

华泰柏瑞北证 50 成份指数型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞北证 50 成份指数
基金主代码	023659
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 22 日
报告期末基金份额总额	79,610,138.61 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、资产配置策略：在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大； 2、股票（含存托凭证）投资策略； 3、衍生品投资策略：（1）股指期货投资策略（2）股票期权投资策略； 4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	北证 50 成份指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本

	一致。		
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司		
基金托管人	广发证券股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞北证 50 成份指数 A	华泰柏瑞北证 50 成份指数 C	华泰柏瑞北证 50 成份指数 I
下属分级基金的交易代码	023659	023660	023661
报告期末下属分级基金的份额总额	16,666,875.92 份	54,077,132.30 份	8,866,130.39 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）		
	华泰柏瑞北证 50 成份指数 A	华泰柏瑞北证 50 成份指数 C	华泰柏瑞北证 50 成份指数 I
1. 本期已实现收益	-283,127.96	-1,030,828.98	-153,740.13
2. 本期利润	-716,308.63	462,828.76	174,108.19
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0555	0.0073	0.0184
4. 期末基金资产净值	15,004,925.86	48,505,709.77	7,972,603.08
5. 期末基金份额净值	0.9003	0.8970	0.8992

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。

3.2 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

华泰柏瑞北证 50 成份指数 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.74%	1.89%	0.28%	1.94%	0.46%	-0.05%
过去六个月	-11.78%	1.84%	-12.42%	1.87%	0.64%	-0.03%
过去一年	-13.19%	1.71%	-12.73%	1.74%	-0.46%	-0.03%
自基金合同	-9.97%	1.67%	-7.63%	1.74%	-2.34%	-0.07%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

华泰柏瑞北证 50 成份指数 C

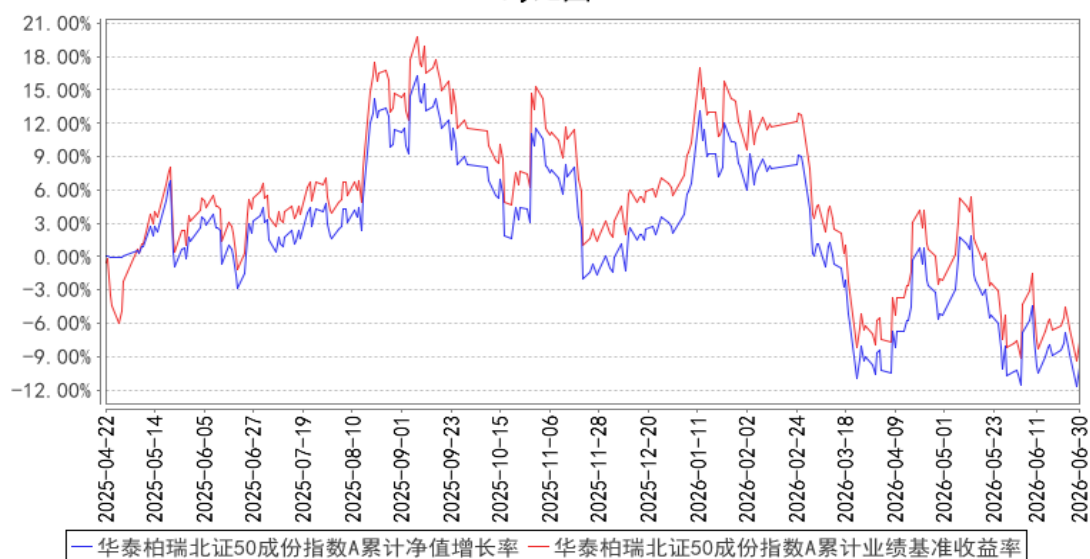
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.66%	1.89%	0.28%	1.94%	0.38%	-0.05%
过去六个月	-11.91%	1.84%	-12.42%	1.87%	0.51%	-0.03%
过去一年	-13.46%	1.71%	-12.73%	1.74%	-0.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-10.30%	1.67%	-7.63%	1.74%	-2.67%	-0.07%

华泰柏瑞北证 50 成份指数 I

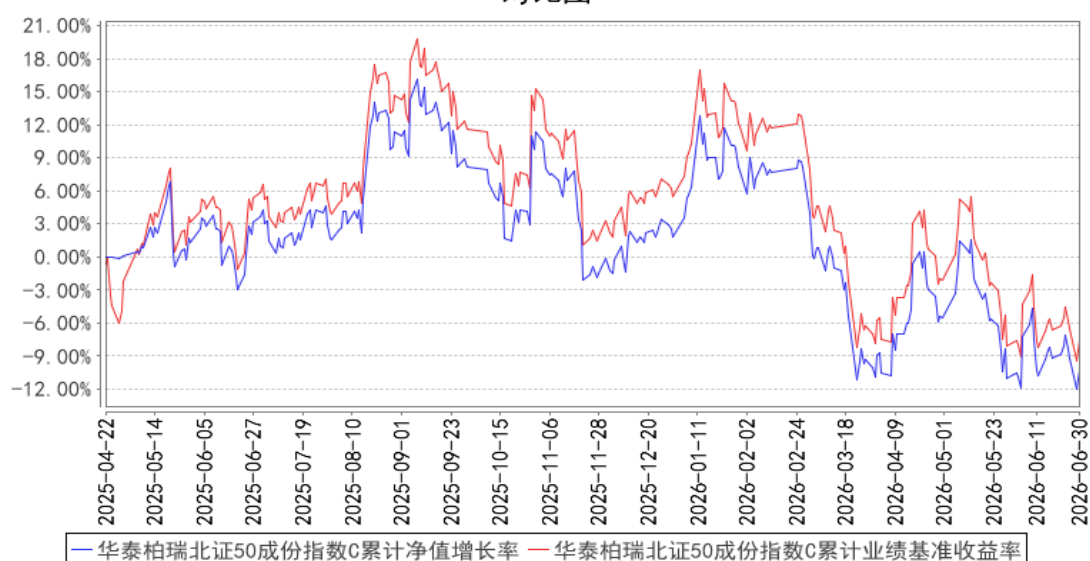
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.72%	1.89%	0.28%	1.94%	0.44%	-0.05%
过去六个月	-11.83%	1.84%	-12.42%	1.87%	0.59%	-0.03%
过去一年	-13.28%	1.71%	-12.73%	1.74%	-0.55%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-10.08%	1.67%	-7.63%	1.74%	-2.45%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

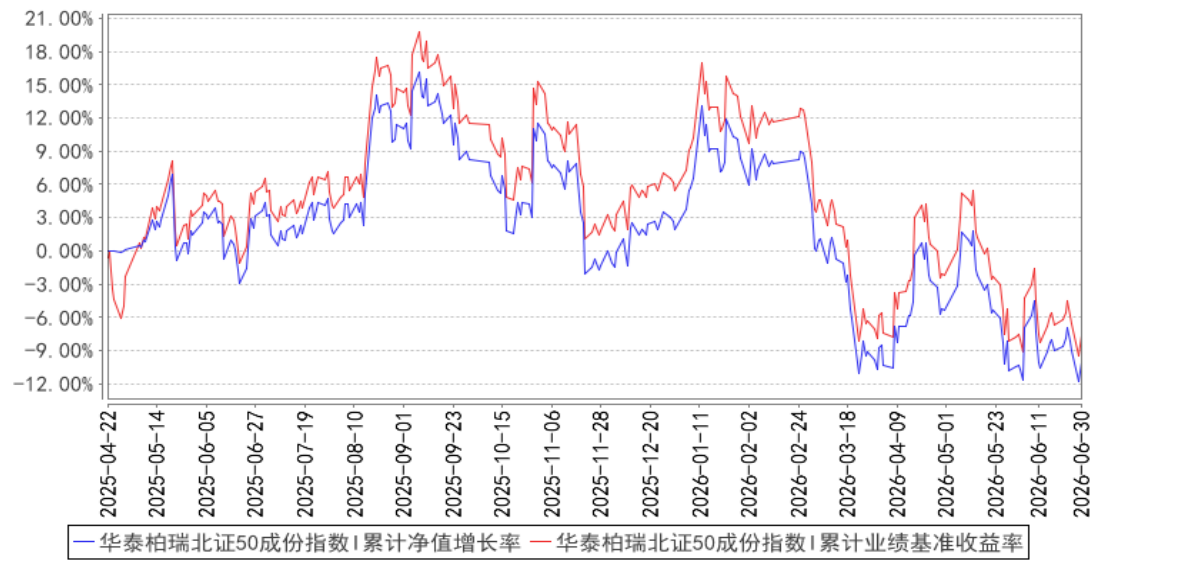
华泰柏瑞北证50成份指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势
对比图



华泰柏瑞北证50成份指数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



华泰柏瑞北证50成份指数I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：1、A 类图示日期为 2025 年 4 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2025 年 4 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日。I 类图示日期为 2025 年 4 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡亦清	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2025 年 4 月 22 日	-	12 年	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开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞北证 50 成份指数型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型

					开放式指数证券投资基金的基金经理。 2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证全指自由 现金流交易型开放式指数证券投资基金 联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
胡亦清	公募基金	9	7,549,196,369.65	2025 年 1 月 23 日
	私募资产管理计划	5	1,918,799,329.93	2023 年 10 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	14	9,467,995,699.58	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 4 次，是指数或量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金以完全复制北证 50 指数为投资策略，产品回报主要取决于业绩比较基准收益率。2026 年二季度 A 股市场整体延续结构分化特征，资金主要集中于通信设备、半导体、存储等少数高景

气成长方向，市场风险偏好虽较一季度有所修复，但并未向小市值和北交所板块充分扩散。北证 50 指数在一季度大幅回撤后，二季度整体呈现低位震荡、脉冲反弹的特征，4 月在政策预期和超跌反弹推动下有所回升，5 月后市场主线重新向大市值科技成长资产集中，北交所市场成交活跃度和资金关注度仍受压制，6 月虽出现阶段性快速拉升，但持续性仍有待进一步验证。

与主板主要宽基指数相比，北证 50 指数行情仍相对独立，当前北交所上市公司数量持续增加，专精特新、高端制造、半导体设备、汽车零部件、新材料等方向的资产供给仍在改善，指数长期成长属性并未发生变化。考虑到北交所整体体量仍较小，若后续市场风格由少数 AI 龙头向中小成长扩散，或政策端在推动北交所高质量发展方面有增量政策，北证 50 指数的修复空间有望逐步打开。总体来看，短期北证 50 指数仍可能受到流动性和市场情绪扰动，但经过连续调整后，指数配置价值较一季度末或有所提升，可继续关注后续风格扩散和市场活跃度修复情况。

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 0.047%，期间日跟踪误差为 0.067%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞北证 50 成份指数 A 的基金份额净值为 0.9003 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%，截至本报告期末华泰柏瑞北证 50 成份指数 C 的基金份额净值为 0.8970 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%，截至本报告期末华泰柏瑞北证 50 成份指数 I 的基金份额净值为 0.8992 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	67,108,985.95	91.06
	其中：股票	67,108,985.95	91.06
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	5,080,092.59	6.89
8	其他资产	1,506,815.66	2.04
9	合计	73,695,894.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	1,058,841.25	1.48
C	制造业	57,927,495.02	81.04
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	876,660.24	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,567,373.84	9.19
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	678,615.60	0.95
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	67,108,985.95	93.88

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	920438	戈碧迦	42,680	6,780,144.80	9.48
2	920185	贝特瑞	166,964	4,154,064.32	5.81
3	920982	锦波生物	22,506	2,835,530.94	3.97
4	920077	吉林碳谷	143,681	2,548,900.94	3.57
5	920808	曙光数创	29,339	2,514,352.30	3.52
6	920599	同力股份	135,698	2,234,946.06	3.13
7	920368	连城数控	74,117	2,164,957.57	3.03
8	920809	安达科技	234,336	2,092,620.48	2.93
9	920116	星图测控	32,813	2,089,859.97	2.92
10	920394	民士达	28,605	1,972,314.75	2.76

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,506,815.66
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	1,506,815.66

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞北证 50 成份指数 A	华泰柏瑞北证 50 成份指数 C	华泰柏瑞北证 50 成份指数 I
报告期期初基金份额总额	7,836,107.35	62,307,786.68	9,249,748.82
报告期期间基金总申购份额	13,298,014.19	53,406,662.03	7,780,394.68
减:报告期期间基金总赎回份额	4,467,245.62	61,637,316.41	8,164,013.11
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	16,666,875.92	54,077,132.30	8,866,130.39

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 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 7 月 21 日