

华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金
(原华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型
证券投资基金转型)
2026 年中期报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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。

华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金由华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金变更而来。本基金管理人于 2026 年 4 月 30 日至 2026 年 6 月 1 日以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2026 年 6 月 2 日审议并通过了《关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金有关事项的议案》。自 2026 年 6 月 12 日起，《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》等法律文件生效。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，转型前报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 11 日止，转型后报告期自 2026 年 6 月 12 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料(转型后)	8
2.5 其他相关资料(转型前)	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	9
3.2 基金净值表现（转型后）	10
3.2 基金净值表现（转型前）	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 净资产变动表	21
6.4 报表附注	22
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	54
6.1 资产负债表	54
6.2 利润表	55
6.3 净资产变动表	57

6.4 报表附注	59
§7 投资组合报告（转型后）	86
7.1 期末基金资产组合情况	86
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	87
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	87
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	93
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	95
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	95
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	95
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	95
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	95
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	95
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	95
7.12 投资组合报告附注	95
§7 投资组合报告（转型前）	96
7.1 期末基金资产组合情况	96
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	97
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	97
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	103
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	105
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	105
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	105
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	105
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	105
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	105
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	105
7.12 投资组合报告附注	105
§8 基金份额持有人信息（转型后）	106
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	106
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	107
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	107
§8 基金份额持有人信息（转型前）	107
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	107
8.2 盈利投资者数量占比	108
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	108
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	108
§9 开放式基金份额变动（转型后）	108
§9 开放式基金份额变动（转型前）	109
§10 重大事件揭示	109
10.1 基金份额持有人大会决议	109

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	109
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	110
10.4 基金投资策略的改变	110
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	110
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	110
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型后)	111
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型前)	114
10.8 其他重大事件(转型后)	118
10.8 其他重大事件(转型前)	118
§11 影响投资者决策的其他重要信息	119
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	119
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	119
§12 备查文件目录.....	119
12.1 备查文件目录	119
12.2 存放地点	120
12.3 查阅方式	120

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞沪深 300 指数增强	
基金主代码	001074	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 6 月 12 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	230,365,128.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	001074	006531
报告期末下属分级 基金的份额总额	173,663,871.24 份	56,701,257.31 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化驱动混合	
基金主代码	001074	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 24 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	230,364,237.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C
下属分级基金的交 易代码	001074	006531
报告期末下属分级 基金的份额总额	177,075,593.27 份	53,288,644.65 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
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。本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间

	的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、衍生品投资策略；6、融资及转融通证券出借业务的投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+活期存款基准利率*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。 本基金还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%*沪深 300 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818
法定代表人		贾波	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告置备地点	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(转型后)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
和指标	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	4, 547, 295. 25	1, 405, 721. 57
本期利润	23, 152, 347. 62	7, 023, 596. 43
加权平均基金份 额本期利润	0. 1320	0. 1281
本期加权平均净 值利润率	6. 72%	6. 60%
本期基金份额净 值增长率	7. 00%	7. 00%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	170, 853, 996. 53	48, 822, 864. 21
期末可供分配基 金份额利润	0. 9838	0. 8611
期末基金资产净 值	347, 560, 982. 00	112, 131, 107. 75
期末基金份额净 值	2. 0013	1. 9776
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	7.00%	7.00%
-------------	-------	-------

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。

4、本基金转型后基金合同于 2026 年 6 月 12 日起生效。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 11 日)	
	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C
本期已实现收益	35,415,467.91	9,614,897.45
本期利润	22,139,839.85	5,399,037.19
加权平均基金份额本期利润	0.1120	0.1065
本期加权平均净值利润率	6.09%	5.85%
本期基金份额净值增长率	5.78%	5.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 11 日)	
	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C
期末可供分配利润	154,112,079.25	44,525,139.78
期末可供分配基金份额利润	0.8703	0.8355
期末基金资产净值	331,187,672.52	98,493,116.21
期末基金份额净值	1.8703	1.8483
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 11 日)	

基金份额累计净值增长率	87.03%	109.23%
-------------	--------	---------

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（转型后）

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

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A

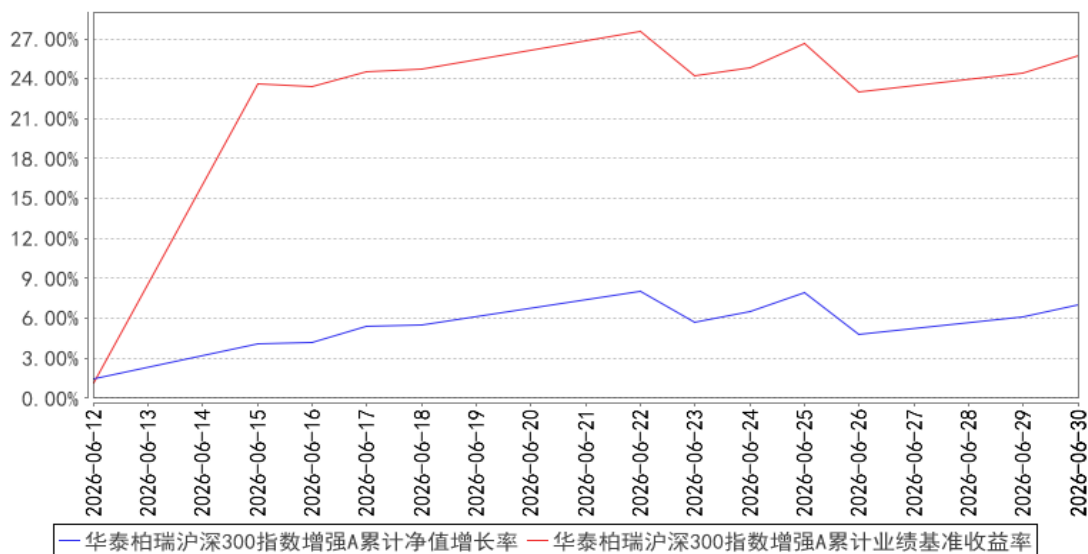
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	7.00%	1.65%	5.17%	1.65%	1.83%	0.00%

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C

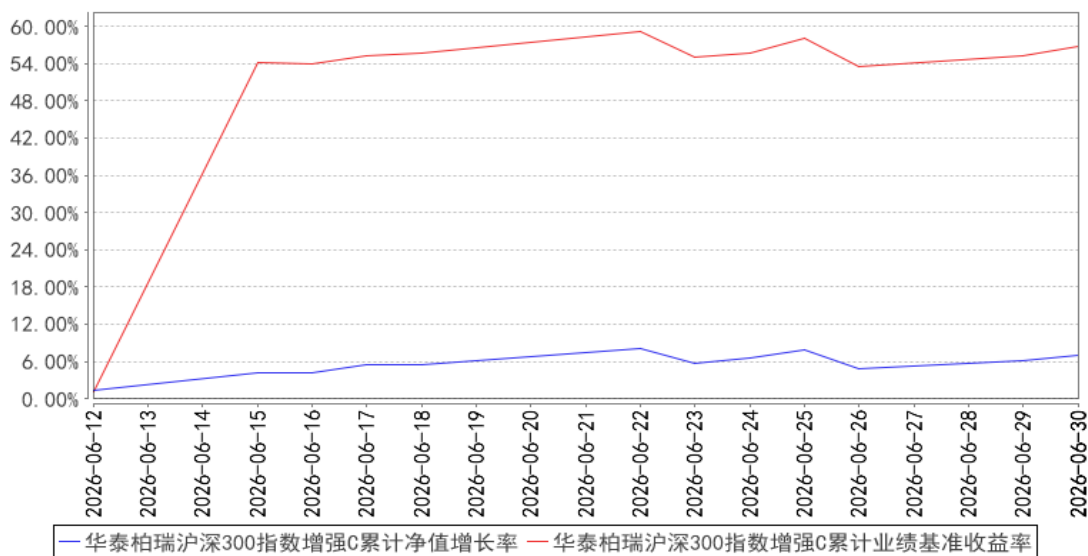
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	7.00%	1.65%	5.17%	1.65%	1.83%	0.00%

3.2.2 自基金转型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

华泰柏瑞沪深300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



华泰柏瑞沪深300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：1、A类图示日期为2026年6月12日（基金转型日）至2026年6月30日。C类图示日期为2026年6月12日（基金转型日）至2026年6月30日。

2、本基金于2026年6月12日正式转型为华泰柏瑞沪深300指数增强型证券投资基金。

3、自2026年6月12日起，本基金的业绩比较基准由“95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）”变更为“沪深300指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%”。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

华泰柏瑞量化驱动混合 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	7.66%	1.08%	5.82%	1.06%	1.84%	0.02%
过去六个月	5.78%	1.04%	1.93%	0.99%	3.85%	0.05%
过去一年	29.95%	0.97%	18.97%	0.92%	10.98%	0.05%
过去三年	40.19%	1.07%	21.95%	1.04%	18.24%	0.03%
过去五年	17.02%	1.04%	-8.75%	1.05%	25.77%	-0.01%
过去七年	79.39%	1.08%	22.96%	1.10%	56.43%	-0.02%
过去十年	127.97%	1.08%	48.12%	1.09%	79.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	87.03%	1.28%	19.50%	1.27%	67.53%	0.01%

华泰柏瑞量化驱动混合 C

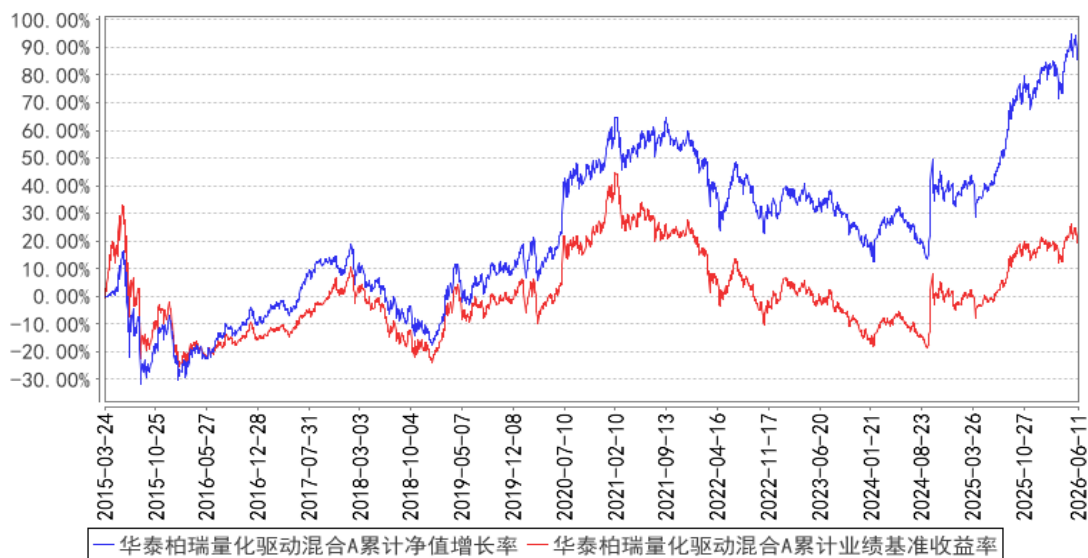
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	7.61%	1.08%	5.82%	1.06%	1.79%	0.02%
过去六个月	5.68%	1.04%	1.93%	0.99%	3.75%	0.05%
过去一年	29.66%	0.97%	18.97%	0.92%	10.69%	0.05%
过去三年	39.15%	1.07%	21.95%	1.04%	17.20%	0.03%
过去五年	15.58%	1.04%	-8.75%	1.05%	24.33%	-0.01%
过去七年	76.42%	1.08%	22.96%	1.10%	53.46%	-0.02%
自基金合同生效起至今	109.23%	1.12%	49.11%	1.14%	60.12%	-0.02%

注：过去三个月为 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去六个月为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去一年为 2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去三年为 2023 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去五年为 2021 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去七年为 2019 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去十年为 2016 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，自基金合

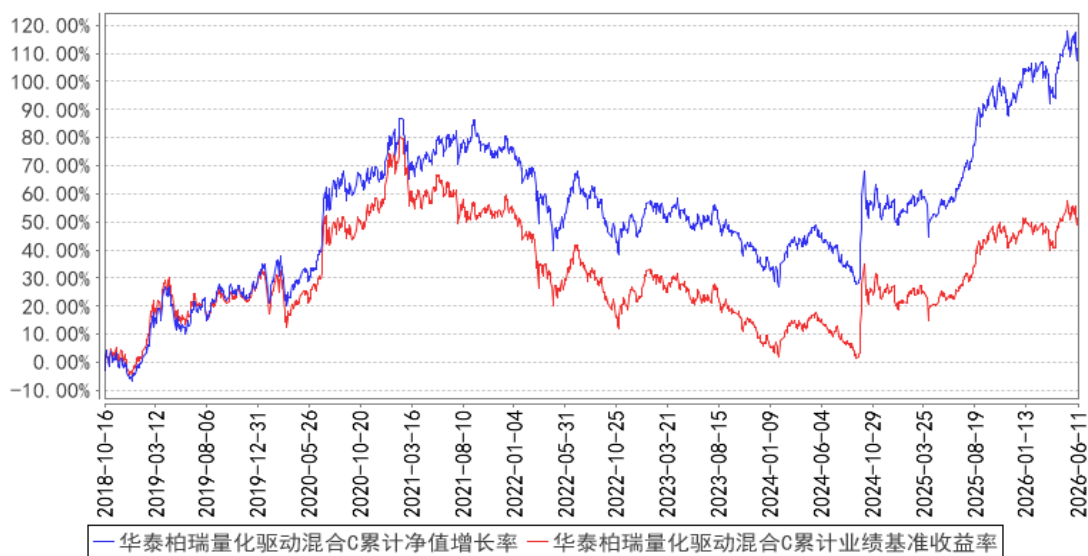
同生效起至今为 2015 年 3 月 24 日至 2026 年 6 月 11 日。

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

华泰柏瑞量化驱动混合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



华泰柏瑞量化驱动混合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2015年3月24日至2026年6月11日。C类图示日期为2018年10月16日至2026年6月11日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成
为华泰证券股份有限公司、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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 201 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（转型后）

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		
和磊	本基金的 基金经理	2026 年 6 月 12 日	—	19 年	硕士毕业于上海财经大学数量经济学专业。2007 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任高级交易员、量化投资部研究员、投资经理。2025 年 11 月起任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、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
孔令 焯	量化与海 外投资部 副总监、 本基金的 基金经理	2026 年 6 月 12 日	—	11 年	英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份公司高级分析师。2017 年 5 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研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022 年 8 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞沪深 300 指数增强型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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
和磊	本基金的基金经理	2025 年 11 月 18 日	2026 年 6 月 11 日	19 年	硕士毕业于上海财经大学数量经济学专业。2007 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任高级交易员、量化投资部研究员、投资经理。2025 年 11 月起任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、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
孔令焱	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2022 年 8 月 5 日	2026 年 6 月 11 日	11 年	英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份有限公司高级分析师。2017 年 5 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研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022 年 8 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞沪深 300 指数增强型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（转型后）

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。

4.1.3 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（转型前）

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《证券投资基金法》等有关法律法规及本基金的基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 11 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 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

2026 年上半年，A 股一波三折，上证指数跨越 4200 点关口，主要指数均创出多年新高。年初以来的上涨行情受美伊冲突影响中断。二季度。随着美伊战事边际缓和，对全球能源体系威胁边际下降，市场风险偏好逐渐好转。在随后的年报季，市场对业绩较好的上市公司正反馈明显上升，市场进入普涨行情。上半年末，市场以结构性分化行情为主。海外人工智能相关资本开支增加，半导体硬件产业链提价预期上升，相关板块连创新高。整体看，以涨价逻辑为主线的 AI 相关硬件，

以及产业链上游的新材料和有色等表现较为活跃，而金融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 7.55%；代表中小市值公司的中证 500、中证 1000 同期涨幅分别为 20.97%、15.99%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数下跌 6.82%。横向比较来看，股价弹性较大的中小市值公司，在本季度跑赢资源品占比较高的高股息类上市公司和大市值类上市公司。

本报告期内，我们坚持多因子模型的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金，转型前（报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日），截至报告期末华泰柏瑞量化驱动混合 A 的基金份额净值为 1.8703 元，报告期期间基金份额净值增长率为 5.78%，同期业绩比较基准收益率为 1.93%，华泰柏瑞量化驱动混合 C 的基金份额净值为 1.8483 元，报告期期间基金份额净值增长率为 5.68%，同期业绩比较基准收益率为 1.93%。转型后（报告期：2026 年 6 月 12 日至 2026 年 6 月 31 日），截至报告期末华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A 的基金份额净值为 2.0013 元，报告期期间基金份额净值增长率为 7.00%，同期业绩比较基准收益率为 5.17%，华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C 的基金份额净值为 1.9776 元，报告期期间基金份额净值增长率为 7.00%，同期业绩比较基准收益率为 5.17%。

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环境相对友好。2026 年以来，尽管美伊冲突威胁全球能源供应链，得益于能源安全体系构建，以及新能源转型的成果，国内经济韧性再一次得到验证。我们预计今后一段时间，供应链安全将位于更加突出的位置，产业链的自主可控也将更加深入推进。同时我们预期消费转型升级等扩内需政策将延续，并加强对人工智能及应用等产业方向的引导。海外，美国的对外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。2026 年是“十五五”规划开局之年，各领域的投资预计将靠前发力，也将进一步增强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，在经历年初以来风险偏好的波动，以及大资金深度参与稳定市场预期之后，未来股票市场的不确定性在下降。随着半年度财报季临近，我们预计投资人将更加关注上市公司业绩展望的边际变化。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的成长和价值类因子近期表现较好，我们认为其趋势仍将延续。质量和量价类因子表现相对稳健，预计后续将有更好的表现。同时，

我们认为在后市当中，大小市值、各行业股票均有机会，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，对于专注于捕捉边际变化逻辑的量化投资，超额收益将得到进一步提高，是很不错的配置风格均衡的多因子量化基金的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	36,016,089.93
结算备付金		3,164,075.30
存出保证金		1,140,106.63
交易性金融资产	6.4.7.2	419,696,248.63
其中：股票投资		419,696,248.63
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—
应收清算款		91,137.69
应收股利		—
应收申购款		1,057,231.67
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		461,164,889.85
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		685,327.29

应付管理人报酬		345,677.35
应付托管费		73,213.21
应付销售服务费		18,552.95
应付投资顾问费		-
应交税费		4,798.08
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	345,231.22
负债合计		1,472,800.10
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	230,365,128.55
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	229,326,961.20
净资产合计		459,692,089.75
负债和净资产总计		461,164,889.85

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 230,365,128.55 份，其中下属 A 类基金份额净值 2.0013 元，基金份额总额 173,663,871.24 份；下属 C 类基金份额净值 1.9776 元，基金份额总额 56,701,257.31 份。

2、本基金基金合同转型日为 2026 年 06 月 12 日，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		30,466,520.92
1. 利息收入		8,618.30
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,618.30
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）		6,213,522.13
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,678,962.46
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-

衍生工具收益	6.4.7.18	141,748.53
股利收益	6.4.7.19	1,392,811.14
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	24,222,927.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	21,453.26
减：二、营业总支出		290,576.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	187,203.79
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,800.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,023.34
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		514.08
8. 其他费用	6.4.7.23	45,034.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,175,944.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,175,944.05
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		30,175,944.05

注：本基金转型于 2026 年 06 月 12 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	230,364,237.92	-	199,316,550.81	429,680,788.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	890.63	-	30,010,410.39	30,011,301.02
(一)、综合收益总额	-	-	30,175,944.05	30,175,944.05
(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)	890.63	-	-165,533.66	-164,643.03
其中：1. 基金申购款	8,965,080.95	-	8,574,662.14	17,539,743.09
2. 基金赎回款	-8,964,190.32	-	-8,740,195.80	-17,704,386.12
(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	230,365,128.55	-	229,326,961.20	459,692,089.75

注：本基金转型于 2026 年 06 月 12 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

崔春

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)由华泰柏瑞量化驱动灵活

配置混合型证券投资基金转型而来。根据基金管理人《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》以及《关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金暨基金合同生效的提示性公告》，自 2026 年 6 月 12 日起，华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金正式变更为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金，变更后的《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件生效，原《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等法律文件失效。原华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额转为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额，原华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额转为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额。结转后的各类基金份额的持有期限连续计算。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》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《华泰柏瑞沪深 300 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(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、存托凭证、债券(包含国债、金融债、企业/公司债、公开发行的次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、货币市场工具(含同业存单)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。在符合法律法规规定的情况下，本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产的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)的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+活期存款基准利率 $\times$ 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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 06 月 12 日(基金合同转型日)至 2026 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 06 月 12 日(基金合同转型日)至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 06 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[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[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易，以资管产品管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	36,016,089.93
等于：本金	36,012,285.23
加：应计利息	3,804.70
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	36,016,089.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		362,921,775.30	-	419,696,248.63	56,774,473.33
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		362,921,775.30	-	419,696,248.63	56,774,473.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	8,706,744.00	-	-	
其中： 股指期货投资	8,706,744.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	8,706,744.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2607	沪深 300 股指期货 2607	6.00	8,859,600.00	152,856.00
合计				152,856.00
减：可抵销期货暂收款				152,856.00

净额				0.00
----	--	--	--	------

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15.30
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	268,352.46
其中：交易所市场	268,352.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,863.46
合计	345,231.22

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	177,075,593.27	177,075,593.27
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	4,000,265.63	4,000,265.63
本期赎回（以“-”号填列）	-7,411,987.66	-7,411,987.66

本期末	173,663,871.24	173,663,871.24
-----	----------------	----------------

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	53,288,644.65	53,288,644.65
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2026 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	4,964,815.32	4,964,815.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,552,202.66	-1,552,202.66
本期末	56,701,257.31	56,701,257.31

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	169,604,526.20	-15,492,446.95	154,112,079.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	169,604,526.20	-15,492,446.95	154,112,079.25
本期利润	4,547,295.25	18,605,052.37	23,152,347.62

本期基金份额交易产生的变动数	-3,297,824.92	-69,491.19	-3,367,316.11
其中：基金申购款	3,892,984.89	-15,947.73	3,877,037.16
基金赎回款	-7,190,809.81	-53,543.46	-7,244,353.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	170,853,996.53	3,043,114.23	173,897,110.76

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	44,525,139.78	679,331.78	45,204,471.56
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	44,525,139.78	679,331.78	45,204,471.56
本期利润	1,405,721.57	5,617,874.86	7,023,596.43
本期基金份额交易产生的变动数	2,892,002.86	309,779.59	3,201,782.45
其中：基金申购款	4,209,515.02	488,109.96	4,697,624.98
基金赎回款	-1,317,512.16	-178,330.37	-1,495,842.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,822,864.21	6,606,986.23	55,429,850.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,325.72
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	1,278.44
其他	14.14
合计	8,618.30

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年6月12日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,678,962.46
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	4,678,962.46

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	48,224,198.08
减：卖出股票成本总额	43,495,021.61
减：交易费用	50,214.01
买卖股票差价收入	4,678,962.46

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	141,748.53

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,392,811.14
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	1,392,811.14

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	23,515,731.23
股票投资	23,515,731.23
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	707,196.00
权证投资	-
期货投资	707,196.00
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	24,222,927.23

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	21,411.39
基金转换费收入	41.87
合计	21,453.26

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。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，其中转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	1,821.91
信息披露费	6,246.63
证券出借违约金	-
持有人大会费用	36,538.44
银行划款手续费	427.72
合计	45,034.70

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、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、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	187,203.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	50,032.88
应支付基金管理人的净管理费	137,170.91

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

当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,800.96

注：自支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞沪深 300 指数 增强 A	华泰柏瑞沪深 300 指数 增强 C	合计
华泰证券股份有限公司	—	6.11	6.11
华泰柏瑞基金管理有限公司	—	55.43	55.43
合计	—	61.54	61.54

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 0.20%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	36,016,089.93	7,325.72

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券	成功认购	受限	流通	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日期	期限	受限类型			位：股)			
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	53.26	58.74	189	10,066.14	11,101.86	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	27.19	31.31	474	12,888.06	14,840.94	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	30.38	38.99	333	10,116.54	12,983.67	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	2,329	23,569.48	64,583.17	-

				期 内						
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	46.08	463.33	680	31,334.40	315,064.40	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	69.66	160.06	417	29,048.22	66,745.02	-

301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	11.18	17.59	426	4,762.68	7,493.34	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德	2026 年 5 月	6 个月	新股	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-

	利	月 15 日		锁 定 期 内						
603459	红 板 科 技	2026 年 3 月 31 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	17.70	84.32	293	5,186.10	24,705.76	-
688635	长 进 光 子	2026 年 5 月 20 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北 芯 生 命	2026 年 1 月 28 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视 涯 科 技	2026 年 3 月 18 日	6 个 月以 上	新 股 锁 定 期 内	22.68	42.16	4,118	93,396.24	173,614.88	-
688785	恒 运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂 瑞 微	2025 年 12 月 9 日	6 个 月以 上	新 股 锁 定 期 内	83.06	126.45	1,304	108,310.24	164,890.80	-
688795	摩 尔 线 程	2025 年 11 月 26 日	6 个 月以 上	新 股 锁 定	114.28	676.94	1,575	179,991.00	1,066,180.50	-

				期 内						
688797	臻 宝 科 技	2026 年 6 月 16 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	44.56	468.67	176	7,842.56	82,485.92	-
688802	沐 曦 股 份	2025 年 12 月 9 日	6 个 月以 上	新 股 锁 定 期 内	104.66	768.89	1,198	125,382.68	921,130.22	-
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	81.88	1,584.33	112	9,170.56	177,444.96	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易 思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电 科 蓝 天	2026 年 2 月 3 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	9.47	70.14	1,359	12,869.73	95,320.26	-

688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.68	141.49	656	12,910.08	92,817.44	-
--------	------	-----------------	------	--------	-------	--------	-----	-----------	-----------	---

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，按发行人及主承销商公告的限售档位执行，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金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或创业板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,753	872,304.36	1,541,816.09	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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“期末本基金持有的流通受限证券”。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%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	36,016,089.93	-	-	-	-	-	36,016,089.93
结算备付金	3,164,075.30	-	-	-	-	-	3,164,075.30
存出保证金	76,954.63	-	-	-	-	1,063,152.00	1,140,106.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	419,696,248.63	419,696,248.63
应收申购款	-	-	-	-	-	1,057,231.67	1,057,231.67
应收清算款	-	-	-	-	-	91,137.69	91,137.69
资产总计	39,257,119.86	-	-	-	-	421,907,769.99	461,164,889.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	685,327.29	685,327.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	345,677.35	345,677.35
应付托管费	-	-	-	-	-	73,213.21	73,213.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,552.95	18,552.95
应交税费	-	-	-	-	-	4,798.08	4,798.08
其他负债	-	-	-	-	-	345,231.22	345,231.22
负债总计	-	-	-	-	-	1,472,800.10	1,472,800.10
利率敏感度缺口	39,257,119.86	-	-	-	-	-420,434,969.89	459,692,089.75

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	419,696,248.63	91.30
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	419,696,248.63	91.30

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 （2026 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	20,489,725.72
	业绩比较基准下降 5%	-20,489,725.72

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	414,483,451.31
第二层次	1,541,816.09
第三层次	3,670,981.23
合计	419,696,248.63

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 11 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	37,799,377.11	26,325,609.73
结算备付金		1,689,307.14	11,749,024.55
存出保证金		1,760,857.52	1,529,636.05
交易性金融资产	6.4.7.2	388,944,321.85	405,718,135.67
其中：股票投资		388,944,321.85	405,718,135.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	750,814.67
应收股利		-	-
应收申购款		572,270.44	1,076,980.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	36,538.44	-

资产总计		430,802,672.50	447,150,200.94
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,450.13	2,590,508.12
应付赎回款		601,505.76	924,176.25
应付管理人报酬		158,473.56	443,664.48
应付托管费		26,412.25	73,944.07
应付销售服务费		7,529.61	9,824.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	15,083.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	317,512.46	390,246.79
负债合计		1,121,883.77	4,447,447.99
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	230,364,237.92	250,701,837.64
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	199,316,550.81	192,000,915.31
净资产合计		429,680,788.73	442,702,752.95
负债和净资产总计		430,802,672.50	447,150,200.94

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 11 日(基金合同失效前日)，基金份额总额 230,364,237.92 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.8703 元，基金份额总额 177,075,593.27 份；下属 C 类基金份额净值 1.8483 元，基金份额总额 53,288,644.65 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		30,548,966.79	17,787,459.63
1. 利息收入		67,828.16	48,126.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	67,828.16	48,126.26
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）		47,915,369.37	18,617,993.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	44,780,689.60	13,844,984.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	5,451.10
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	615,076.72	-72,381.51
股利收益	6.4.7.19	2,519,603.05	4,839,939.35
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-17,491,488.32	-903,956.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	57,257.58	25,295.53
减：二、营业总支出		3,010,089.75	2,731,928.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,417,837.55	2,223,589.85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	402,972.96	370,598.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	99,623.75	47,615.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,224.71	37.75
8. 其他费用	6.4.7.23	87,430.78	90,087.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,538,877.04	15,055,531.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,538,877.04	15,055,531.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		27,538,877.04	15,055,531.01

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 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	250,701,837.64	-	192,000,915.31	442,702,752.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	250,701,837.64	-	192,000,915.31	442,702,752.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-20,337,599.72	-	7,315,635.50	-13,021,964.22
(一)、综合收益总额	-	-	27,538,877.04	27,538,877.04
(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)	-20,337,599.72	-	-20,223,241.54	-40,560,841.26
其中：1. 基金申购款	71,297,984.93	-	56,863,138.84	128,161,123.77
2. 基金赎回款	-91,635,584.65	-	-77,086,380.38	-168,721,965.03
(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	230,364,237.92	-	199,316,550.81	429,680,788.73
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	267,234,791.08	-	102,690,401.33	369,925,192.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	267,234,791.08	-	102,690,401.33	369,925,192.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,740,047.52	-	8,409,898.92	-5,330,148.60
(一)、综合收益总额	-	-	15,055,531.01	15,055,531.01
(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)	-13,740,047.52	-	-6,645,632.09	-20,385,679.61
其中：1. 基金申购款	50,177,028.41	-	18,003,787.98	68,180,816.39
2. 基金赎回款	-63,917,075.93	-	-24,649,420.07	-88,566,496.00
(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	253,494,743.56	-	111,100,300.25	364,595,043.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

崔春

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]第 210 号《关于准予华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合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 3,770,026,571.27 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(2015)第 187 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,771,012,613.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 986,042.37 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 10 月 15 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,本基金自 2018 年 10 月 16 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者申购基金份额时不收取申购费用,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 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合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,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0-95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 95%×沪深 300 指

数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

根据基金管理人《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》以及《关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金暨基金合同生效的提示性公告》，自 2026 年 6 月 12 日起，华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金正式变更为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金，变更后的《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件生效，原《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等法律文件失效。原华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额转为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额，原华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额转为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额。结转后的各类基金份额的持有期限连续计算。

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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 11 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 11 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 11 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易，以资管产品管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 11 日
活期存款	37,799,377.11
等于：本金	37,776,301.80
加：应计利息	23,075.31
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	37,799,377.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 11 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		355,685,579.75	-	388,944,321.85	33,258,742.10
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		355,685,579.75	-	388,944,321.85	33,258,742.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 11 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	14,586,540.00	-	-	
其中： 股指期货投资	14,586,540.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	14,586,540.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2606	沪深 300 股指期货 2606	10.00	14,032,200.00	-554,340.00
合计				-554,340.00
减：可抵销期货暂收款				-554,340.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 11 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	36,538.44
合计	36,538.44

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 11 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	129.63
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	248,587.91
其中：交易所市场	248,587.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	68,794.92
合计	317,512.46

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化驱动混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	221,866,350.33	221,866,350.33
本期申购	6,064,241.84	6,064,241.84
本期赎回（以“-”号填列）	-50,854,998.90	-50,854,998.90
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	177,075,593.27	177,075,593.27

华泰柏瑞量化驱动混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,835,487.31	28,835,487.31
本期申购	65,233,743.09	65,233,743.09
本期赎回（以“-”号填列）	-40,780,585.75	-40,780,585.75
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	53,288,644.65	53,288,644.65

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞量化驱动混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	171,760,974.30	-1,356,485.82	170,404,488.48
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	171,760,974.30	-1,356,485.82	170,404,488.48
本期利润	35,415,467.91	-13,275,628.06	22,139,839.85
本期基金份额交易产生的变动数	-37,571,916.01	-860,333.07	-38,432,249.08
其中：基金申购款	5,273,461.41	-57,079.08	5,216,382.33
基金赎回款	-42,845,377.42	-803,253.99	-43,648,631.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	169,604,526.20	-15,492,446.95	154,112,079.25

华泰柏瑞量化驱动混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,909,636.20	2,686,790.63	21,596,426.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	18,909,636.20	2,686,790.63	21,596,426.83
本期利润	9,614,897.45	-4,215,860.26	5,399,037.19
本期基金份额交易产生的变动数	16,000,606.13	2,208,401.41	18,209,007.54
其中：基金申购款	45,027,990.65	6,618,765.86	51,646,756.51
基金赎回款	-29,027,384.52	-4,410,364.45	-33,437,748.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,525,139.78	679,331.78	45,204,471.56

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日
活期存款利息收入	45,360.12
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	20,974.13
其他	1,493.91
合计	67,828.16

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月11日
股票投资收益——买卖股票差价收入	44,780,689.60
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	44,780,689.60

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月11日
卖出股票成交总额	461,540,167.56
减：卖出股票成本总额	416,034,606.89
减：交易费用	724,871.07
买卖股票差价收入	44,780,689.60

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日
股指期货投资收益	615,076.72

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日
股票投资产生的股利收益	2,519,603.05
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	2,519,603.05

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日
1. 交易性金融资产	-16,911,498.32
股票投资	-16,911,498.32

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	-579,990.00
权证投资	-
期货投资	-579,990.00
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	-17,491,488.32

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日
基金赎回费收入	55,980.29
基金转换费收入	1,277.29
合计	57,257.58

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。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日
审计费用	15,534.18
信息披露费	53,260.74
证券出借违约金	-
持有人大会费用	13,461.56
银行划款手续费	5,145.69
存托服务费	28.61
合计	87,430.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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、基金代销机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,417,837.55	2,223,589.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	641,904.73	562,817.00

应支付基金管理人的净管理费	1,775,932.82	1,660,772.85
---------------	--------------	--------------

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 1.20%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	402,972.96	370,598.36

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	-	50.54	50.54
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	14,113.52	14,113.52
合计	-	14,164.06	14,164.06
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	15,241.92	15,241.92
合计	-	15,241.92	15,241.92

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 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

注：本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	37,799,377.11	45,360.12	27,974,808.62	41,012.15

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期

2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中银国际证券股份有限公司	603409	汇通控股	网下申购	1,000	24,180.00
华泰联合证券有限责任公司	301458	钧崴电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合证券有限责任公司	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合证券有限责任公司	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 11 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期	28.00	29.45	57	1,596.00	1,678.65	-

				内						
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	53.26	50.13	189	10,066.14	9,474.57	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	7.82	18.85	1,743	13,630.26	32,855.55	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	18.38	16.63	134	2,462.92	2,228.42	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	27.19	30.83	474	12,888.06	14,613.42	-
001369	双欣材料	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	6.85	14.36	720	4,932.00	10,339.20	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	30.38	40.64	333	10,116.54	13,533.12	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	22.29	38.27	69	1,538.01	2,640.63	-
301449	天	2025	6 个	新	36.80	38.33	157	4,121.60	6,017.81	-

	溯 计 量	年 12 月 16 日	月	股 锁 定 期 内						
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	26.66	43.73	138	3,679.08	6,034.74	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	13.30	44.02	290	3,857.00	12,765.80	-
301599	理 奇 智 能	2026 年 4 月 22 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	13.91	32.93	433	6,023.03	14,258.69	-
301666	大 普 微	2026 年 4 月 8 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	46.08	461.71	680	31,334.40	313,962.80	-
301667	纳 百 川	2025 年 12 月 10 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	22.63	72.06	151	3,417.13	10,881.06	-
301669	高 特 电 子	2026 年 6 月 2 日	6 个 月	新 股 锁 定 期 内	7.08	27.47	546	3,865.68	14,998.62	-
301680	固 德 电	2026 年 2 月 27	6 个 月	新 股 锁	58.00	104.55	117	6,786.00	12,232.35	-

	材	日		定期内						
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	69.66	129.62	417	29,048.22	54,051.54	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	78.38	106.95	96	7,524.48	10,267.20	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	21.93	50.96	195	4,276.35	9,937.20	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	24.68	81.64	216	5,330.88	17,634.24	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	11.18	16.41	426	4,762.68	6,990.66	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	10.10	22.48	260	2,626.00	5,844.80	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期	37.88	37.37	46	1,742.48	1,719.02	-

				内						
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	33.49	32.58	72	2,411.28	2,345.76	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	21.88	26.85	112	2,450.56	3,007.20	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	15.76	43.98	104	1,639.04	4,573.92	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	17.70	58.86	293	5,186.10	17,245.98	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	40.98	302.54	128	5,245.44	38,725.12	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个 月	新股 锁 定 期 内	17.52	35.16	1,500	26,280.00	52,740.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个 月以 上	新股 锁 定 期 内	22.68	39.81	4,118	93,396.24	163,937.58	-
688785	恒	2026	6 个	新	92.18	347.01	116	10,692.88	40,253.16	-

	运昌	年 1 月 20 日	月	股 锁 定 期 内						
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	新 股 锁 定 期 内	83.06	110.54	1,304	108,310.24	144,144.16	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月以上	新 股 锁 定 期 内	114.28	584.97	1,575	179,991.00	921,327.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月以上	新 股 锁 定 期 内	104.66	655.04	1,198	125,382.68	784,737.92	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	18.58	45.61	265	4,923.70	12,086.65	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	51.66	389.96	131	6,767.46	51,084.76	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	81.88	1,501.65	112	9,170.56	168,184.80	-
688809	强一股	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	85.09	560.18	132	11,231.88	73,943.76	-

	份	日		定期内						
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	6.41	22.53	834	5,345.94	18,790.02	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	26.28	117.84	234	6,149.52	27,574.56	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	55.95	59.26	177	9,903.15	10,489.02	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	9.47	61.76	1,359	12,869.73	83,931.84	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.68	125.11	656	12,910.08	82,072.16	-

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，按发行人及主承销商公告的限售档位执行，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金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或创业板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。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相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 2026 年 06 月 11 日，本基金无债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2026 年 06 月 11 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。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%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 11 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	37,799,377.11	-	-	-	-	-	37,799,377.11
结算备付金	1,689,307.14	-	-	-	-	-	1,689,307.14
存出保证金	76,993.52	-	-	-	-	1,683,864.	1,760,857.52

						00	
交易性金融资产	-	-	-	-	-	388,944,321.85	388,944,321.85
应收申购款	-	-	-	-	-	572,270.44	572,270.44
其他资产	-	-	-	-	-	36,538.44	36,538.44
资产总计	39,565,677.77	-	-	-	-	391,236,994.73	430,802,672.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	601,505.76	601,505.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	158,473.56	158,473.56
应付托管费	-	-	-	-	-	26,412.25	26,412.25
应付清算款	-	-	-	-	-	10,450.13	10,450.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,529.61	7,529.61
其他负债	-	-	-	-	-	317,512.46	317,512.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,121,883.77	1,121,883.77
利率敏感度缺口	39,565,677.77	-	-	-	-	390,115,110.96	429,680,788.73
上年度末 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	26,325,609.73	-	-	-	-	-	26,325,609.73
结算备付金	11,749,024.55	-	-	-	-	-	11,749,024.55
存出保证金	33,274.45	-	-	-	-	1,496,361.60	1,529,636.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	405,718,135.67	405,718,135.67
应收申购款	-	-	-	-	-	1,076,980.27	1,076,980.27
应收清算款	-	-	-	-	-	750,814.67	750,814.67
资产总计	38,107,908.73	-	-	-	-	409,042,292.21	447,150,200.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	924,176.25	924,176.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	443,664.48	443,664.48
应付托管费	-	-	-	-	-	73,944.07	73,944.07
应付清算款	-	-	-	-	-	2,590,508.12	2,590,508.12

应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,824.49	9,824.49
应交税费	-	-	-	-	-	15,083.79	15,083.79
其他负债	-	-	-	-	-	390,246.79	390,246.79
负债总计	-	-	-	-	-	4,447,447.99	4,447,447.99
利率敏感度缺口	38,107,908.73	-	-	-	-	404,594,844.22	442,702,752.95

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 11 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 11 日		上年度末 2025 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	388,944,321.85	90.52	405,718,135.67	91.65
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	388,944,321.85	90.52	405,718,135.67	91.65

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 11 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	22,266,746.74	21,681,246.44
	业绩比较基准下降 5%	-22,266,746.74	-21,681,246.44

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	385,658,165.64	402,018,461.03
第二层次	－	1,645,750.00
第三层次	3,286,156.21	2,053,924.64

合计	388,944,321.85	405,718,135.67
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 11 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。
--

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	419,696,248.63	91.01
	其中：股票	419,696,248.63	91.01
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	39,180,165.23	8.50
8	其他各项资产	2,288,475.99	0.50

9	合计	461,164,889.85	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,422,498.82	4.44
C	制造业	260,698,994.16	56.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,477,034.00	2.06
E	建筑业	5,600,890.00	1.22
F	批发和零售业	7,153,037.00	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	13,461,019.46	2.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,271,891.15	4.41
J	金融业	77,650,188.04	16.89
K	房地产业	331,045.00	0.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,629,651.00	1.01
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	419,696,248.63	91.30

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	12,900	16,383,000.00	3.56
2	300750	宁德时代	39,400	15,484,594.00	3.37
3	300502	新易盛	18,228	11,064,396.00	2.41
4	603986	兆易创新	10,600	8,639,000.00	1.88
5	000776	广发证券	304,600	7,127,640.00	1.55

6	002916	深南电路	14,000	6,410,600.00	1.39
7	688012	中微公司	13,223	6,194,975.50	1.35
8	601899	紫金矿业	245,400	6,169,356.00	1.34
9	300394	天孚通信	18,780	5,684,330.40	1.24
10	688396	华润微	57,600	5,618,880.00	1.22
11	688256	寒武纪	3,295	5,257,337.25	1.14
12	000001	平安银行	514,220	5,167,911.00	1.12
13	600519	贵州茅台	4,275	5,067,969.75	1.10
14	300661	圣邦股份	35,000	5,021,800.00	1.09
15	601328	交通银行	768,500	4,941,455.00	1.07
16	300408	三环集团	29,600	4,940,240.00	1.07
17	600999	招商证券	216,502	4,568,192.20	0.99
18	300475	香农芯创	14,900	4,470,000.00	0.97
19	600150	中国船舶	129,673	4,381,650.67	0.95
20	600183	生益科技	25,100	4,352,340.00	0.95
21	603259	药明康德	34,500	4,295,595.00	0.93
22	002371	北方华创	4,600	4,068,976.00	0.89
23	002008	大族激光	27,000	4,052,970.00	0.88
24	605117	德业股份	36,400	3,864,952.00	0.84
25	600030	中信证券	127,720	3,669,395.60	0.80
26	000792	盐湖股份	119,200	3,598,648.00	0.78
27	002384	东山精密	13,600	3,567,960.00	0.78
28	600886	国投电力	266,000	3,540,460.00	0.77
29	601318	中国平安	72,928	3,481,582.72	0.76
30	001389	广合科技	14,600	3,463,850.00	0.75
31	300604	长川科技	10,000	3,414,200.00	0.74
32	000333	美的集团	44,941	3,394,393.73	0.74
33	601699	潞安环能	235,800	3,367,224.00	0.73
34	600919	江苏银行	301,800	3,253,404.00	0.71
35	688498	源杰科技	1,630	3,074,180.00	0.67
36	300223	北京君正	12,300	3,061,470.00	0.67
37	600018	上港集团	647,000	3,053,840.00	0.66
38	688521	芯原股份	8,200	3,043,348.00	0.66
39	688041	海光信息	8,000	2,962,400.00	0.64
40	000783	长江证券	300,500	2,929,875.00	0.64
41	688111	金山办公	13,618	2,901,314.90	0.63
42	000651	格力电器	76,700	2,876,250.00	0.63
43	600809	山西汾酒	26,100	2,854,557.00	0.62
44	600900	长江电力	105,000	2,779,350.00	0.60
45	600036	招商银行	77,729	2,759,379.50	0.60
46	002415	海康威视	80,600	2,756,520.00	0.60
47	600026	中远海能	153,100	2,746,614.00	0.60
48	002475	立讯精密	38,100	2,682,240.00	0.58

49	300014	亿纬锂能	41,000	2,666,230.00	0.58
50	002463	沪电股份	17,100	2,612,880.00	0.57
51	000408	藏格矿业	37,600	2,606,432.00	0.57
52	600887	伊利股份	108,748	2,605,602.08	0.57
53	601319	中国人保	385,300	2,604,628.00	0.57
54	600875	东方电气	89,800	2,583,546.00	0.56
55	000807	云铝股份	115,400	2,554,956.00	0.56
56	600015	华夏银行	392,000	2,504,880.00	0.54
57	601138	工业富联	34,600	2,496,390.00	0.54
58	601211	国泰海通	134,423	2,446,498.60	0.53
59	603893	瑞芯微	12,900	2,429,844.00	0.53
60	601009	南京银行	237,400	2,347,886.00	0.51
61	600233	圆通速递	148,100	2,332,575.00	0.51
62	601601	中国太保	81,686	2,329,684.72	0.51
63	600027	华电国际	521,700	2,321,565.00	0.51
64	301536	星宸科技	17,800	2,291,038.00	0.50
65	601816	京沪高铁	499,000	2,260,470.00	0.49
66	603799	华友钴业	46,600	2,248,916.00	0.49
67	688002	睿创微纳	14,400	2,227,536.00	0.48
68	601398	工商银行	312,000	2,205,840.00	0.48
69	000338	潍柴动力	80,500	2,193,625.00	0.48
70	600489	中金黄金	119,200	2,151,560.00	0.47
71	601766	中国中车	411,100	2,137,720.00	0.47
72	603993	洛阳钼业	121,700	2,135,835.00	0.46
73	601939	建设银行	221,100	2,129,193.00	0.46
74	601658	邮储银行	425,100	2,095,743.00	0.46
75	601336	新华保险	34,700	2,070,202.00	0.45
76	601628	中国人寿	57,200	2,022,020.00	0.44
77	688578	艾力斯	18,200	1,987,440.00	0.43
78	002532	天山铝业	185,100	1,986,123.00	0.43
79	600104	上汽集团	198,700	1,939,312.00	0.42
80	000938	紫光股份	67,000	1,933,620.00	0.42
81	600050	中国联通	483,100	1,932,400.00	0.42
82	601360	三六零	221,700	1,926,573.00	0.42
83	600741	华域汽车	124,000	1,924,480.00	0.42
84	601877	正泰电器	76,500	1,917,855.00	0.42
85	600938	中国海油	70,100	1,903,215.00	0.41
86	300432	富临精工	92,100	1,850,289.00	0.40
87	002142	宁波银行	61,900	1,837,811.00	0.40
88	688266	泽璟制药	15,600	1,819,896.00	0.40
89	300953	震裕科技	13,480	1,802,276.00	0.39
90	601668	中国建筑	404,600	1,755,964.00	0.38
91	601166	兴业银行	106,000	1,755,360.00	0.38

92	002028	思源电气	10,000	1,730,000.00	0.38
93	002493	荣盛石化	158,600	1,704,950.00	0.37
94	601077	渝农商行	277,800	1,697,358.00	0.37
95	688059	华锐精密	8,400	1,677,564.00	0.36
96	688110	东芯股份	8,200	1,670,340.00	0.36
97	002558	巨人网络	60,600	1,670,136.00	0.36
98	600460	士兰微	29,900	1,634,334.00	0.36
99	603198	迎驾贡酒	52,500	1,554,000.00	0.34
100	688072	拓荆科技	1,753	1,541,816.09	0.34
101	603369	今世缘	62,500	1,481,875.00	0.32
102	600000	浦发银行	171,300	1,474,893.00	0.32
103	600595	中孚实业	262,100	1,473,002.00	0.32
104	600309	万华化学	21,500	1,470,815.00	0.32
105	601186	中国铁建	246,300	1,465,485.00	0.32
106	600016	民生银行	452,200	1,456,084.00	0.32
107	688182	灿勤科技	33,600	1,447,152.00	0.31
108	000630	铜陵有色	225,500	1,434,180.00	0.31
109	002594	比亚迪	17,800	1,418,660.00	0.31
110	601995	中金公司	39,100	1,413,465.00	0.31
111	000426	兴业银锡	42,800	1,410,688.00	0.31
112	601872	招商轮船	80,200	1,409,114.00	0.31
113	601818	光大银行	480,200	1,387,778.00	0.30
114	000951	中国重汽	69,800	1,361,798.00	0.30
115	603288	海天味业	39,300	1,303,188.00	0.28
116	300033	同花顺	5,380	1,296,580.00	0.28
117	601117	中国化学	173,500	1,275,225.00	0.28
118	600276	恒瑞医药	24,220	1,260,408.80	0.27
119	688766	普冉股份	1,600	1,226,560.00	0.27
120	300548	长芯博创	4,400	1,223,200.00	0.27
121	603296	华勤技术	16,360	1,215,057.20	0.26
122	000157	中联重科	172,400	1,201,628.00	0.26
123	603233	大参林	79,300	1,191,879.00	0.26
124	300037	新宙邦	12,700	1,179,195.00	0.26
125	300438	鹏辉能源	14,100	1,168,185.00	0.25
126	603225	新凤鸣	58,000	1,139,700.00	0.25
127	301165	锐捷网络	14,000	1,126,300.00	0.25
128	601390	中国中铁	264,800	1,104,216.00	0.24
129	601633	长城汽车	72,500	1,094,025.00	0.24
130	688795	摩尔线程	1,575	1,066,180.50	0.23
131	600346	恒力石化	60,200	1,066,142.00	0.23
132	601233	桐昆股份	49,200	1,065,180.00	0.23
133	601728	中国电信	203,800	1,057,722.00	0.23
134	600499	科达制造	75,900	1,047,420.00	0.23

135	600372	中航机载	96,300	1,044,855.00	0.23
136	601018	宁波港	317,700	1,000,755.00	0.22
137	600019	宝钢股份	177,600	964,368.00	0.21
138	688802	沐曦股份	1,198	921,130.22	0.20
139	300857	协创数据	2,700	917,730.00	0.20
140	601881	中国银河	72,500	911,325.00	0.20
141	688036	传音控股	15,200	896,040.00	0.19
142	688536	思瑞浦	2,400	873,816.00	0.19
143	600028	中国石化	191,700	854,982.00	0.19
144	603317	天味食品	65,500	852,155.00	0.19
145	601857	中国石油	97,100	842,828.00	0.18
146	600011	华能国际	110,100	835,659.00	0.18
147	688279	峰昭科技	3,600	807,984.00	0.18
148	601225	陕西煤业	39,500	803,825.00	0.17
149	601169	北京银行	158,503	776,664.70	0.17
150	688235	百济神州	3,000	763,830.00	0.17
151	601607	上海医药	49,500	762,300.00	0.17
152	601998	中信银行	108,100	749,133.00	0.16
153	001316	润贝航科	22,100	728,858.00	0.16
154	000550	江铃汽车	44,800	726,656.00	0.16
155	600482	中国动力	22,100	724,880.00	0.16
156	600362	江西铜业	16,700	723,110.00	0.16
157	600380	健康元	72,000	678,240.00	0.15
158	301606	绿联科技	11,100	677,322.00	0.15
159	300476	胜宏科技	1,900	658,217.00	0.14
160	000895	双汇发展	28,500	638,400.00	0.14
161	002353	杰瑞股份	3,900	594,750.00	0.13
162	002468	申通快递	38,300	557,648.00	0.12
163	601600	中国铝业	67,400	554,028.00	0.12
164	000988	华工科技	3,000	553,830.00	0.12
165	603345	安井食品	6,900	553,311.00	0.12
166	600031	三一重工	31,800	549,504.00	0.12
167	688100	威胜信息	16,800	513,912.00	0.11
168	002948	青岛银行	100,300	509,524.00	0.11
169	000166	申万宏源	115,300	507,320.00	0.11
170	600111	北方稀土	10,000	480,500.00	0.10
171	000657	中钨高新	5,000	478,600.00	0.10
172	600522	中天科技	7,700	467,236.00	0.10
173	000100	TCL 科技	76,500	445,230.00	0.10
174	002517	恺英网络	27,100	440,375.00	0.10
175	002001	新 和 成	14,750	419,195.00	0.09
176	601788	光大证券	28,400	409,812.00	0.09
177	000800	一汽解放	68,700	408,765.00	0.09

178	301358	湖南裕能	5,300	402,111.00	0.09
179	601100	恒立液压	3,600	387,216.00	0.08
180	600546	山煤国际	35,200	384,736.00	0.08
181	600585	海螺水泥	21,800	369,510.00	0.08
182	002311	海大集团	8,200	365,802.00	0.08
183	000975	山金国际	21,300	362,100.00	0.08
184	000703	恒逸石化	26,500	359,605.00	0.08
185	601058	赛轮轮胎	30,200	348,206.00	0.08
186	601288	农业银行	57,100	346,597.00	0.08
187	600048	保利发展	71,500	331,045.00	0.07
188	600426	华鲁恒升	13,500	322,920.00	0.07
189	301666	大普微	680	315,064.40	0.07
190	300919	中伟新材	7,000	306,250.00	0.07
191	600941	中国移动	3,500	301,455.00	0.07
192	688390	固德威	2,575	279,413.25	0.06
193	601163	三角轮胎	21,000	266,490.00	0.06
194	002422	科伦药业	6,800	261,936.00	0.06
195	002460	赣锋锂业	4,000	261,600.00	0.06
196	600089	特变电工	9,900	222,750.00	0.05
197	601577	长沙银行	23,900	208,169.00	0.05
198	300803	指南针	2,200	201,674.00	0.04
199	001399	惠科股份	5,822	197,945.91	0.04
200	600196	复星医药	8,300	186,501.00	0.04
201	688808	联讯仪器	112	177,444.96	0.04
202	688781	视涯科技	4,118	173,614.88	0.04
203	688790	昂瑞微	1,304	164,890.80	0.04
204	002379	宏桥控股	10,000	147,700.00	0.03
205	688293	奥浦迈	3,400	141,746.00	0.03
206	688221	前沿生物	5,800	129,920.00	0.03
207	301086	鸿富瀚	600	125,568.00	0.03
208	688372	伟测科技	600	111,600.00	0.02
209	000933	神火股份	5,000	106,000.00	0.02
210	600029	南方航空	19,000	98,420.00	0.02
211	688818	电科蓝天	1,359	95,320.26	0.02
212	688820	盛合晶微	656	92,817.44	0.02
213	688797	臻宝科技	176	82,485.92	0.02
214	688202	美迪西	1,000	80,710.00	0.02
215	600989	宝丰能源	3,300	67,089.00	0.01
216	301682	宏明电子	417	66,745.02	0.01
217	688095	福昕软件	1,000	59,430.00	0.01
218	688385	复旦微电	800	57,032.00	0.01
219	601916	浙商银行	21,000	55,230.00	0.01
220	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01

221	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
222	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
223	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
224	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
225	603459	红板科技	293	24,705.76	0.01
226	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
227	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
228	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
229	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
230	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
231	001365	天海电子	474	14,840.94	0.00
232	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
233	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
234	001393	维通利	333	12,983.67	0.00
235	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
236	001237	惠康科技	189	11,101.86	0.00
237	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
238	601112	振石股份	426	7,493.34	0.00
239	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
240	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
241	300573	兴齐眼药	100	4,076.00	0.00
242	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
243	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
244	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
245	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
246	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300604	长川科技	2,075,099.00	0.45
2	600875	东方电气	1,933,514.00	0.42
3	001389	广合科技	1,874,676.00	0.41
4	000426	兴业银锡	1,730,262.00	0.38
5	605117	德业股份	1,609,264.00	0.35
6	688396	华润微	1,518,566.21	0.33
7	603799	华友钴业	1,439,031.00	0.31
8	600027	华电国际	1,424,621.00	0.31
9	000783	长江证券	1,418,669.00	0.31
10	601699	潞安环能	1,347,398.00	0.29
11	601995	中金公司	1,330,334.00	0.29
12	600499	科达制造	1,184,127.00	0.26

13	002008	大族激光	1,148,467.00	0.25
14	300432	富临精工	1,094,803.00	0.24
15	600372	中航机载	1,040,547.00	0.23
16	688256	寒武纪	986,818.00	0.21
17	600028	中国石化	897,425.00	0.20
18	603893	瑞芯微	824,867.00	0.18
19	300223	北京君正	823,624.00	0.18
20	300857	协创数据	817,907.00	0.18

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	1,624,138.00	0.35
2	600011	华能国际	1,600,713.00	0.35
3	688390	固德威	1,478,080.02	0.32
4	601577	长沙银行	1,435,132.00	0.31
5	603259	药明康德	1,400,112.00	0.30
6	002850	科达利	1,396,968.00	0.30
7	601211	国泰海通	1,323,430.00	0.29
8	688221	前沿生物	1,250,451.20	0.27
9	600031	三一重工	1,227,337.00	0.27
10	300475	香农芯创	1,182,359.00	0.26
11	002039	黔源电力	1,162,337.00	0.25
12	600999	招商证券	1,066,423.00	0.23
13	603296	华勤技术	1,028,596.00	0.22
14	000988	华工科技	969,218.00	0.21
15	000983	山西焦煤	963,306.00	0.21
16	688766	普冉股份	950,574.00	0.21
17	002463	沪电股份	873,159.00	0.19
18	300033	同花顺	857,342.60	0.19
19	002938	鹏鼎控股	823,276.00	0.18
20	000100	TCL 科技	820,546.00	0.18

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	50,731,217.16
卖出股票收入（成交）总额	48,224,198.08

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间基金遇到大额申赎时，我们有使用股指期货套保保持仓位。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发证券（000776）在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,140,106.63
2	应收清算款	91,137.69
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,057,231.67
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,288,475.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	388,944,321.85	90.28
	其中：股票	388,944,321.85	90.28
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	39,488,684.25	9.17
8	其他各项资产	2,369,666.40	0.55
9	合计	430,802,672.50	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,736,690.55	4.83
C	制造业	229,037,839.87	53.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,759,072.00	2.74
E	建筑业	6,234,937.00	1.45
F	批发和零售业	6,561,466.00	1.53
G	交通运输、仓储和邮政业	12,404,387.65	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,971,072.58	3.95
J	金融业	79,338,224.76	18.46
K	房地产业	368,225.00	0.09
L	租赁和商务服务业	775,336.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	4,757,070.44	1.11
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	388,944,321.85	90.52

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	14,100	15,848,400.00	3.69
2	300750	宁德时代	39,800	15,211,560.00	3.54
3	300502	新易盛	18,228	9,587,928.00	2.23
4	601899	紫金矿业	236,000	6,449,880.00	1.50
5	300394	天孚通信	14,700	6,060,810.00	1.41
6	000001	平安银行	522,320	5,902,216.00	1.37
7	000776	广发证券	306,700	5,873,305.00	1.37

8	601328	交通银行	823,600	5,740,492.00	1.34
9	600519	贵州茅台	4,475	5,723,525.00	1.33
10	603986	兆易创新	10,200	4,931,700.00	1.15
11	002916	深南电路	12,700	4,777,232.00	1.11
12	600999	招商证券	275,702	4,753,102.48	1.11
13	603259	药明康德	48,600	4,717,602.00	1.10
14	601318	中国平安	85,828	4,517,985.92	1.05
15	688012	中微公司	14,823	4,493,147.76	1.05
16	300408	三环集团	33,800	4,449,094.00	1.04
17	000333	美的集团	47,241	4,032,019.35	0.94
18	600183	生益科技	26,600	3,982,818.00	0.93
19	600886	国投电力	266,000	3,662,820.00	0.85
20	600150	中国船舶	106,173	3,657,659.85	0.85
21	000651	格力电器	94,900	3,653,650.00	0.85
22	000792	盐湖股份	119,200	3,624,872.00	0.84
23	601211	国泰海通	209,323	3,604,542.06	0.84
24	300661	圣邦股份	34,000	3,577,480.00	0.83
25	300475	香农芯创	19,000	3,461,040.00	0.81
26	600030	中信证券	127,720	3,258,137.20	0.76
27	600900	长江电力	112,500	3,137,625.00	0.73
28	600809	山西汾酒	25,700	3,073,720.00	0.72
29	688256	寒武纪	2,495	3,042,652.50	0.71
30	600919	江苏银行	257,800	3,036,884.00	0.71
31	600036	招商银行	77,729	3,010,444.17	0.70
32	000807	云铝股份	110,500	3,008,915.00	0.70
33	002463	沪电股份	23,300	2,957,003.00	0.69
34	601319	中国人保	433,200	2,915,436.00	0.68
35	002384	东山精密	13,600	2,869,464.00	0.67
36	600018	上港集团	576,400	2,864,708.00	0.67
37	601766	中国中车	498,800	2,848,148.00	0.66
38	600887	伊利股份	108,748	2,785,036.28	0.65
39	601699	潞安环能	154,400	2,752,952.00	0.64
40	002475	立讯精密	41,400	2,673,612.00	0.62
41	600015	华夏银行	382,600	2,643,766.00	0.62
42	601009	南京银行	223,500	2,610,480.00	0.61
43	601628	中国人寿	75,800	2,602,214.00	0.61
44	601138	工业富联	37,200	2,586,144.00	0.60
45	688041	海光信息	8,800	2,550,592.00	0.59
46	002371	北方华创	4,000	2,550,000.00	0.59
47	600026	中远海能	153,100	2,549,115.00	0.59
48	600011	华能国际	309,800	2,531,066.00	0.59
49	601816	京沪高铁	499,000	2,490,010.00	0.58
50	688111	金山办公	11,818	2,476,580.08	0.58

51	000408	藏格矿业	32,400	2,462,724.00	0.57
52	600489	中金黄金	119,200	2,460,288.00	0.57
53	002415	海康威视	80,600	2,416,388.00	0.56
54	601668	中国建筑	506,800	2,402,232.00	0.56
55	601398	工商银行	312,000	2,389,920.00	0.56
56	688396	华润微	37,800	2,382,534.00	0.55
57	688498	源杰科技	1,630	2,366,760.00	0.55
58	601601	中国太保	73,586	2,359,167.16	0.55
59	601939	建设银行	221,100	2,343,660.00	0.55
60	300014	亿纬锂能	42,200	2,325,220.00	0.54
61	603198	迎驾贡酒	66,600	2,288,376.00	0.53
62	603296	华勤技术	21,300	2,231,814.00	0.52
63	000338	潍柴动力	80,500	2,219,385.00	0.52
64	002532	天山铝业	164,700	2,208,627.00	0.51
65	002008	大族激光	18,100	2,198,245.00	0.51
66	600104	上汽集团	198,700	2,159,869.00	0.50
67	600050	中国联通	494,300	2,155,148.00	0.50
68	603993	洛阳钼业	121,700	2,113,929.00	0.49
69	605117	德业股份	20,700	2,094,840.00	0.49
70	300953	震裕科技	14,880	2,085,432.00	0.49
71	688059	华锐精密	12,000	2,076,000.00	0.48
72	600741	华域汽车	124,000	2,064,600.00	0.48
73	601336	新华保险	34,700	2,054,934.00	0.48
74	601360	三六零	221,700	1,995,300.00	0.46
75	002028	思源电气	11,500	1,978,000.00	0.46
76	002142	宁波银行	58,900	1,934,865.00	0.45
77	600233	圆通速递	112,100	1,900,095.00	0.44
78	688521	芯原股份	8,200	1,884,032.00	0.44
79	688002	睿创微纳	14,200	1,857,502.00	0.43
80	300033	同花顺	9,480	1,830,019.20	0.43
81	688390	固德威	15,775	1,789,989.25	0.42
82	002493	荣盛石化	164,400	1,767,300.00	0.41
83	600031	三一重工	96,400	1,756,408.00	0.41
84	600595	中孚实业	262,100	1,729,860.00	0.40
85	601166	兴业银行	92,000	1,728,680.00	0.40
86	601658	邮储银行	333,200	1,699,320.00	0.40
87	601577	长沙银行	174,900	1,679,040.00	0.39
88	600938	中国海油	49,000	1,657,180.00	0.39
89	600000	浦发银行	171,300	1,635,915.00	0.38
90	600016	民生银行	452,200	1,614,354.00	0.38
91	002594	比亚迪	17,800	1,598,440.00	0.37
92	601186	中国铁建	246,300	1,554,153.00	0.36
93	000951	中国重汽	69,800	1,532,110.00	0.36

94	301536	星辰科技	17,800	1,529,910.00	0.36
95	603369	今世缘	62,500	1,523,125.00	0.35
96	601818	光大银行	480,200	1,522,234.00	0.35
97	603288	海天味业	42,400	1,491,208.00	0.35
98	601877	正泰电器	55,600	1,484,520.00	0.35
99	688578	艾力斯	18,200	1,459,640.00	0.34
100	603317	天味食品	107,100	1,452,276.00	0.34
101	603225	新凤鸣	78,400	1,437,072.00	0.33
102	002558	巨人网络	60,600	1,433,190.00	0.33
103	000630	铜陵有色	221,000	1,425,450.00	0.33
104	002850	科达利	7,400	1,408,886.00	0.33
105	001316	润贝航科	37,800	1,391,796.00	0.32
106	000988	华工科技	9,000	1,354,500.00	0.32
107	601728	中国电信	215,000	1,341,600.00	0.31
108	688221	前沿生物	76,000	1,340,640.00	0.31
109	688266	泽璟制药	14,400	1,316,880.00	0.31
110	601633	长城汽车	72,500	1,270,200.00	0.30
111	002039	黔源电力	60,000	1,249,800.00	0.29
112	603893	瑞芯微	7,800	1,248,624.00	0.29
113	601077	渝农商行	178,200	1,240,272.00	0.29
114	300438	鹏辉能源	16,900	1,181,141.00	0.27
115	601390	中国中铁	264,800	1,181,008.00	0.27
116	600027	华电国际	232,300	1,177,761.00	0.27
117	688182	灿勤科技	33,600	1,169,280.00	0.27
118	688766	普冉股份	3,000	1,162,740.00	0.27
119	601872	招商轮船	80,200	1,156,484.00	0.27
120	001389	广合科技	6,100	1,077,992.00	0.25
121	000100	TCL 科技	238,000	1,073,380.00	0.25
122	601225	陕西煤业	39,500	1,063,735.00	0.25
123	600019	宝钢股份	177,600	1,038,960.00	0.24
124	000983	山西焦煤	144,800	1,038,216.00	0.24
125	600346	恒力石化	63,300	1,031,157.00	0.24
126	600309	万华化学	15,300	1,027,395.00	0.24
127	600276	恒瑞医药	21,820	1,025,103.60	0.24
128	300223	北京君正	7,000	1,018,430.00	0.24
129	688110	东芯股份	8,000	1,015,840.00	0.24
130	601857	中国石油	97,100	1,006,927.00	0.23
131	601233	桐昆股份	49,200	997,284.00	0.23
132	300037	新宙邦	13,100	990,360.00	0.23
133	300548	长芯博创	4,400	990,000.00	0.23
134	300432	富临精工	45,000	987,750.00	0.23
135	301606	绿联科技	15,800	954,004.00	0.22
136	000938	紫光股份	37,300	945,555.00	0.22

137	688795	摩尔线程	1,575	921,327.75	0.21
138	603799	华友钴业	19,300	917,329.00	0.21
139	601898	中煤能源	56,000	913,360.00	0.21
140	603233	大参林	55,000	904,750.00	0.21
141	601881	中国银河	72,500	867,100.00	0.20
142	600546	山煤国际	66,400	865,192.00	0.20
143	000783	长江证券	116,300	858,294.00	0.20
144	002938	鹏鼎控股	8,000	852,000.00	0.20
145	600875	东方电气	28,400	837,516.00	0.19
146	601169	北京银行	158,503	822,630.57	0.19
147	688036	传音控股	15,200	808,184.00	0.19
148	601607	上海医药	49,500	803,880.00	0.19
149	301165	锐捷网络	14,000	793,800.00	0.18
150	688802	沐曦股份	1,198	784,737.92	0.18
151	601888	中国中免	13,600	775,336.00	0.18
152	601117	中国化学	103,600	760,424.00	0.18
153	601100	恒立液压	6,200	759,562.00	0.18
154	688279	峰昭科技	3,600	745,560.00	0.17
155	000550	江铃汽车	44,800	742,784.00	0.17
156	000729	燕京啤酒	63,200	724,272.00	0.17
157	688095	福昕软件	10,800	704,160.00	0.16
158	601600	中国铝业	67,400	696,242.00	0.16
159	000895	双汇发展	28,500	688,845.00	0.16
160	688717	艾罗能源	7,400	671,328.00	0.16
161	300769	德方纳米	11,000	671,220.00	0.16
162	002948	青岛银行	113,300	667,337.00	0.16
163	601998	中信银行	86,700	662,388.00	0.15
164	300373	扬杰科技	6,400	641,216.00	0.15
165	603345	安井食品	6,900	610,650.00	0.14
166	301308	江波龙	1,100	566,280.00	0.13
167	600460	士兰微	17,000	564,060.00	0.13
168	000800	一汽解放	92,800	558,656.00	0.13
169	002468	申通快递	38,300	532,753.00	0.12
170	001965	招商公路	53,100	518,256.00	0.12
171	688100	威胜信息	16,800	515,760.00	0.12
172	600111	北方稀土	10,800	513,216.00	0.12
173	688072	拓荆科技	753	493,418.31	0.11
174	000157	中联重科	65,000	473,850.00	0.11
175	002001	新 和 成	14,750	433,797.50	0.10
176	601788	光大证券	28,400	395,896.00	0.09
177	601288	农业银行	58,500	390,780.00	0.09
178	002517	恺英网络	27,100	384,278.00	0.09
179	600522	中天科技	7,700	379,379.00	0.09

180	600048	保利发展	71,500	368,225.00	0.09
181	601058	赛轮轮胎	30,200	367,836.00	0.09
182	002466	天齐锂业	5,600	341,600.00	0.08
183	000032	深桑达 A	19,600	337,120.00	0.08
184	000975	山金国际	16,400	336,528.00	0.08
185	600941	中国移动	3,500	335,895.00	0.08
186	000703	恒逸石化	26,500	329,395.00	0.08
187	300604	长川科技	1,400	325,976.00	0.08
188	603556	海兴电力	13,700	322,772.00	0.08
189	300919	中伟新材	7,000	319,550.00	0.07
190	301666	大普微	680	313,962.80	0.07
191	002311	海大集团	6,800	305,320.00	0.07
192	601018	宁波港	85,000	282,200.00	0.07
193	688220	翱捷科技	3,000	275,640.00	0.06
194	002460	赣锋锂业	3,900	272,766.00	0.06
195	002422	科伦药业	6,800	258,944.00	0.06
196	600089	特变电工	10,800	245,700.00	0.06
197	688536	思瑞浦	800	226,296.00	0.05
198	002518	科士达	4,700	214,132.00	0.05
199	688188	柏楚电子	1,200	186,252.00	0.04
200	600196	复星医药	8,300	180,774.00	0.04
201	300803	指南针	2,200	172,414.00	0.04
202	002379	宏桥控股	10,000	169,900.00	0.04
203	688808	联讯仪器	112	168,184.80	0.04
204	688781	视涯科技	4,118	163,937.58	0.04
205	605499	东鹏饮料	1,170	155,750.40	0.04
206	688790	昂瑞微	1,304	144,144.16	0.03
207	600029	南方航空	19,000	95,380.00	0.02
208	688205	德科立	400	94,548.00	0.02
209	688818	电科蓝天	1,359	83,931.84	0.02
210	688820	盛合晶微	656	82,072.16	0.02
211	688809	强一股份	132	73,943.76	0.02
212	600585	海螺水泥	3,600	66,852.00	0.02
213	301682	宏明电子	417	54,051.54	0.01
214	688712	北芯生命	1,500	52,740.00	0.01
215	688807	优迅股份	131	51,084.76	0.01
216	600406	国电南瑞	2,100	47,985.00	0.01
217	002128	电投能源	1,600	45,648.00	0.01
218	688385	复旦微电	800	42,648.00	0.01
219	688785	恒运昌	116	40,253.16	0.01
220	688635	长进光子	128	38,725.12	0.01
221	001257	盛龙股份	1,743	32,855.55	0.01
222	688202	美迪西	600	30,810.00	0.01

223	688813	泰金新能	234	27,574.56	0.01
224	600690	海尔智家	1,200	25,332.00	0.01
225	688811	有研复材	834	18,790.02	0.00
226	301696	三瑞智能	216	17,634.24	0.00
227	603459	红板科技	293	17,245.98	0.00
228	301669	高特电子	546	14,998.62	0.00
229	001365	天海电子	474	14,613.42	0.00
230	301599	理奇智能	433	14,258.69	0.00
231	601111	中国国航	2,300	13,708.00	0.00
232	001393	维通利	333	13,533.12	0.00
233	301531	春光集团	290	12,765.80	0.00
234	301680	固德电材	117	12,232.35	0.00
235	300682	朗新科技	1,100	12,144.00	0.00
236	688805	健信超导	265	12,086.65	0.00
237	301667	纳百川	151	10,881.06	0.00
238	688816	易思维	177	10,489.02	0.00
239	601163	三角轮胎	800	10,424.00	0.00
240	001369	双欣材料	720	10,339.20	0.00
241	301683	慧谷新材	96	10,267.20	0.00
242	301687	新广益	195	9,937.20	0.00
243	600372	中航机载	900	9,657.00	0.00
244	001237	惠康科技	189	9,474.57	0.00
245	601112	振石股份	426	6,990.66	0.00
246	600600	青岛啤酒	100	6,069.00	0.00
247	301513	尚水智能	138	6,034.74	0.00
248	301449	天溯计量	157	6,017.81	0.00
249	603248	锡华科技	260	5,844.80	0.00
250	002074	国轩高科	200	5,670.00	0.00
251	603435	嘉德利	104	4,573.92	0.00
252	603352	至信股份	112	3,007.20	0.00
253	001396	誉帆科技	69	2,640.63	0.00
254	603293	埃泰克	72	2,345.76	0.00
255	001312	福恩股份	134	2,228.42	0.00
256	603284	林平发展	46	1,719.02	0.00
257	001220	世盟股份	57	1,678.65	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300394	天孚通信	4,465,863.00	1.01
2	300750	宁德时代	4,249,959.00	0.96
3	601877	正泰电器	4,013,046.00	0.91

4	600999	招商证券	4,010,730.96	0.91
5	000776	广发证券	3,986,137.00	0.90
6	601939	建设银行	3,952,762.00	0.89
7	002594	比亚迪	3,904,719.00	0.88
8	300475	香农芯创	3,876,962.00	0.88
9	002948	青岛银行	3,791,617.00	0.86
10	000001	平安银行	3,756,802.00	0.85
11	300661	圣邦股份	3,747,205.00	0.85
12	600886	国投电力	3,612,431.00	0.82
13	300408	三环集团	3,530,803.00	0.80
14	600026	中远海能	3,489,152.00	0.79
15	600015	华夏银行	3,488,949.00	0.79
16	002371	北方华创	3,460,468.00	0.78
17	000807	云铝股份	3,379,028.00	0.76
18	600018	上港集团	3,335,002.00	0.75
19	600489	中金黄金	3,284,975.00	0.74
20	000651	格力电器	3,277,325.00	0.74

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688072	拓荆科技	7,742,596.91	1.75
2	601138	工业富联	6,352,542.00	1.43
3	600989	宝丰能源	5,743,245.00	1.30
4	002475	立讯精密	5,417,069.00	1.22
5	688183	生益电子	5,413,132.92	1.22
6	300750	宁德时代	5,254,579.00	1.19
7	601939	建设银行	5,237,095.00	1.18
8	000338	潍柴动力	5,165,675.00	1.17
9	300274	阳光电源	4,994,778.00	1.13
10	688041	海光信息	4,955,191.41	1.12
11	688702	盛科通信	4,696,101.86	1.06
12	600519	贵州茅台	4,656,862.00	1.05
13	600188	兖矿能源	4,191,203.60	0.95
14	601169	北京银行	4,131,960.00	0.93
15	688008	澜起科技	4,109,764.62	0.93
16	600011	华能国际	4,076,651.00	0.92
17	601318	中国平安	4,049,855.00	0.91
18	600690	海尔智家	4,033,933.00	0.91
19	300308	中际旭创	4,020,698.00	0.91
20	601166	兴业银行	3,992,506.00	0.90

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	416,172,291.39
卖出股票收入（成交）总额	461,540,167.56

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间基金遇到大额申赎时，我们有使用股指期货套保保持仓位。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发证券（000776）在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚。

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

的要求。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,760,857.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	572,270.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	36,538.44
8	其他	-
9	合计	2,369,666.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华泰柏瑞 沪深 300 指数增强	52,786	3,289.96	87,654,457.41	50.47	86,009,413.83	49.53

A						
华泰柏瑞 沪深 300 指数增强 C	10,809	5,245.74	31,376,702.44	55.34	25,324,554.87	44.66
合计	63,483	3,628.77	119,031,159.85	51.67	111,333,968.70	48.33

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	170,344.50	0.0981
	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C	10.36	0.0000
	合计	170,354.86	0.0739

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	0
	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	10~50
	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华泰柏瑞	53,648	3,300.69	88,482,798.57	49.97	88,592,794.70	50.03

量化驱动混合 A						
华泰柏瑞量化驱动混合 C	10,131	5,259.96	31,325,803.87	58.79	21,962,840.78	41.21
合计	63,672	3,617.98	119,808,602.44	52.01	110,555,635.48	47.99

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

8.2 盈利投资者数量占比

注：本基金转型前报告期为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，故未计算盈利投资者数量占比。

8.3 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	华泰柏瑞量化驱动混合 A	170,344.50	0.0962
	华泰柏瑞量化驱动混合 C	0.00	0.0000
	合计	170,344.50	0.0739

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	华泰柏瑞量化驱动混合 A	0
	华泰柏瑞量化驱动混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化驱动混合 A	10~50
	华泰柏瑞量化驱动混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2026 年 6 月 12 日）基金份额总额	177,075,593.27	53,288,644.65
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,000,265.63	4,964,815.32

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,411,987.66	1,552,202.66
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	173,663,871.24	56,701,257.31

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C
基金合同生效日（2015 年 03 月 24 日）基金份额总额	3,771,012,613.64	-
本报告期期初基金份额总额	221,866,350.33	28,835,487.31
本报告期基金总申购份额	6,064,241.84	65,233,743.09
减：本报告期基金总赎回份额	50,854,998.90	40,780,585.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	177,075,593.27	53,288,644.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2026 年 4 月 30 日至 2026 年 6 月 1 日止以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会决定的事项自 2026 年 6 月 2 日起生效。根据基金份额持有人大会表决通过的议案及方案说明，本基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金并相应修改基金合同，修订后的法律文件于 2026 年 6 月 12 日起生效。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：
经公司股东书面决定，谢仕荣先生于 2026 年 1 月 16 日起担任公司董事，陈健先生担任公司监事，Kirk Chester SWEENEY 先生不再担任公司董事，卢龙威先生不再担任公司监事。

经公司股东书面决定，刘晓冰先生于 2026 年 3 月 21 日起担任公司董事，徐珊女士担任公司监事，陆春光先生不再担任公司董事，刘晓冰先生不再担任公司监事。

经公司董事会审议通过，董辰先生于 2026 年 3 月 25 日起担任公司副总经理。

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的重大人事变动：

无

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 3 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	—
管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 2	内容

受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 6 月 8 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型后)

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
东北证券	3	98,818,293.80	100.00	19,764.55	100.00	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-

证券						
国投证券	3	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	5	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

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、租用证券公司交易单元的变更情况：本基金于 2026 年 06 月 12 日成立，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
东北证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛（中	-	-	-	-	-	-

国) 证券						
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
金融街证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型前)

10.7.1 基金租用或者通过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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			比例 (%)		(%)	
中金公司	2	249,970,105.55	28.54	124,993.87	28.54	—
兴业证券	2	199,753,410.99	22.81	99,883.14	22.81	—
中信证券	3	175,163,898.63	20.00	87,588.33	20.00	—
东北证券	3	85,021,848.21	9.71	42,513.15	9.71	—
国海证券	1	72,575,416.42	8.29	36,290.66	8.29	—
东方财富证券	2	53,353,045.86	6.09	26,679.59	6.09	—
高盛（中国）证券	1	30,400,737.94	3.47	15,201.05	3.47	—
东吴证券	2	9,599,918.00	1.10	4,800.80	1.10	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	4	—	—	—	—	—
东方证券	3	—	—	—	—	—
东兴证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	4	—	—	—	—	—
国都证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
国联民生证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通证券	3	—	—	—	—	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国新证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
华安证券	2	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	4	—	—	—	—	—
华鑫证券	1	—	—	—	—	—
金融街证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
万联证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	5	—	—	—	—	—
中金财富	1	—	—	—	—	—

证券						
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

(1) 具有相应的业务经营资格；

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

(3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，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。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

华鑫证券	-	-	-	-	-	-
金融街证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件（转型后）

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部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领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	2026 年 06 月 12 日

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金暨基金合同生效的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 11 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）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	2026 年 06 月 06 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 03 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 05 月 07 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞量化驱动灵	证监会规定报刊和网站	2026 年 05 月 06 日

	活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 30 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 10 日
8	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	2026 年 03 月 27 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 05 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	2026 年 02 月 27 日
11	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	2026 年 01 月 26 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准变更注册文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》

- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日