1,247,064.00	0.24
140	300861	美畅股份	82,100	1,225,753.00	0.23
141	000892	欢瑞世纪	175,300	1,223,594.00	0.23
142	002396	星网锐捷	40,200	1,218,060.00	0.23
143	601369	陕鼓动力	121,600	1,217,216.00	0.23
144	603185	弘元绿能	39,900	1,216,950.00	0.23
145	002436	兴森科技	57,400	1,215,158.00	0.23
146	600333	长春燃气	217,900	1,204,987.00	0.23
147	600710	苏美达	111,300	1,203,153.00	0.23
148	688321	微芯生物	40,840	1,193,344.80	0.23
149	002635	安洁科技	85,900	1,190,574.00	0.23
150	688515	裕太微	11,600	1,189,580.00	0.23
151	603663	三祥新材	33,500	1,184,225.00	0.23
152	688584	上海合晶	53,600	1,175,984.00	0.22
153	688128	中国电研	40,400	1,174,832.00	0.22
154	688206	概伦电子	33,600	1,170,288.00	0.22
155	002807	江阴银行	254,600	1,163,522.00	0.22
156	688800	瑞可达	14,000	1,162,000.00	0.22
157	603323	苏农银行	230,000	1,161,500.00	0.22
158	000058	深赛格	123,500	1,160,900.00	0.22
159	300539	横河精密	27,600	1,159,752.00	0.22
160	301175	中科环保	196,200	1,159,542.00	0.22
161	002054	德美化工	157,100	1,159,398.00	0.22
162	000029	深深房 A	52,600	1,158,252.00	0.22
163	002276	万马股份	68,400	1,156,644.00	0.22
164	300068	南都电源	73,700	1,145,298.00	0.22
165	600210	紫江企业	155,800	1,145,130.00	0.22
166	603638	艾迪精密	60,300	1,141,479.00	0.22
167	301511	德福科技	31,800	1,138,122.00	0.22
168	000833	粤桂股份	58,100	1,130,626.00	0.22
169	600416	湘电股份	70,400	1,110,912.00	0.21
170	688365	光云科技	65,400	1,103,298.00	0.21
171	300308	中际旭创	1,800	1,098,000.00	0.21
172	002017	东信和平	46,000	1,025,800.00	0.20
173	688798	艾为电子	13,400	1,019,874.00	0.19

174	300139	晓程科技	33,500	1,017,060.00	0.19
175	301565	中仑新材	42,100	1,016,294.00	0.19
176	301487	盟固利	46,000	1,008,780.00	0.19
177	002916	深南电路	4,285	995,362.65	0.19
178	688025	杰普特	7,000	990,990.00	0.19
179	300801	泰和科技	35,700	986,391.00	0.19
180	603876	鼎胜新材	65,200	978,652.00	0.19
181	301205	联特科技	5,800	977,358.00	0.19
182	600552	凯盛科技	78,300	970,920.00	0.19
183	000712	锦龙股份	79,800	959,196.00	0.18
184	603083	剑桥科技	7,100	954,098.00	0.18
185	301086	鸿富瀚	8,500	951,065.00	0.18
186	688095	福昕软件	10,600	946,262.00	0.18
187	688779	五矿新能	126,200	945,238.00	0.18
188	301358	湖南裕能	14,400	931,104.00	0.18
189	688343	云天励飞	12,200	928,176.00	0.18
190	300009	安科生物	96,800	926,376.00	0.18
191	001267	汇绿生态	42,300	926,370.00	0.18
192	002011	盾安环境	71,800	910,424.00	0.17
193	301293	三博脑科	15,400	908,292.00	0.17
194	000400	许继电气	35,200	904,992.00	0.17
195	002668	TCL 智家	86,300	895,794.00	0.17
196	600292	电投水电	68,600	895,230.00	0.17
197	600861	北京人力	48,300	885,822.00	0.17
198	600926	杭州银行	57,900	884,712.00	0.17
199	300087	荃银高科	75,200	878,336.00	0.17
200	688048	长光华芯	7,000	877,450.00	0.17
201	002237	恒邦股份	65,100	873,642.00	0.17
202	000811	冰轮环境	46,700	864,884.00	0.17
203	301262	海看股份	33,900	843,771.00	0.16
204	002787	华源控股	67,200	836,640.00	0.16
205	002948	青岛银行	186,300	834,624.00	0.16
206	301109	军信股份	55,600	834,000.00	0.16
207	688435	英方软件	17,800	832,506.00	0.16
208	300171	东富龙	52,500	824,250.00	0.16
209	000338	潍柴动力	47,900	823,880.00	0.16
210	601678	滨化股份	192,600	816,624.00	0.16
211	002709	天赐材料	17,600	815,408.00	0.16
212	600201	生物股份	54,100	815,287.00	0.16
213	300259	新天科技	182,600	810,744.00	0.15
214	300841	康华生物	11,200	809,312.00	0.15
215	002562	兄弟科技	124,400	803,624.00	0.15
216	002511	中顺洁柔	92,500	791,800.00	0.15

217	002258	利尔化学	59,900	781,695.00	0.15
218	000952	广济药业	111,100	781,033.00	0.15
219	600155	华创云信	116,300	769,906.00	0.15
220	600125	铁龙物流	119,400	768,936.00	0.15
221	601211	国泰海通	37,100	762,405.00	0.15
222	002354	天娱数科	119,200	759,304.00	0.14
223	000333	美的集团	9,700	758,055.00	0.14
224	605060	联德股份	20,400	753,984.00	0.14
225	300049	福瑞医科	10,700	753,387.00	0.14
226	300303	聚飞光电	109,900	751,716.00	0.14
227	600257	太湖股份	118,900	746,692.00	0.14
228	600388	龙净环保	45,700	745,367.00	0.14
229	601187	厦门银行	99,900	733,266.00	0.14
230	002895	川恒股份	20,000	733,200.00	0.14
231	600428	中远海特	102,900	730,590.00	0.14
232	600478	科力远	106,000	730,340.00	0.14
233	300415	伊之密	27,800	724,468.00	0.14
234	301526	国际复材	102,600	718,200.00	0.14
235	301238	瑞泰新材	34,200	697,680.00	0.13
236	603039	泛微网络	13,000	696,020.00	0.13
237	002488	金固股份	78,500	690,015.00	0.13
238	002913	奥士康	16,100	688,114.00	0.13
239	600203	福日电子	50,900	679,006.00	0.13
240	688795	摩尔线程	1,624	675,616.48	0.13
241	002453	华软科技	106,300	672,879.00	0.13
242	301536	星辰科技	11,200	670,992.00	0.13
243	002741	光华科技	33,100	663,986.00	0.13
244	600120	浙江东方	107,400	662,658.00	0.13
245	600651	飞乐音响	90,600	660,474.00	0.13
246	301363	美好医疗	27,400	658,970.00	0.13
247	603915	国茂股份	34,900	642,509.00	0.12
248	002270	华明装备	25,600	641,024.00	0.12
249	600078	澄星股份	66,400	636,776.00	0.12
250	002062	宏润建设	67,900	628,075.00	0.12
251	300735	光弘科技	25,200	626,472.00	0.12
252	300378	鼎捷数智	13,800	624,588.00	0.12
253	600332	白云山	24,100	620,334.00	0.12
254	301061	匠心家居	6,400	606,720.00	0.12
255	000688	国城矿业	21,800	606,040.00	0.12
256	000155	川能动力	52,000	605,800.00	0.12
257	002755	奥赛康	36,800	600,944.00	0.11
258	600459	贵研铂业	32,200	599,242.00	0.11
259	688593	新相微	29,200	589,256.00	0.11

260	002307	北新路桥	115,800	584,790.00	0.11
261	600057	厦门象屿	67,900	578,508.00	0.11
262	301626	苏州天脉	3,100	577,530.00	0.11
263	002317	众生药业	30,200	573,196.00	0.11
264	002326	永太科技	22,800	568,176.00	0.11
265	002048	宁波华翔	18,000	566,280.00	0.11
266	600353	旭光电子	35,000	564,200.00	0.11
267	002434	万里扬	56,700	540,351.00	0.10
268	600507	方大特钢	91,400	538,346.00	0.10
269	600335	国机汽车	81,800	532,518.00	0.10
270	300407	凯发电气	45,700	517,324.00	0.10
271	002110	三钢闽光	114,600	503,094.00	0.10
272	300548	长芯博创	3,500	497,000.00	0.09
273	002489	浙江永强	129,500	495,985.00	0.09
274	603267	鸿远电子	8,900	484,427.00	0.09
275	688802	沐曦股份	1,198	478,481.20	0.09
276	000017	深中华 A	60,600	476,922.00	0.09
277	000599	青岛双星	72,000	476,640.00	0.09
278	002878	元隆雅图	26,100	475,542.00	0.09
279	603993	洛阳钼业	23,700	474,000.00	0.09
280	688390	固德威	7,600	472,188.00	0.09
281	002003	伟星股份	44,200	468,520.00	0.09
282	300341	麦克奥迪	28,500	465,690.00	0.09
283	601083	锦江航运	41,500	463,140.00	0.09
284	300938	信测标准	13,900	453,140.00	0.09
285	000681	视觉中国	19,000	452,390.00	0.09
286	688439	振华风光	7,000	452,200.00	0.09
287	300358	楚天科技	46,000	450,340.00	0.09
288	300748	金力永磁	13,200	450,252.00	0.09
289	600988	赤峰黄金	14,400	449,856.00	0.09
290	600760	中航沈飞	8,000	449,200.00	0.09
291	600654	中安科	119,100	449,007.00	0.09
292	002736	国信证券	34,200	448,704.00	0.09
293	002738	中矿资源	5,700	447,735.00	0.09
294	002281	光迅科技	6,400	447,680.00	0.09
295	002398	垒知集团	79,500	446,790.00	0.09
296	300499	高澜股份	14,500	444,860.00	0.08
297	300753	爱朋医疗	16,000	444,000.00	0.08
298	603556	海兴电力	12,000	436,800.00	0.08
299	688639	华恒生物	13,400	436,572.00	0.08
300	688403	汇成股份	26,200	429,156.00	0.08
301	300390	天华新能	7,800	425,958.00	0.08
302	002125	湘潭电化	29,700	420,552.00	0.08

303	688001	华兴源创	13,800	416,484.00	0.08
304	600097	开创国际	36,500	414,640.00	0.08
305	002490	山东墨龙	63,400	412,100.00	0.08
306	605196	华通线缆	11,800	409,932.00	0.08
307	300323	华灿光电	50,900	406,182.00	0.08
308	300394	天孚通信	2,000	406,060.00	0.08
309	301307	美利信	11,700	404,586.00	0.08
310	600063	皖维高新	68,500	403,465.00	0.08
311	002978	安宁股份	12,000	396,600.00	0.08
312	300236	上海新阳	6,200	395,312.00	0.08
313	300113	顺网科技	18,700	378,488.00	0.07
314	603162	海通发展	30,600	368,424.00	0.07
315	300769	德方纳米	8,300	365,283.00	0.07
316	603306	华懋科技	5,700	359,157.00	0.07
317	600075	新疆天业	71,400	353,430.00	0.07
318	600490	鹏欣资源	44,700	345,531.00	0.07
319	300031	宝通科技	15,100	343,223.00	0.07
320	688028	沃尔德	5,200	335,608.00	0.06
321	301219	腾远钴业	4,800	327,744.00	0.06
322	000543	皖能电力	38,500	306,075.00	0.06
323	002174	游族网络	25,000	306,000.00	0.06
324	688484	南芯科技	7,400	300,884.00	0.06
325	002946	新乳业	16,000	296,480.00	0.06
326	002645	华宏科技	19,700	288,408.00	0.06
327	300953	震裕科技	1,700	285,634.00	0.05
328	688031	星环科技	2,600	281,294.00	0.05
329	300363	博腾股份	12,000	278,880.00	0.05
330	301345	涛涛车业	1,100	276,452.00	0.05
331	002815	崇达技术	20,200	275,932.00	0.05
332	600403	大有能源	38,400	268,032.00	0.05
333	002333	罗普斯金	46,200	259,644.00	0.05
334	600269	赣粤高速	46,700	242,373.00	0.05
335	300464	星徽股份	37,800	239,652.00	0.05
336	300719	安达维尔	13,100	237,241.00	0.05
337	002176	江特电机	24,000	233,760.00	0.04
338	301678	新恒汇	3,600	231,192.00	0.04
339	300318	博晖创新	35,900	225,093.00	0.04
340	688582	芯动联科	3,400	224,774.00	0.04
341	601528	瑞丰银行	38,300	218,310.00	0.04
342	600323	瀚蓝环境	7,600	217,360.00	0.04
343	300418	昆仑万维	5,200	216,840.00	0.04
344	301000	肇民科技	5,500	216,535.00	0.04
345	600640	国脉文化	17,100	214,776.00	0.04

346	603043	广州酒家	11,800	208,034.00	0.04
347	002043	兔宝宝	14,400	207,504.00	0.04
348	002588	史丹利	19,700	196,606.00	0.04
349	301211	亨迪药业	15,800	193,076.00	0.04
350	300568	星源材质	12,600	192,150.00	0.04
351	300373	扬杰科技	2,800	190,400.00	0.04
352	002912	中新赛克	6,300	189,882.00	0.04
353	002947	恒铭达	3,600	187,272.00	0.04
354	688690	纳微科技	7,200	185,832.00	0.04
355	300803	指南针	1,400	183,218.00	0.03
356	600783	鲁信创投	7,400	183,002.00	0.03
357	001914	招商积余	17,000	181,560.00	0.03
358	688486	龙迅股份	2,400	178,344.00	0.03
359	300066	三川智慧	28,400	176,932.00	0.03
360	002390	信邦制药	53,200	171,304.00	0.03
361	605099	共创草坪	4,700	167,743.00	0.03
362	688559	海目星	3,400	163,404.00	0.03
363	600547	山东黄金	4,200	162,582.00	0.03
364	002287	奇正藏药	6,700	158,522.00	0.03
365	301458	钧崴电子	4,800	154,032.00	0.03
366	688790	昂瑞微	1,304	152,659.28	0.03
367	600641	先导基电	8,400	148,176.00	0.03
368	605118	力鼎光电	4,600	138,506.00	0.03
369	688525	佰维存储	1,200	137,748.00	0.03
370	301606	绿联科技	2,300	135,102.00	0.03
371	300063	天龙集团	15,400	131,978.00	0.03
372	002928	华夏航空	11,600	128,180.00	0.02
373	600094	大名城	29,200	121,472.00	0.02
374	002539	云图控股	10,100	119,382.00	0.02
375	002811	郑中设计	7,800	115,752.00	0.02
376	603280	南方路机	3,000	112,200.00	0.02
377	603859	能科科技	2,600	109,330.00	0.02
378	002557	洽洽食品	5,000	108,100.00	0.02
379	603909	建发合诚	9,500	107,255.00	0.02
380	300772	运达股份	5,500	104,830.00	0.02
381	688783	西安奕材	5,259	96,555.24	0.02
382	688319	欧林生物	3,600	91,296.00	0.02
383	300502	新易盛	200	86,176.00	0.02
384	688205	德科立	600	82,488.00	0.02
385	603026	石大胜华	1,100	82,291.00	0.02
386	300604	长川科技	800	81,048.00	0.02
387	002181	粤传媒	9,100	78,442.00	0.01
388	601061	中信金属	5,300	76,320.00	0.01

389	001280	中国铀业	1,655	75,070.80	0.01
390	601717	中创智领	3,000	73,650.00	0.01
391	688765	禾元生物	1,375	72,352.50	0.01
392	000012	南玻A	16,100	71,323.00	0.01
393	300770	新媒股份	1,500	63,615.00	0.01
394	688759	必贝特	2,160	54,237.60	0.01
395	002246	北化股份	2,900	52,258.00	0.01
396	000990	诚志股份	5,900	46,728.00	0.01
397	300416	苏试试验	2,600	46,384.00	0.01
398	300747	锐科激光	1,500	40,545.00	0.01
399	601872	招商轮船	4,500	40,410.00	0.01
400	000422	湖北宜化	2,800	39,788.00	0.01
401	000600	建投能源	4,000	34,120.00	0.01
402	002671	龙泉股份	6,500	34,060.00	0.01
403	688148	芳源股份	3,800	33,326.00	0.01
404	601375	中原证券	7,600	32,680.00	0.01
405	688809	强一股份	158	32,122.98	0.01
406	002275	桂林三金	2,200	31,020.00	0.01
407	603367	辰欣药业	1,600	27,712.00	0.01
408	300602	飞荣达	800	26,528.00	0.01
409	600113	浙江东日	400	25,268.00	0.00
410	301638	南网数字	1,736	24,668.56	0.00
411	600717	天津港	4,900	21,903.00	0.00
412	301095	广立微	300	21,513.00	0.00
413	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
414	001386	马可波罗	980	18,159.40	0.00
415	000758	中色股份	2,700	17,928.00	0.00
416	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
417	688796	百奥赛图	409	17,280.25	0.00
418	300199	翰宇药业	900	16,110.00	0.00
419	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
420	001233	海安集团	279	14,474.52	0.00
421	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
422	001369	双欣环保	855	11,020.95	0.00
423	601020	华钰矿业	400	10,744.00	0.00
424	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
425	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
426	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
427	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
428	301632	广东建科	326	7,719.68	0.00
429	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
430	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
431	301609	山大电力	167	6,845.33	0.00

432	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
433	603092	德力佳	115	6,400.90	0.00
434	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
435	301491	汉桑科技	101	5,566.11	0.00
436	603418	友升股份	91	5,374.46	0.00
437	001285	瑞立科密	89	4,991.12	0.00
438	001221	悍高集团	84	4,782.96	0.00
439	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
440	603370	华新精科	80	3,708.00	0.00
441	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
442	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
443	600728	佳都科技	400	2,672.00	0.00
444	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
445	000006	深振业 A	100	995.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300850	新强联	10,792,145.80	7.93
2	002222	福晶科技	10,198,840.46	7.49
3	688403	汇成股份	9,024,556.49	6.63
4	000657	中钨高新	8,651,436.40	6.36
5	002545	东方铁塔	8,163,532.00	6.00
6	300602	飞荣达	8,049,920.00	5.91
7	002006	精工科技	7,900,768.99	5.80
8	688146	中船特气	7,833,874.33	5.75
9	601126	四方股份	7,716,599.00	5.67
10	002487	大金重工	7,424,001.00	5.45
11	300672	国科微	7,256,108.00	5.33
12	002895	川恒股份	7,236,711.00	5.32
13	000603	盛达资源	7,077,941.00	5.20
14	601020	华钰矿业	6,782,389.80	4.98
15	603083	剑桥科技	6,759,829.00	4.97
16	300357	我武生物	6,725,352.00	4.94
17	688498	源杰科技	6,715,286.16	4.93
18	301171	易点天下	6,630,303.00	4.87
19	001309	德明利	6,597,683.60	4.85
20	605376	博迁新材	6,467,749.00	4.75
21	603876	鼎胜新材	6,467,497.00	4.75
22	002091	江苏国泰	6,448,038.00	4.74
23	001301	尚太科技	6,397,609.00	4.70
24	300475	香农芯创	6,258,573.00	4.60

25	000555	神州信息	6,239,015.00	4.58
26	603612	索通发展	6,229,619.00	4.58
27	002276	万马股份	6,075,644.00	4.46
28	688400	凌云光	6,040,350.95	4.44
29	301095	广立微	6,022,868.00	4.42
30	603533	掌阅科技	5,991,895.00	4.40
31	300166	东方国信	5,985,436.57	4.40
32	001287	中电港	5,949,421.00	4.37
33	002967	广电计量	5,876,139.00	4.32
34	688206	概伦电子	5,857,789.61	4.30
35	000061	农产品	5,840,304.40	4.29
36	301526	国际复材	5,816,125.00	4.27
37	000811	冰轮环境	5,706,023.13	4.19
38	002484	江海股份	5,657,374.00	4.16
39	688048	长光华芯	5,631,949.31	4.14
40	601519	大智慧	5,585,618.00	4.10
41	300678	中科信息	5,572,423.00	4.09
42	603236	移远通信	5,569,817.92	4.09
43	600933	爱柯迪	5,543,836.48	4.07
44	600114	东睦股份	5,470,097.00	4.02
45	000935	四川双马	5,460,425.00	4.01
46	300409	道氏技术	5,421,182.77	3.98
47	300779	惠城环保	5,397,024.00	3.96
48	301377	鼎泰高科	5,348,947.00	3.93
49	002020	京新药业	5,327,068.80	3.91
50	301219	腾远钴业	5,323,543.90	3.91
51	002901	大博医疗	5,315,374.00	3.90
52	600246	万通发展	5,314,789.30	3.90
53	688123	聚辰股份	5,304,804.05	3.90
54	688327	云从科技	5,302,150.26	3.89
55	002941	新疆交建	5,291,862.77	3.89
56	603699	纽威股份	5,248,693.00	3.86
57	601963	重庆银行	5,205,777.00	3.82
58	002668	TCL 智家	5,181,017.00	3.81
59	002317	众生药业	5,120,538.00	3.76
60	688629	华丰科技	5,113,899.25	3.76
61	002518	科士达	5,094,682.00	3.74
62	300775	三角防务	5,078,302.00	3.73
63	002100	天康生物	5,070,269.00	3.72
64	002335	科华数据	5,009,707.00	3.68
65	002612	朗姿股份	4,997,307.00	3.67
66	300811	铂科新材	4,980,167.00	3.66
67	002497	雅化集团	4,975,028.03	3.65

68	688209	英集芯	4,968,097.07	3.65
69	000025	特力A	4,966,261.00	3.65
70	001203	大中矿业	4,936,795.00	3.63
71	002182	宝武镁业	4,921,641.88	3.62
72	300666	江丰电子	4,887,638.00	3.59
73	002326	永太科技	4,882,869.00	3.59
74	000676	智度股份	4,882,785.00	3.59
75	603444	吉比特	4,864,740.00	3.57
76	300645	正元智慧	4,858,430.00	3.57
77	300438	鹏辉能源	4,840,621.00	3.56
78	300770	新媒股份	4,822,300.54	3.54
79	600338	西藏珠峰	4,800,339.00	3.53
80	301205	联特科技	4,760,663.20	3.50
81	001236	弘业期货	4,754,665.00	3.49
82	300953	震裕科技	4,740,546.00	3.48
83	300113	顺网科技	4,728,908.00	3.47
84	688018	乐鑫科技	4,720,355.35	3.47
85	300319	麦捷科技	4,702,768.00	3.45
86	688141	杰华特	4,659,425.55	3.42
87	002550	千红制药	4,635,142.00	3.40
88	300827	上能电气	4,557,892.00	3.35
89	301031	中熔电气	4,536,928.00	3.33
90	300013	新宁物流	4,525,601.00	3.32
91	300261	雅本化学	4,510,810.00	3.31
92	001258	立新能源	4,497,598.00	3.30
93	002023	海特高新	4,436,537.00	3.26
94	002015	协鑫能科	4,434,528.25	3.26
95	600961	株冶集团	4,433,045.00	3.26
96	603308	应流股份	4,420,222.00	3.25
97	603920	世运电路	4,399,941.34	3.23
98	300428	立中集团	4,399,273.99	3.23
99	000612	焦作万方	4,369,862.00	3.21
100	301029	怡合达	4,358,544.00	3.20
101	000058	深赛格	4,340,916.00	3.19
102	300682	朗新科技	4,338,546.00	3.19
103	300598	诚迈科技	4,323,478.15	3.18
104	601777	千里科技	4,286,320.00	3.15
105	301316	慧博云通	4,275,485.00	3.14
106	002192	融捷股份	4,233,827.00	3.11
107	000902	新洋丰	4,210,855.00	3.09
108	601208	东材科技	4,195,214.00	3.08
109	688321	微芯生物	4,182,049.58	3.07
110	300768	迪普科技	4,168,269.50	3.06

111	002507	涪陵榨菜	4,160,547.00	3.06
112	300925	法本信息	4,156,268.00	3.05
113	000756	新华制药	4,155,674.00	3.05
114	600201	生物股份	4,122,220.00	3.03
115	603171	税友股份	4,099,737.20	3.01
116	002706	良信股份	4,095,021.00	3.01
117	600596	新安股份	4,083,717.15	3.00
118	603306	华懋科技	4,082,478.00	3.00
119	301215	中汽股份	4,077,930.00	3.00
120	002468	申通快递	4,053,404.26	2.98
121	002925	盈趣科技	4,052,534.00	2.98
122	688630	芯碁微装	4,049,475.97	2.97
123	300036	超图软件	4,046,662.98	2.97
124	688536	思瑞浦	4,042,175.40	2.97
125	603698	航天工程	4,041,634.10	2.97
126	002820	桂发祥	4,036,830.00	2.97
127	300624	万兴科技	4,031,399.00	2.96
128	300573	兴齐眼药	4,009,424.00	2.95
129	002815	崇达技术	4,004,406.00	2.94
130	300236	上海新阳	3,996,985.00	2.94
131	600773	西藏城投	3,993,122.00	2.93
132	601326	秦港股份	3,985,255.00	2.93
133	002004	华邦健康	3,958,585.00	2.91
134	688062	迈威生物	3,938,499.63	2.89
135	300725	药石科技	3,926,238.24	2.88
136	002959	小熊电器	3,923,750.00	2.88
137	301511	德福科技	3,914,181.00	2.88
138	002516	旷达科技	3,909,049.00	2.87
139	603013	亚普股份	3,905,867.00	2.87
140	002216	三全食品	3,885,921.89	2.85
141	688336	三生国健	3,882,018.30	2.85
142	002396	星网锐捷	3,869,430.00	2.84
143	301606	绿联科技	3,866,390.00	2.84
144	002987	京北方	3,846,301.60	2.83
145	000988	华工科技	3,839,275.00	2.82
146	300772	运达股份	3,836,751.00	2.82
147	688372	伟测科技	3,832,536.83	2.82
148	300171	东富龙	3,810,177.00	2.80
149	600323	瀚蓝环境	3,792,032.10	2.79
150	300702	天宇股份	3,790,800.00	2.78
151	688484	南芯科技	3,756,048.59	2.76
152	601890	亚星锚链	3,746,281.00	2.75
153	688266	泽璟制药	3,724,768.05	2.74

154	603025	大豪科技	3,724,114.78	2.74
155	688091	上海谊众	3,720,869.07	2.73
156	688131	皓元医药	3,718,189.95	2.73
157	301078	孩子王	3,697,772.00	2.72
158	600996	贵广网络	3,684,042.00	2.71
159	688322	奥比中光	3,667,085.67	2.69
160	688352	硕中科技	3,645,989.64	2.68
161	002245	蔚蓝锂芯	3,619,945.00	2.66
162	002275	桂林三金	3,614,508.00	2.66
163	600641	先导基电	3,608,660.00	2.65
164	603583	捷昌驱动	3,608,136.00	2.65
165	688779	五矿新能	3,587,822.98	2.64
166	002215	诺普信	3,582,543.00	2.63
167	300363	博腾股份	3,559,271.00	2.61
168	600577	精达股份	3,534,139.00	2.60
169	603220	中贝通信	3,534,025.50	2.60
170	601311	骆驼股份	3,531,649.23	2.59
171	600475	华光环能	3,522,983.00	2.59
172	603283	赛腾股份	3,518,720.60	2.58
173	002268	电科网安	3,511,306.00	2.58
174	300570	太辰光	3,504,006.00	2.57
175	300620	光库科技	3,502,378.00	2.57
176	301207	华兰疫苗	3,491,163.00	2.56
177	300674	宇信科技	3,481,715.00	2.56
178	002204	大连重工	3,479,800.00	2.56
179	002368	太极股份	3,478,187.00	2.56
180	600059	古越龙山	3,477,218.99	2.55
181	601995	中金公司	3,471,762.00	2.55
182	002174	游族网络	3,440,752.00	2.53
183	601869	长飞光纤	3,437,810.00	2.53
184	688559	海目星	3,431,876.94	2.52
185	002354	天娱数科	3,427,048.00	2.52
186	600100	同方股份	3,427,039.00	2.52
187	000672	上峰水泥	3,406,423.00	2.50
188	601069	西部黄金	3,400,886.00	2.50
189	000049	德赛电池	3,400,244.50	2.50
190	300665	飞鹿股份	3,392,538.00	2.49
191	002378	章源钨业	3,379,480.90	2.48
192	002125	湘潭电化	3,365,479.00	2.47
193	600604	市北高新	3,354,655.00	2.46
194	002755	奥赛康	3,314,062.00	2.43
195	600728	佳都科技	3,311,181.00	2.43
196	301363	美好医疗	3,309,818.00	2.43

197	688200	华峰测控	3,303,165.61	2.43
198	002948	青岛银行	3,296,159.00	2.42
199	601083	锦江航运	3,294,034.00	2.42
200	002539	云图控股	3,293,714.00	2.42
201	301626	苏州天脉	3,289,374.00	2.42
202	002258	利尔化学	3,287,670.00	2.42
203	603516	淳中科技	3,287,475.00	2.41
204	002315	焦点科技	3,286,764.00	2.41
205	301297	富乐德	3,284,803.65	2.41
206	001337	四川黄金	3,281,622.62	2.41
207	300693	盛弘股份	3,278,152.15	2.41
208	000600	建投能源	3,268,888.00	2.40
209	301238	瑞泰新材	3,266,915.00	2.40
210	300593	新雷能	3,261,757.00	2.40
211	002803	吉宏股份	3,259,887.00	2.39
212	300972	万辰集团	3,240,640.00	2.38
213	002839	张家港行	3,228,493.00	2.37
214	688019	安集科技	3,216,603.06	2.36
215	300184	力源信息	3,215,359.00	2.36
216	688208	道通科技	3,213,298.50	2.36
217	603008	喜临门	3,196,889.00	2.35
218	603477	巨星农牧	3,181,649.00	2.34
219	688185	康希诺	3,174,248.82	2.33
220	600621	华鑫股份	3,169,951.00	2.33
221	002097	山河智能	3,167,858.76	2.33
222	600697	欧亚集团	3,161,212.00	2.32
223	300009	安科生物	3,154,631.00	2.32
224	002950	奥美医疗	3,148,258.00	2.31
225	300492	华图山鼎	3,114,983.40	2.29
226	002807	江阴银行	3,112,589.00	2.29
227	603937	丽岛新材	3,107,809.00	2.28
228	002008	大族激光	3,102,658.50	2.28
229	601628	中国人寿	3,101,969.00	2.28
230	000498	山东路桥	3,095,376.00	2.27
231	002654	万润科技	3,068,787.00	2.25
232	600850	电科数字	3,062,067.10	2.25
233	000969	安泰科技	3,052,175.00	2.24
234	688127	蓝特光学	3,041,773.11	2.23
235	600601	方正科技	3,035,794.00	2.23
236	300068	南都电源	3,030,852.94	2.23
237	600416	湘电股份	3,027,126.00	2.22
238	000581	威孚高科	3,023,456.50	2.22
239	600550	保变电气	3,023,260.00	2.22

240	600750	华润江中	3,011,115.96	2.21
241	688029	南微医学	3,007,580.21	2.21
242	600908	无锡银行	3,005,510.00	2.21
243	301327	华宝新能	3,004,823.52	2.21
244	600459	贵研铂业	3,004,238.00	2.21
245	002913	奥士康	3,000,383.00	2.20
246	600389	江山股份	2,997,143.10	2.20
247	300776	帝尔激光	2,991,386.00	2.20
248	688556	高测股份	2,984,600.17	2.19
249	688063	派能科技	2,979,944.38	2.19
250	003012	东鹏控股	2,978,485.00	2.19
251	300870	欧陆通	2,974,280.00	2.18
252	601137	博威合金	2,971,910.00	2.18
253	688433	华曙高科	2,966,562.73	2.18
254	601089	福元医药	2,960,772.00	2.17
255	300726	宏达电子	2,956,556.00	2.17
256	603063	禾望电气	2,951,711.00	2.17
257	002859	洁美科技	2,950,180.00	2.17
258	603616	韩建河山	2,933,400.00	2.15
259	300226	上海钢联	2,930,401.36	2.15
260	002233	塔牌集团	2,926,804.00	2.15
261	000758	中色股份	2,926,793.00	2.15
262	300049	福瑞医科	2,926,212.00	2.15
263	002075	沙钢股份	2,925,351.00	2.15
264	600057	厦门象屿	2,920,547.00	2.15
265	000586	汇源通信	2,914,246.00	2.14
266	300008	天海防务	2,914,037.00	2.14
267	301061	匠心家居	2,905,477.00	2.13
268	300470	中密控股	2,898,931.00	2.13
269	603496	恒为科技	2,884,180.00	2.12
270	300747	锐科激光	2,882,222.26	2.12
271	000686	东北证券	2,879,800.00	2.12
272	603026	石大胜华	2,861,105.00	2.10
273	688262	国芯科技	2,859,865.45	2.10
274	600159	大龙地产	2,858,429.00	2.10
275	600645	中源协和	2,857,649.00	2.10
276	000650	仁和药业	2,856,152.00	2.10
277	002237	恒邦股份	2,851,283.00	2.09
278	600507	方大特钢	2,839,441.00	2.09
279	300033	同花顺	2,838,666.00	2.09
280	300773	拉卡拉	2,828,484.00	2.08
281	600158	中体产业	2,824,711.00	2.07
282	688095	福昕软件	2,816,897.46	2.07

283	600330	天通股份	2, 816, 139. 00	2. 07
284	002096	易普力	2, 810, 964. 00	2. 06
285	002099	海翔药业	2, 808, 990. 00	2. 06
286	002537	海联金汇	2, 804, 536. 00	2. 06
287	688549	中巨芯	2, 794, 440. 38	2. 05
288	002017	东信和平	2, 793, 275. 00	2. 05
289	605020	永和股份	2, 789, 567. 20	2. 05
290	688432	有研硅	2, 786, 663. 90	2. 05
291	002916	深南电路	2, 763, 470. 00	2. 03
292	002588	史丹利	2, 762, 034. 00	2. 03
293	000923	河钢资源	2, 756, 512. 00	2. 02
294	002434	万里扬	2, 755, 291. 00	2. 02
295	600125	铁龙物流	2, 738, 723. 72	2. 01
296	300034	钢研高纳	2, 737, 859. 00	2. 01
297	600643	爱建集团	2, 734, 233. 00	2. 01
298	600623	华谊集团	2, 726, 545. 00	2. 00

注：不考虑相关交易费用。

8. 4. 2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000657	中钨高新	9, 456, 295. 00	6. 95
2	688403	汇成股份	9, 155, 293. 59	6. 73
3	300602	飞荣达	8, 805, 568. 31	6. 47
4	300850	新强联	8, 584, 422. 00	6. 31
5	603083	剑桥科技	7, 928, 188. 00	5. 82
6	300672	国科微	7, 522, 502. 00	5. 53
7	601020	华钰矿业	7, 487, 339. 00	5. 50
8	002545	东方铁塔	7, 170, 472. 00	5. 27
9	002222	福晶科技	7, 029, 721. 60	5. 16
10	002895	川恒股份	6, 586, 475. 04	4. 84
11	001309	德明利	6, 527, 063. 30	4. 79
12	301377	鼎泰高科	6, 504, 762. 00	4. 78
13	605376	博迁新材	6, 389, 578. 00	4. 69
14	301526	国际复材	6, 369, 420. 00	4. 68
15	603876	鼎胜新材	6, 311, 466. 20	4. 64
16	000061	农产品	6, 235, 886. 91	4. 58
17	603533	掌阅科技	6, 117, 116. 00	4. 49
18	300475	香农芯创	6, 101, 607. 00	4. 48
19	301095	广立微	5, 942, 564. 00	4. 37
20	300166	东方国信	5, 929, 651. 00	4. 36
21	300666	江丰电子	5, 920, 026. 00	4. 35
22	603699	纽威股份	5, 841, 100. 00	4. 29

23	002901	大博医疗	5,723,577.45	4.20
24	688146	中船特气	5,718,872.99	4.20
25	002484	江海股份	5,648,773.00	4.15
26	002518	科士达	5,619,866.00	4.13
27	688498	源杰科技	5,583,830.63	4.10
28	000025	特力 A	5,554,026.13	4.08
29	603236	移远通信	5,541,291.00	4.07
30	603444	吉比特	5,537,960.00	4.07
31	300357	我武生物	5,512,619.90	4.05
32	688048	长光华芯	5,479,719.22	4.03
33	300678	中科信息	5,411,754.50	3.98
34	301219	腾远钴业	5,365,729.18	3.94
35	000603	盛达资源	5,343,976.00	3.93
36	000811	冰轮环境	5,322,255.00	3.91
37	002487	大金重工	5,299,401.00	3.89
38	002276	万马股份	5,257,550.79	3.86
39	688327	云从科技	5,227,667.60	3.84
40	002100	天康生物	5,220,722.00	3.84
41	001236	弘业期货	5,179,849.00	3.81
42	002182	宝武镁业	5,140,870.86	3.78
43	688206	概伦电子	5,136,577.13	3.77
44	002550	千红制药	5,064,557.00	3.72
45	300261	雅本化学	5,041,464.00	3.70
46	000676	智度股份	4,965,565.00	3.65
47	002006	精工科技	4,962,094.00	3.65
48	688629	华丰科技	4,904,097.56	3.60
49	300827	上能电气	4,899,874.00	3.60
50	601208	东材科技	4,839,957.00	3.56
51	300770	新媒股份	4,834,068.00	3.55
52	300236	上海新阳	4,824,471.00	3.54
53	600961	株冶集团	4,777,841.00	3.51
54	002091	江苏国泰	4,756,737.00	3.49
55	300645	正元智慧	4,731,711.10	3.48
56	002326	永太科技	4,728,327.00	3.47
57	688336	三生国健	4,726,262.63	3.47
58	300953	震裕科技	4,725,275.60	3.47
59	603920	世运电路	4,706,507.42	3.46
60	688018	乐鑫科技	4,703,766.67	3.46
61	601126	四方股份	4,685,639.00	3.44
62	300702	天宇股份	4,646,271.00	3.41
63	600246	万通发展	4,569,306.55	3.36
64	601777	千里科技	4,552,752.00	3.34
65	001287	中电港	4,523,582.00	3.32

66	301205	联特科技	4,518,577.00	3.32
67	002015	协鑫能科	4,502,196.00	3.31
68	002987	京北方	4,467,248.00	3.28
69	300113	顺网科技	4,437,713.00	3.26
70	000988	华工科技	4,411,504.00	3.24
71	688630	芯碁微装	4,374,500.92	3.21
72	688400	凌云光	4,339,631.38	3.19
73	603013	亚普股份	4,322,651.00	3.18
74	300013	新宁物流	4,299,469.50	3.16
75	002378	章源钨业	4,288,884.00	3.15
76	603612	索通发展	4,283,550.00	3.15
77	002317	众生药业	4,277,578.00	3.14
78	600475	华光环能	4,242,380.01	3.12
79	000756	新华制药	4,238,892.00	3.11
80	002335	科华数据	4,218,526.95	3.10
81	300682	朗新科技	4,203,496.00	3.09
82	001258	立新能源	4,192,947.00	3.08
83	002245	蔚蓝锂芯	4,192,277.48	3.08
84	002706	良信股份	4,179,400.00	3.07
85	688019	安集科技	4,163,991.85	3.06
86	002204	大连重工	4,158,291.00	3.05
87	601519	大智慧	4,112,291.37	3.02
88	688131	皓元医药	4,096,873.60	3.01
89	301078	孩子王	4,096,777.39	3.01
90	300925	法本信息	4,090,790.30	3.01
91	002468	申通快递	4,087,933.00	3.00
92	688322	奥比中光	4,085,189.49	3.00
93	002820	桂发祥	4,083,638.00	3.00
94	002668	TCL 智家	4,066,613.00	2.99
95	603698	航天工程	4,037,662.10	2.97
96	688266	泽璟制药	4,019,539.35	2.95
97	688141	杰华特	4,017,645.49	2.95
98	002925	盈趣科技	3,987,995.00	2.93
99	600577	精达股份	3,938,096.00	2.89
100	001301	尚太科技	3,935,044.00	2.89
101	300772	运达股份	3,919,240.00	2.88
102	301606	绿联科技	3,823,257.21	2.81
103	600323	瀚蓝环境	3,818,129.00	2.80
104	002815	崇达技术	3,813,774.00	2.80
105	000969	安泰科技	3,810,541.00	2.80
106	600933	爱柯迪	3,809,173.00	2.80
107	300593	新雷能	3,793,505.00	2.79
108	688559	海目星	3,789,262.44	2.78

109	300674	宇信科技	3,786,439.00	2.78
110	300363	博腾股份	3,774,223.00	2.77
111	601311	骆驼股份	3,704,015.00	2.72
112	603306	华懋科技	3,688,465.00	2.71
113	600201	生物股份	3,682,986.00	2.71
114	002368	太极股份	3,678,860.91	2.70
115	600728	佳都科技	3,668,460.00	2.69
116	002268	电科网安	3,657,830.00	2.69
117	000672	上峰水泥	3,634,627.00	2.67
118	300570	太辰光	3,629,835.00	2.67
119	002125	湘潭电化	3,627,692.00	2.66
120	002959	小熊电器	3,624,461.91	2.66
121	600114	东睦股份	3,614,126.00	2.65
122	000758	中色股份	3,604,931.81	2.65
123	600604	市北高新	3,589,688.00	2.64
124	000600	建投能源	3,582,042.03	2.63
125	600550	保变电气	3,555,271.00	2.61
126	300747	锐科激光	3,541,800.00	2.60
127	002539	云图控股	3,532,045.00	2.59
128	600641	先导基电	3,518,409.00	2.58
129	002020	京新药业	3,506,371.40	2.58
130	002275	桂林三金	3,495,781.99	2.57
131	301511	德福科技	3,492,184.20	2.57
132	600850	电科数字	3,466,629.39	2.55
133	300665	飞鹿股份	3,454,495.00	2.54
134	688063	派能科技	3,447,753.58	2.53
135	002215	诺普信	3,446,748.00	2.53
136	300726	宏达电子	3,446,110.00	2.53
137	600059	古越龙山	3,433,863.00	2.52
138	601869	长飞光纤	3,422,662.00	2.51
139	600389	江山股份	3,420,401.10	2.51
140	000902	新洋丰	3,416,760.00	2.51
141	300811	铂科新材	3,416,037.00	2.51
142	000058	深赛格	3,415,428.00	2.51
143	688200	华峰测控	3,405,724.04	2.50
144	300972	万辰集团	3,388,656.00	2.49
145	002174	游族网络	3,380,056.00	2.48
146	601995	中金公司	3,370,429.00	2.48
147	002537	海联金汇	3,351,274.00	2.46
148	002967	广电计量	3,339,058.00	2.45
149	600601	方正科技	3,334,225.00	2.45
150	000917	电广传媒	3,332,369.00	2.45
151	002315	焦点科技	3,328,300.00	2.44

152	002023	海特高新	3,323,078.00	2.44
153	300035	中科电气	3,318,732.00	2.44
154	001203	大中矿业	3,310,608.00	2.43
155	688484	南芯科技	3,306,964.57	2.43
156	688091	上海谊众	3,272,672.57	2.40
157	002099	海翔药业	3,258,114.00	2.39
158	301171	易点天下	3,240,405.00	2.38
159	600697	欧亚集团	3,228,308.00	2.37
160	603477	巨星农牧	3,211,064.00	2.36
161	002941	新疆交建	3,193,554.00	2.35
162	002008	大族激光	3,192,645.86	2.35
163	002192	融捷股份	3,185,926.00	2.34
164	600621	华鑫股份	3,177,473.00	2.33
165	002859	洁美科技	3,161,650.00	2.32
166	605507	国邦医药	3,146,447.00	2.31
167	300598	诚迈科技	3,144,343.16	2.31
168	300079	数码视讯	3,131,303.00	2.30
169	300773	拉卡拉	3,130,852.00	2.30
170	000498	山东路桥	3,128,357.00	2.30
171	688185	康希诺	3,120,449.83	2.29
172	601628	中国人寿	3,119,027.00	2.29
173	688209	英集芯	3,115,362.02	2.29
174	000950	重药控股	3,114,397.00	2.29
175	000586	汇源通信	3,098,351.30	2.28
176	300779	惠城环保	3,094,733.00	2.27
177	688183	生益电子	3,094,679.59	2.27
178	688556	高测股份	3,092,995.00	2.27
179	603616	韩建河山	3,090,334.00	2.27
180	600908	无锡银行	3,087,726.00	2.27
181	688208	道通科技	3,074,439.26	2.26
182	300870	欧陆通	3,073,968.00	2.26
183	300226	上海钢联	3,057,097.99	2.25
184	600330	天通股份	3,055,041.00	2.24
185	688536	思瑞浦	3,053,875.90	2.24
186	300548	长芯博创	3,048,654.00	2.24
187	603008	喜临门	3,042,039.00	2.23
188	600158	中体产业	3,040,617.33	2.23
189	300171	东富龙	3,031,237.00	2.23
190	603937	丽岛新材	3,029,919.00	2.23
191	300130	新国都	2,972,962.05	2.18
192	600682	南京新百	2,966,244.00	2.18
193	603516	淳中科技	2,947,563.00	2.17
194	603063	禾望电气	2,944,328.00	2.16

195	688433	华曙高科	2,941,301.46	2.16
196	600643	爱建集团	2,940,898.00	2.16
197	688123	聚辰股份	2,938,412.95	2.16
198	688779	五矿新能	2,934,810.29	2.16
199	301238	瑞泰新材	2,933,578.25	2.15
200	300409	道氏技术	2,904,891.00	2.13
201	600623	华谊集团	2,900,541.00	2.13
202	002258	利尔化学	2,894,287.00	2.13
203	300257	开山股份	2,894,283.00	2.13
204	301626	苏州天脉	2,868,845.92	2.11
205	601089	福元医药	2,862,127.00	2.10
206	688029	南微医学	2,859,730.87	2.10
207	002588	史丹利	2,849,894.18	2.09
208	002226	江南化工	2,845,179.00	2.09
209	603026	石大胜华	2,844,810.00	2.09
210	300776	帝尔激光	2,839,733.00	2.09
211	601083	锦江航运	2,834,498.00	2.08
212	601963	重庆银行	2,821,945.00	2.07
213	300083	创世纪	2,814,510.00	2.07
214	603171	税友股份	2,809,975.00	2.06
215	601022	宁波远洋	2,798,505.97	2.06
216	300470	中密控股	2,796,277.00	2.05
217	605090	九丰能源	2,793,917.00	2.05
218	002497	雅化集团	2,782,801.46	2.04
219	688088	虹软科技	2,768,372.48	2.03
220	688116	天奈科技	2,766,973.46	2.03
221	688321	微芯生物	2,755,442.50	2.02
222	600459	贵研铂业	2,739,503.70	2.01
223	600596	新安股份	2,734,637.40	2.01
224	000685	中山公用	2,725,078.00	2.00

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,428,274,607.22
卖出股票收入（成交）总额	2,171,711,888.81

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,425,928.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,060,970.78
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,486,898.78

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	2,359	122,963.12	11,077,247.60	3.82	278,992,740.83	96.18
华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	1,914	33,419.37	1,449,248.33	2.27	62,515,418.14	97.73
合计	4,203	84,233.80	12,526,495.93	3.54	341,508,158.97	96.46

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）。

9.2 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	0.00	0.0000

	合计	0.00	0.0000
--	----	------	--------

9.3 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

§ 10 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	733,133,364.70	134,958,603.64
减：本报告期基金总赎回份额	531,445,703.87	112,503,905.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	290,069,988.43	63,964,666.47

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动： 经公司董事会审议通过，田汉卿女士于 2025 年 4 月 30 日起不再担任公司副总经理。 经公司董事会审议通过，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司总经理，董事长贾波先

生代为履行总经理职责。

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

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

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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 35,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门调查或处罚。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人未受监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金财富证券	3	4,597,340,204.16	100.00	854,638.64	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研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

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

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

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

要；

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

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1) 公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核

的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成交 总额的 比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例 (%)	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比 例 (%)
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 12 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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 12 月 10 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范以教育机构退费为由诱导转账诈骗的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 12 月 09 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 12 月 02 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 11 月 20 日
6	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	证监会规定报刊和网站	2025 年 10 月 31 日

	券的公告		
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 10 月 29 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 09 月 05 日
9	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 08 月 28 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 06 月 04 日
11	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
12	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
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 10 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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
15	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日