

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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	64
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
场内简称	ETF500（扩位证券简称：中证 500ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	397,429,801.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 6 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的股票投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	大五道口广场 1 号楼 17 层	
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 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	证券时报
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

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 华泰柏瑞基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	150,363,019.18
本期利润	213,849,758.11
加权平均基金份额本期利润	0.4780
本期加权平均净值利润率	19.72%
本期基金份额净值增长率	23.03%
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	265,458,641.78
期末可供分配基金份额利润	0.6679
期末基金资产净值	1,064,856,225.22
期末基金份额净值	2.6794
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	35.81%

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

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

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

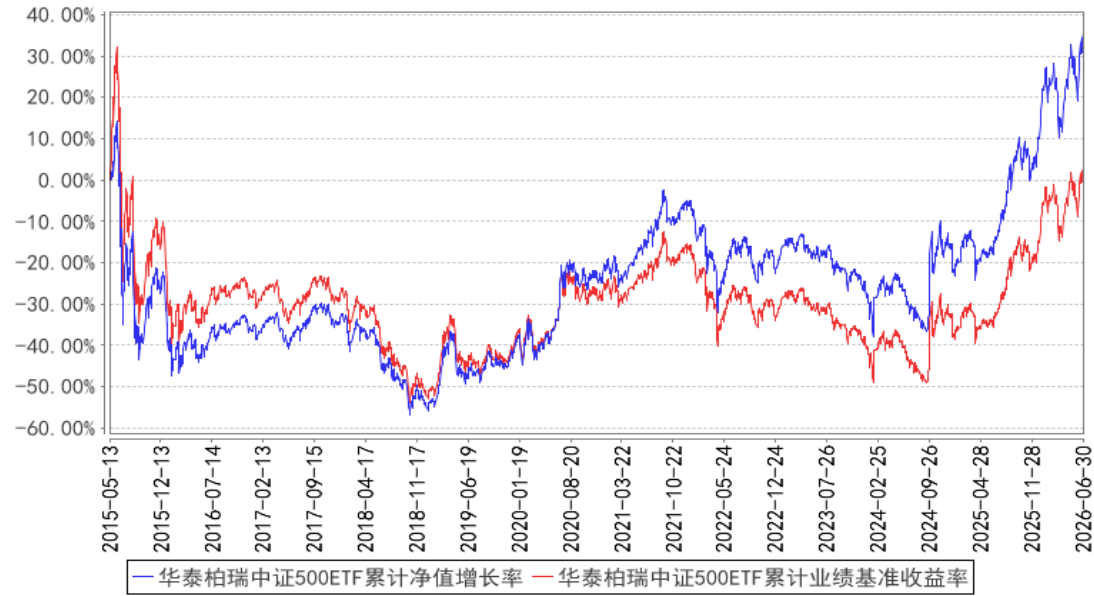
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	20.30%	1.64%	18.56%	1.65%	1.74%	-0.01%
过去六个月	23.03%	1.65%	20.97%	1.66%	2.06%	-0.01%
过去一年	58.09%	1.42%	52.68%	1.42%	5.41%	0.00%
过去三年	65.42%	1.48%	50.55%	1.49%	14.87%	-0.01%
过去五年	58.85%	1.36%	32.65%	1.36%	26.20%	0.00%
过去七年	152.44%	1.35%	82.43%	1.36%	70.01%	-0.01%
过去十年	122.19%	1.34%	47.49%	1.35%	74.70%	-0.01%
自基金合同生效起至今	35.81%	1.57%	3.27%	1.59%	32.54%	-0.02%

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

华泰柏瑞中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2026 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成

为华泰证券股份有限公司、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

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理	2026 年 6 月 16 日	-	7 年	理学硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
胡亦清	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2025 年 1 月 23 日	-	12 年	硕士毕业于美国东北大学应用数学专业。2014 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任风险分析员、高级风险分析师、指数投资部高级研究员、总监助理兼投资经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞北证 50 成份指数型证券投资基金、华泰柏瑞中

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

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。胡亦清 2026 年 7 月 28 日离任本基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

回顾 2026 年上半年，中证 500 指数展现出中盘弹性，累计上涨 20.97%。年初，商业航天、资源品、AI 应用及存储等板块带动指数走强，中盘风格阶段性占优；3 月受外部扰动影响，市场波动加大，前期强势方向涨幅有所收窄。二季度政策预期和市场情绪转暖，市场修复范围逐步扩大，科技制造、医药、材料、周期及消费等多个领域轮番表现。中证 500 成份股兼具一定经营基础和成长空间，对先进制造和新兴产业覆盖较为充分，在上半年大盘与小盘风格反复切换的过程中，整体表现相对均衡，并体现出一定盈利弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.6794 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.03%，业绩比较基准收益率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中盘公司的业绩变化将成为影响指数的重要因素。制造业升级、设备更新、科技创新及部分行业供需格局改善，仍可能为成份股订单和利润提供支撑；科技成长与周期修复也可能继续构成指数的主要结构性线索。随着市场关注点逐步转向业绩兑现，盈利改善能否延续、现金流是否稳健以及估值是否合理将变得更加重要。近期市场轮动有所加快，中证 500 行业覆盖较广、风格相对均衡的特点有助于适应不同市场环境，但仍需关注外需变化、原材料价格波动，以及前期表现较强板块面临的估值消化压力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；基金收益分配比例为收益评价日符

合上述基金分红条件的基金超额收益的 100%；基金收益分配每年至多 4 次。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”）在华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，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）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	13,114,181.08	18,856,863.62
结算备付金		30,267,683.26	21,614,806.43
存出保证金		4,811,669.95	4,725,726.70

交易性金融资产	6.4.7.2	1,021,017,056.18	886,857,660.63
其中：股票投资		1,020,969,055.34	886,760,659.14
基金投资		-	-
债券投资		48,000.84	97,001.49
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		161,544.08	38,871.66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,069,372,134.55	932,093,929.04
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30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		3,138,903.39	2,209,474.31
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		127,207.74	117,957.43
应付托管费		42,402.56	39,319.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		27,310.60	24,434.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,180,085.04	2,093,181.03
负债合计		4,515,909.33	4,484,366.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	799,397,583.44	856,723,005.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	265,458,641.78	70,886,556.71
净资产合计		1,064,856,225.22	927,609,562.34

负债和净资产总计		1,069,372,134.55	932,093,929.04
----------	--	------------------	----------------

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.6794 元，基金份额总额 397,429,801.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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 30 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		215,046,589.65	61,304,138.72
1. 利息收入		177,920.14	97,858.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	177,920.14	97,858.65
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）		150,998,680.00	22,215,073.07
其中：股票投资收益	6.4.7.14	136,334,527.79	12,254,333.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	55,574.11	74,965.39
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	8,029,316.77	-3,826.81
股利收益	6.4.7.19	6,579,261.33	9,889,600.56
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	63,486,738.93	38,628,112.15
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	383,250.58	363,094.85
减：二、营业总支出		1,196,831.54	1,268,432.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	807,217.84	823,179.62
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	6.4.10.2.2	269,072.61	274,393.28
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		28,919.55	1,034.77
8. 其他费用	6.4.7.23	91,621.54	169,825.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		213,849,758.11	60,035,705.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		213,849,758.11	60,035,705.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		213,849,758.11	60,035,705.74

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	856,723,005.63	-	70,886,556.71	927,609,562.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	856,723,005.63	-	70,886,556.71	927,609,562.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-57,325,422.19	-	194,572,085.07	137,246,662.88
（一）、综合收益总额	-	-	213,849,758.11	213,849,758.11
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-57,325,422.19	-	-19,277,673.04	-76,603,095.23

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	174,993,393.97	-	34,767,400.72	209,760,794.69
2. 基金赎回款	-232,318,816.16	-	-54,045,073.76	-286,363,889.92
(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	799,397,583.44	-	265,458,641.78	1,064,856,225.22
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	1,550,662,326.60	-	-304,328,913.60	1,246,333,413.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,550,662,326.60	-	-304,328,913.60	1,246,333,413.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-334,901,150.53	-	112,995,267.33	-221,905,883.20
(一)、综合收益总额	-	-	60,035,705.74	60,035,705.74
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-334,901,150.53	-	52,959,561.59	-281,941,588.94
其中：1. 基金申购款	181,027,648.96	-	-37,053,938.32	143,973,710.64

2. 基金赎回款	-515,928,799.49	-	90,013,499.91	-425,915,299.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,215,761,176.07	-	-191,333,646.27	1,024,427,529.80

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

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]508 号《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 873,771,921.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 48,140.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2015 年 6 月 3 日进行了基金

份额折算，折算比例为 0.49716235，并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2019 年 10 月 16 日起，新增投资范围：本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 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 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 01 月 01 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 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税交易，资管产品管理人为纳税人。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，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税交易，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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、债券取得的收入免征增值税。

资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。根据财政部、

国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	13,114,181.08
等于：本金	13,112,894.74
加：应计利息	1,286.34
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	13,114,181.08

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		798,743,874.09	-	1,020,969,055.34	222,225,181.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	48,000.00	0.84	48,000.84	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	48,000.00	0.84	48,000.84	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		798,791,874.09	0.84	1,021,017,056.18	222,225,181.25

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	35,487,320.00	-	-	
其中：股指期货投资	35,487,320.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	35,487,320.00	-	-	

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。

6.4.7.3.2 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
IC2609	中证 500 股指期货 2609	22.00	38,550,160.00	3,062,840.00
合计				3,062,840.00
减：可抵销期货暂收款				3,062,840.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	93,150.47
其中：交易所市场	93,150.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应退退补款	997,674.42
合计	1,180,085.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	425,929,801.00	856,723,005.63
本期申购	87,000,000.00	174,993,393.97
本期赎回（以“-”号填列）	-115,500,000.00	-232,318,816.16
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	397,429,801.00	799,397,583.44

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	217,800,678.16	-146,914,121.45	70,886,556.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	217,800,678.16	-146,914,121.45	70,886,556.71
本期利润	150,363,019.18	63,486,738.93	213,849,758.11
本期基金份额交易产生的变动数	-26,047,199.25	6,769,526.21	-19,277,673.04
其中：基金申购款	48,014,910.43	-13,247,509.71	34,767,400.72
基金赎回款	-74,062,109.68	20,017,035.92	-54,045,073.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	342,116,498.09	-76,657,856.31	265,458,641.78

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 30 日
活期存款利息收入	24,419.66
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	153,255.26
其他	245.22
合计	177,920.14

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30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	109,729,927.03
股票投资收益——赎回差价收入	26,604,600.76
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	136,334,527.79

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 30 日
卖出股票成交总额	316,685,136.17
减：卖出股票成本总额	206,635,894.87
减：交易费用	319,314.27
买卖股票差价收入	109,729,927.03

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	286,363,889.92
减：现金支付赎回款总额	147,278,619.92
减：赎回股票成本总额	112,480,669.24
减：交易费用	—
赎回差价收入	26,604,600.76

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	55,570.44
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	55,574.11

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	152,581.00

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	97,000.00
减：应计利息总额	4.46
减：交易费用	6.10
买卖债券差价收入	55,570.44

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 30 日
股指期货投资收益	8,029,316.77

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 30 日
股票投资产生的股利收益	6,579,261.33
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	6,579,261.33

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 30 日
1. 交易性金融资产	63,369,658.93
股票投资	63,369,658.93
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	117,080.00
权证投资	—
期货投资	117,080.00
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	63,486,738.93

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 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	383,250.58
合计	383,250.58

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

股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	2,077.86
存托服务费	283.53
合计	91,621.54

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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东的子公司
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
华泰证券	-	-	62,544,925.60	11.91

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-
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 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	12,510.34	11.91	5,964.92	10.63

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	807,217.84	823,179.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,995.77	212.23
应支付基金管理人的净管理费	799,222.07	822,967.39

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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 30 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	269,072.61	274,393.28

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	241,373,107.00	60.7335	251,720,861.00	59.0991
华泰证券股份有限公司	1,865,123.00	0.4693	1,566,177.00	0.3677

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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 30 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	13,114,181.08	24,419.66	22,958,732.30	31,919.29

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 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	603293.SH	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
华泰联合证券	301458	钧崴电子	网下申购	7,005	72,852.00
中银国际证券	603409	汇通控股	网下申购	1,000	24,180.00
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56

华泰联合证券	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合证券	127108	太能转债	优先配售	3,012	301,200.00

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 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	10.11	10.11	32,420	327,766.20	327,766.20	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	13,893	140,458.23	140,458.23	-
001257	盛	2026	6 个月	新	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

	龙股份	年 3 月 24 日		股 锁 定 期 内						
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	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	10.12	27.73	5,067	51,278.04	140,507.91	-
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	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新 股 锁	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

	能	日		定期内						
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
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	714	49,737.24	114,282.84	-
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	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

				内						
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
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	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
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	2026	6 个月	新	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-

	芯生命	年 1 月 28 日		股 锁 定 期 内						
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	6,335	143,677.80	267,083.60	-
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	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月以上	新 股 锁 定 期 内	114.28	676.94	3,347	382,495.16	2,265,718.18	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
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	2,430	254,323.80	1,868,402.70	-
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	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新 股 锁	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

	材	日		定期内						
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	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股锁定期内	19.68	141.49	1,513	29,775.84	214,074.37	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026年6月23日	1个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	480	48,000.00	48,000.84	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.005% (2025 年 12 月 31 日：0.01%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

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

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

日							
资产							
货币资金	13,114,181.08	-	-	-	-	-	13,114,181.08
结算备付金	30,267,683.26	-	-	-	-	-	30,267,683.26
存出保证金	185,650.75	-	-	-	-	4,626,019.20	4,811,669.95
交易性金融资产	-	-	-	-	48,000.84	1,020,969,055.34	1,021,017,056.18
应收清算款	-	-	-	-	-	161,544.08	161,544.08
资产总计	43,567,515.09	-	-	-	48,000.84	1,025,756,618.62	1,069,372,134.55
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	127,207.74	127,207.74
应付托管费	-	-	-	-	-	42,402.56	42,402.56
应付清算款	-	-	-	-	-	3,138,903.39	3,138,903.39
应交税费	-	-	-	-	-	27,310.60	27,310.60
其他负债	-	-	-	-	-	1,180,085.04	1,180,085.04
负债总计	-	-	-	-	-	4,515,909.33	4,515,909.33
利率敏感度缺口	43,567,515.09	-	-	-	48,000.84	1,021,240,709.29	1,064,856,225.22
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	18,856,863.62	-	-	-	-	-	18,856,863.62
结算备付金	21,614,806.43	-	-	-	-	-	21,614,806.43
存出保证金	128,968.30	-	-	-	-	4,596,758.40	4,725,726.70
交易性金融资产	-	-	-	-	97,001.49	886,760,659.14	886,857,660.63
应收清算款	-	-	-	-	-	38,871.66	38,871.66
资产总计	40,600,638.35	-	-	-	97,001.49	891,396,289.20	932,093,929.04
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	117,957.43	117,957.43

应付托管费	-	-	-	-	-	39,319.15	39,319.15
应付清算款	-	-	-	-	-	2,209,474.31	2,209,474.31
应交税费	-	-	-	-	-	24,434.78	24,434.78
其他负债	-	-	-	-	-	2,093,181.03	2,093,181.03
负债总计	-	-	-	-	-	4,484,366.70	4,484,366.70
利率敏感度缺口	40,600,638.35	-	-	-	97,001.49	886,911,922.50	927,609,562.34

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.005%(2025 年 12 月 31 日：0.01%)，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 30 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	1,020,969,055.34	95.88	886,760,659.14	95.60

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	1,020,969,055.34	95.88	886,760,659.14	95.60

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资。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30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	52,820,263.69	46,220,213.89
	业绩比较基准下降5%	-52,820,263.69	-46,220,213.89

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	上年度末 2025年12月31日
第一层次	1,014,114,429.99	883,097,819.76

第二层次	516,225.27	97,001.49
第三层次	6,386,400.92	3,662,839.38
合计	1,021,017,056.18	886,857,660.63

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(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

(1) 基金申购款

于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 209,760,794.69 元(2025 年度:257,003,985.02 元),其中包括以股票支付的申购款 94,100,208.34 元和以现金支付的申购款 115,660,586.35 元 (2025 年度: 其中包括以股票支付的申购款 106,245,080.67 元和以现金支付的申购款 150,758,904.35 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,020,969,055.34	95.47
	其中：股票	1,020,969,055.34	95.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,000.84	0.00
	其中：债券	48,000.84	0.00

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,381,864.34	4.06
8	其他各项资产	4,973,214.03	0.47
9	合计	1,069,372,134.55	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,310,045.16	0.31
B	采矿业	31,085,182.22	2.92
C	制造业	763,156,256.18	71.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,669,749.59	2.32
E	建筑业	5,949,753.80	0.56
F	批发和零售业	19,164,962.88	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	12,202,310.91	1.15
H	住宿和餐饮业	726,796.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,054,483.97	6.20
J	金融业	55,445,273.65	5.21
K	房地产业	4,088,289.28	0.38
L	租赁和商务服务业	10,377,890.08	0.97
M	科学研究和技术服务业	7,374,114.30	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	3,440,004.54	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,374,128.76	0.22
R	文化、体育和娱乐业	4,708,820.92	0.44
S	综合	-	-
	合计	1,014,128,062.24	95.24

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	6,335,035.39	0.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	468,224.43	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	6,840,993.10	0.64

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	8,962	16,902,332.00	1.59
2	300604	长川科技	39,600	13,520,232.00	1.27
3	001309	德明利	14,100	13,294,890.00	1.25

4	688347	华虹宏力	35,965	12,095,029.50	1.14
5	688120	华海清科	35,165	11,329,459.70	1.06
6	002281	光迅科技	43,345	11,137,064.30	1.05
7	002008	大族激光	73,900	11,093,129.00	1.04
8	300857	协创数据	31,020	10,543,698.00	0.99
9	300136	信维通信	87,500	10,434,375.00	0.98
10	688361	中科飞测	21,006	9,032,580.00	0.85
11	300475	香农芯创	29,200	8,760,000.00	0.82
12	300223	北京君正	35,000	8,711,500.00	0.82
13	002436	兴森科技	152,800	7,785,160.00	0.73
14	300285	国瓷材料	71,500	7,377,370.00	0.69
15	300054	鼎龙股份	68,200	7,227,154.00	0.68
16	600105	永鼎股份	104,200	7,031,416.00	0.66
17	300666	江丰电子	18,600	6,855,960.00	0.64
18	300757	罗博特科	11,000	6,809,000.00	0.64
19	688200	华峰测控	12,925	6,786,917.50	0.64
20	688037	芯源微	15,400	6,761,370.00	0.63
21	688777	中控技术	57,234	6,724,995.00	0.63
22	000021	深科技	98,765	6,347,626.55	0.60
23	002851	麦格米特	37,500	6,269,250.00	0.59
24	601869	长飞光纤	11,200	6,114,080.00	0.57
25	300346	南大光电	62,700	5,809,155.00	0.55
26	688019	安集科技	17,050	5,787,793.00	0.54
27	002409	雅克科技	25,600	5,747,200.00	0.54
28	300548	长芯博创	20,600	5,726,800.00	0.54
29	300567	精测电子	17,400	5,526,240.00	0.52
30	600498	烽火通信	73,100	5,380,160.00	0.51
31	002185	华天科技	239,000	5,332,090.00	0.50
32	002138	顺络电子	72,300	5,285,130.00	0.50
33	002407	多氟多	105,100	5,279,173.00	0.50
34	688002	睿创微纳	33,374	5,162,624.06	0.48
35	300395	菲利华	38,400	5,135,232.00	0.48
36	688313	仕佳光子	27,701	5,114,989.65	0.48
37	688017	绿的谐波	12,146	5,075,327.56	0.48
38	600879	航天电子	237,754	5,061,782.66	0.48
39	300390	天华新能	52,320	4,892,443.20	0.46
40	300620	光库科技	12,900	4,878,780.00	0.46
41	688469	芯联集成	452,361	4,799,550.21	0.45
42	301526	国际复材	99,600	4,648,332.00	0.44
43	300373	扬杰科技	29,490	4,636,712.70	0.44
44	688702	盛科通信	11,644	4,541,043.56	0.43
45	300058	蓝色光标	322,533	4,438,054.08	0.42
46	002273	水晶光电	124,878	4,430,671.44	0.42

47	300037	新宙邦	47,240	4,386,234.00	0.41
48	688172	燕东微	50,899	4,258,210.34	0.40
49	603256	宏和科技	15,700	4,165,681.00	0.39
50	300751	迈为股份	14,700	4,152,162.00	0.39
51	605358	立昂微	52,992	4,112,179.20	0.39
52	301377	鼎泰高科	7,400	4,076,660.00	0.38
53	600988	赤峰黄金	149,400	3,932,208.00	0.37
54	605589	圣泉集团	61,400	3,903,198.00	0.37
55	600885	宏发股份	111,738	3,853,843.62	0.36
56	688099	晶晨股份	37,427	3,851,238.30	0.36
57	002738	中矿资源	64,300	3,793,057.00	0.36
58	002126	银轮股份	76,100	3,789,780.00	0.36
59	000960	锡业股份	87,900	3,752,451.00	0.35
60	600392	盛和资源	125,900	3,748,043.00	0.35
61	600601	方正科技	266,300	3,685,592.00	0.35
62	000831	中国稀土	66,300	3,678,987.00	0.35
63	001389	广合科技	15,000	3,558,750.00	0.33
64	600141	兴发集团	75,311	3,537,357.67	0.33
65	600378	昊华科技	45,900	3,459,942.00	0.32
66	601179	中国西电	230,551	3,439,820.92	0.32
67	300570	太辰光	13,900	3,429,269.00	0.32
68	301358	湖南裕能	45,100	3,421,737.00	0.32
69	002195	岩山科技	510,200	3,336,708.00	0.31
70	002812	恩捷股份	49,600	3,318,736.00	0.31
71	688629	华丰科技	17,429	3,268,111.79	0.31
72	600497	驰宏锌锗	268,946	3,256,936.06	0.31
73	002850	科达利	17,200	3,255,960.00	0.31
74	688234	天岳先进	18,598	3,226,938.98	0.30
75	002261	拓维信息	113,800	3,187,538.00	0.30
76	600157	永泰能源	1,962,500	3,159,625.00	0.30
77	688052	纳芯微	10,793	3,111,729.83	0.29
78	002340	格林美	459,124	3,034,809.64	0.28
79	600711	盛屯矿业	275,300	3,020,041.00	0.28
80	600909	华安证券	270,390	3,004,032.90	0.28
81	600143	金发科技	191,300	2,955,585.00	0.28
82	688027	国盾量子	5,844	2,945,434.44	0.28
83	300017	网宿科技	224,000	2,914,240.00	0.27
84	000783	长江证券	298,100	2,906,475.00	0.27
85	002131	利欧股份	609,100	2,893,225.00	0.27
86	301200	大族数控	8,000	2,885,200.00	0.27
87	688411	海博思创	9,883	2,877,929.60	0.27
88	002821	凯莱英	17,700	2,867,400.00	0.27
89	003031	中瓷电子	15,891	2,865,147.30	0.27

90	600352	浙江龙盛	234,300	2,837,373.00	0.27
91	601555	东吴证券	357,630	2,832,429.60	0.27
92	002966	苏州银行	401,800	2,796,528.00	0.26
93	002203	海亮股份	122,200	2,792,270.00	0.26
94	688235	百济神州	10,893	2,773,466.73	0.26
95	301611	珂玛科技	15,400	2,773,078.00	0.26
96	603659	璞泰来	95,800	2,771,494.00	0.26
97	601233	桐昆股份	127,500	2,760,375.00	0.26
98	300339	润和软件	71,400	2,749,614.00	0.26
99	688220	翱捷科技	21,399	2,660,323.68	0.25
100	300759	康龙化成	91,700	2,652,881.00	0.25
101	688213	思特威	24,538	2,627,283.66	0.25
102	603129	春风动力	10,200	2,609,160.00	0.25
103	688578	艾力斯	23,680	2,585,856.00	0.24
104	002472	双环传动	61,600	2,557,016.00	0.24
105	688122	西部超导	40,399	2,537,461.19	0.24
106	603308	应流股份	42,000	2,536,800.00	0.24
107	300207	欣旺达	133,100	2,527,569.00	0.24
108	601108	财通证券	291,400	2,520,610.00	0.24
109	002517	恺英网络	153,700	2,497,625.00	0.23
110	300001	特锐德	65,950	2,494,888.50	0.23
111	300458	全志科技	63,080	2,489,136.80	0.23
112	002797	第一创业	377,900	2,482,803.00	0.23
113	600563	法拉电子	12,878	2,457,122.40	0.23
114	002601	龙佰集团	148,300	2,443,984.00	0.23
115	688387	信科移动	122,837	2,437,086.08	0.23
116	601958	金钼股份	86,400	2,428,704.00	0.23
117	300115	长盈精密	85,800	2,397,252.00	0.23
118	688385	复旦微电	33,318	2,375,240.22	0.22
119	601991	大唐发电	334,700	2,369,676.00	0.22
120	601198	东兴证券	174,200	2,367,378.00	0.22
121	000703	恒逸石化	173,700	2,357,109.00	0.22
122	002155	湖南黄金	98,104	2,341,742.48	0.22
123	002465	海格通信	178,477	2,279,151.29	0.21
124	601665	齐鲁银行	387,700	2,237,029.00	0.21
125	002056	横店东磁	72,943	2,223,302.64	0.21
126	300454	深信服	23,100	2,222,220.00	0.21
127	603179	新泉股份	44,680	2,218,362.00	0.21
128	603156	养元饮品	45,000	2,208,150.00	0.21
129	600884	杉杉股份	162,200	2,197,810.00	0.21
130	300024	机器人	113,100	2,186,223.00	0.21
131	688322	奥比中光	16,732	2,184,362.60	0.21
132	600707	彩虹股份	129,100	2,180,499.00	0.20

133	002130	沃尔核材	113,800	2,157,648.00	0.20
134	002402	和而泰	83,375	2,153,576.25	0.20
135	603650	彤程新材	21,976	2,153,208.48	0.20
136	688331	荣昌生物	16,417	2,138,478.42	0.20
137	601162	天风证券	634,200	2,137,254.00	0.20
138	688301	奕瑞科技	17,072	2,116,928.00	0.20
139	000060	中金岭南	279,600	2,116,572.00	0.20
140	002429	兆驰股份	203,500	2,114,365.00	0.20
141	300012	华测检测	151,200	2,095,632.00	0.20
142	002432	九安医疗	29,500	2,085,060.00	0.20
143	000878	云南铜业	130,914	2,078,914.32	0.20
144	300496	中科创达	33,600	2,076,144.00	0.19
145	601099	太平洋	613,100	2,066,147.00	0.19
146	603379	三美股份	27,180	2,062,690.20	0.19
147	688676	金盘科技	24,234	2,051,165.76	0.19
148	600109	国金证券	233,400	2,049,252.00	0.19
149	688266	泽璟制药	17,514	2,043,183.24	0.19
150	002414	高德红外	153,600	2,036,736.00	0.19
151	000893	亚钾国际	49,800	2,036,322.00	0.19
152	002271	东方雨虹	171,500	2,035,705.00	0.19
153	000034	神州数码	72,780	2,019,645.00	0.19
154	689009	九号公司	52,640	2,008,216.00	0.19
155	300474	景嘉微	33,200	2,007,936.00	0.19
156	603979	金诚信	34,000	2,007,020.00	0.19
157	300623	捷捷微电	44,600	2,006,554.00	0.19
158	603688	石英股份	24,250	2,003,292.50	0.19
159	002335	科华数据	47,130	2,000,668.50	0.19
160	000733	振华科技	35,300	1,999,392.00	0.19
161	002444	巨星科技	63,833	1,985,206.30	0.19
162	600298	安琪酵母	54,800	1,983,760.00	0.19
163	002487	大金重工	34,200	1,982,574.00	0.19
164	600060	海信视像	70,082	1,953,185.34	0.18
165	600256	广汇能源	394,600	1,949,324.00	0.18
166	002756	永兴材料	34,300	1,942,752.00	0.18
167	688728	格科微	92,032	1,936,353.28	0.18
168	000661	长春高新	28,900	1,924,740.00	0.18
169	300748	金力永磁	62,100	1,915,785.00	0.18
170	300763	锦浪科技	21,200	1,915,420.00	0.18
171	600699	均胜电子	88,440	1,911,188.40	0.18
172	600021	上海电力	126,745	1,910,047.15	0.18
173	601128	常熟银行	327,949	1,908,663.18	0.18
174	301536	星辰科技	14,800	1,904,908.00	0.18
175	601615	明阳智能	163,100	1,887,067.00	0.18

176	002078	太阳纸业	150,674	1,881,918.26	0.18
177	601577	长沙银行	216,000	1,881,360.00	0.18
178	002157	正邦科技	665,800	1,870,898.00	0.18
179	688608	恒玄科技	11,180	1,869,184.20	0.18
180	002025	航天电器	24,500	1,867,390.00	0.18
181	601696	中银证券	147,500	1,865,875.00	0.18
182	300142	沃森生物	143,300	1,861,467.00	0.17
183	300073	当升科技	38,600	1,854,344.00	0.17
184	300432	富临精工	91,843	1,845,125.87	0.17
185	603606	东方电缆	44,440	1,844,704.40	0.17
186	603087	甘李药业	32,500	1,844,700.00	0.17
187	603920	世运电路	38,300	1,839,932.00	0.17
188	300919	中伟新材	41,700	1,824,375.00	0.17
189	000423	东阿阿胶	40,000	1,814,400.00	0.17
190	688599	天合光能	126,380	1,784,485.60	0.17
191	688343	云天励飞	21,763	1,777,166.58	0.17
192	002252	上海莱士	407,600	1,768,984.00	0.17
193	000728	国元证券	235,700	1,765,393.00	0.17
194	300724	捷佳伟创	25,000	1,765,000.00	0.17
195	688375	国博电子	16,908	1,763,504.40	0.17
196	603290	斯达半导	11,400	1,743,516.00	0.16
197	688018	乐鑫科技	13,350	1,707,732.00	0.16
198	002064	华峰化学	178,500	1,693,965.00	0.16
199	300953	震裕科技	12,600	1,684,620.00	0.16
200	688169	石头科技	17,689	1,679,924.33	0.16
201	603119	浙江荣泰	24,900	1,651,866.00	0.16
202	002831	裕同科技	46,123	1,640,133.88	0.15
203	688188	柏楚电子	15,358	1,638,698.60	0.15
204	600171	上海贝岭	51,000	1,628,940.00	0.15
205	688180	君实生物	48,109	1,627,046.38	0.15
206	000786	北新建材	89,500	1,619,055.00	0.15
207	001203	大中矿业	53,800	1,611,310.00	0.15
208	300383	光环新网	129,300	1,608,492.00	0.15
209	300679	电连技术	26,800	1,607,732.00	0.15
210	300677	英科医疗	40,760	1,596,569.20	0.15
211	300972	万辰集团	9,200	1,595,372.00	0.15
212	000519	中兵红箭	75,086	1,582,062.02	0.15
213	603806	福斯特	93,400	1,568,186.00	0.15
214	600177	雅戈尔	208,000	1,566,240.00	0.15
215	600516	方大炭素	253,400	1,563,478.00	0.15
216	002673	西部证券	240,200	1,558,898.00	0.15
217	603160	汇顶科技	25,100	1,548,921.00	0.15
218	601699	潞安环能	107,900	1,540,812.00	0.14

219	000559	万向钱潮	118,801	1,536,096.93	0.14
220	600642	申能股份	175,900	1,535,607.00	0.14
221	000623	吉林敖东	86,500	1,533,645.00	0.14
222	688187	时代电气	22,304	1,531,392.64	0.14
223	002624	完美世界	121,800	1,512,756.00	0.14
224	688065	凯赛生物	31,534	1,508,901.90	0.14
225	600637	东方明珠	181,500	1,508,265.00	0.14
226	300699	光威复材	52,400	1,501,260.00	0.14
227	002318	久立特材	62,000	1,481,800.00	0.14
228	000750	国海证券	401,642	1,478,042.56	0.14
229	001696	宗申动力	71,000	1,477,510.00	0.14
230	688568	中科星图	35,624	1,477,327.28	0.14
231	002085	万丰奥威	132,600	1,470,534.00	0.14
232	603444	吉比特	4,100	1,469,522.00	0.14
233	300558	贝达药业	22,500	1,464,075.00	0.14
234	688617	惠泰医疗	8,038	1,459,379.28	0.14
235	603345	安井食品	18,100	1,451,439.00	0.14
236	603225	新凤鸣	73,700	1,448,205.00	0.14
237	002739	儒意电影	150,500	1,444,800.00	0.14
238	600369	西南证券	358,600	1,441,572.00	0.14
239	002065	东华软件	201,700	1,440,138.00	0.14
240	000983	山西焦煤	248,200	1,439,560.00	0.14
241	600499	科达制造	103,600	1,429,680.00	0.13
242	002044	美年健康	281,700	1,416,951.00	0.13
243	300627	华测导航	49,820	1,414,888.00	0.13
244	002266	浙富控股	278,581	1,409,619.86	0.13
245	603596	伯特利	56,730	1,409,173.20	0.13
246	603699	纽威股份	28,000	1,408,400.00	0.13
247	600100	同方股份	205,500	1,407,675.00	0.13
248	600536	中国软件	49,913	1,403,553.56	0.13
249	000629	钒钛股份	417,000	1,392,780.00	0.13
250	002223	鱼跃医疗	54,255	1,392,183.30	0.13
251	000155	川能动力	115,600	1,384,888.00	0.13
252	300002	神州泰岳	176,800	1,380,808.00	0.13
253	000400	许继电气	63,540	1,378,818.00	0.13
254	688772	珠海冠宇	70,230	1,378,614.90	0.13
255	600595	中孚实业	245,100	1,377,462.00	0.13
256	601016	节能风电	352,550	1,367,894.00	0.13
257	300003	乐普医疗	115,400	1,367,490.00	0.13
258	600985	淮北矿业	96,700	1,358,635.00	0.13
259	000415	渤海租赁	333,800	1,358,566.00	0.13
260	601216	君正集团	303,400	1,353,164.00	0.13
261	600521	华海药业	93,900	1,352,160.00	0.13

262	601997	贵阳银行	263,300	1,350,729.00	0.13
263	002430	杭氧股份	43,600	1,349,856.00	0.13
264	000032	深桑达 A	54,100	1,349,795.00	0.13
265	000683	博源化工	234,200	1,348,992.00	0.13
266	601212	白银有色	265,400	1,348,232.00	0.13
267	601717	中创智领	96,802	1,346,515.82	0.13
268	300487	蓝晓科技	22,750	1,338,837.50	0.13
269	000039	中集集团	164,676	1,335,522.36	0.13
270	600862	中航高科	73,889	1,332,218.67	0.13
271	688692	达梦数据	5,452	1,331,869.08	0.13
272	600863	华能蒙电	283,200	1,331,040.00	0.12
273	603766	隆鑫通用	111,100	1,325,423.00	0.12
274	002841	视源股份	38,200	1,319,046.00	0.12
275	600704	物产中大	279,000	1,316,880.00	0.12
276	601001	晋控煤业	75,200	1,307,728.00	0.12
277	000050	深天马 A	131,700	1,305,147.00	0.12
278	601990	南京证券	197,520	1,297,706.40	0.12
279	600873	梅花生物	176,400	1,296,540.00	0.12
280	603077	和邦生物	555,685	1,289,189.20	0.12
281	600312	平高电气	73,000	1,289,180.00	0.12
282	688538	和辉光电	495,791	1,289,056.60	0.12
283	000729	燕京啤酒	126,610	1,282,559.30	0.12
284	000887	中鼎股份	70,721	1,265,198.69	0.12
285	603605	珀莱雅	21,100	1,264,312.00	0.12
286	000967	盈峰环境	120,000	1,263,600.00	0.12
287	600765	中航重机	97,586	1,260,811.12	0.12
288	600332	白云山	62,900	1,260,516.00	0.12
289	600348	华阳股份	162,631	1,244,127.15	0.12
290	600166	福田汽车	427,002	1,242,575.82	0.12
291	688615	合合信息	10,985	1,242,403.50	0.12
292	600153	建发股份	156,500	1,241,045.00	0.12
293	000830	鲁西化工	102,733	1,232,796.00	0.12
294	688297	中无人机	29,601	1,229,921.55	0.12
295	000062	深圳华强	38,200	1,215,524.00	0.11
296	601611	中国核建	108,700	1,212,005.00	0.11
297	002410	广联达	148,300	1,210,128.00	0.11
298	002939	长城证券	144,700	1,206,798.00	0.11
299	002007	华兰生物	98,400	1,199,496.00	0.11
300	600901	江苏金租	208,460	1,198,645.00	0.11
301	002683	广东宏大	40,500	1,186,245.00	0.11
302	600737	中粮糖业	95,893	1,182,360.69	0.11
303	600363	联创光电	32,800	1,173,584.00	0.11
304	600578	京能电力	180,700	1,165,515.00	0.11

305	002926	华西证券	141,000	1,151,970.00	0.11
306	603568	伟明环保	73,936	1,137,135.68	0.11
307	000591	太阳能	245,400	1,128,840.00	0.11
308	603728	鸣志电器	18,500	1,127,020.00	0.11
309	002603	以岭药业	75,000	1,125,000.00	0.11
310	600398	海澜之家	214,800	1,123,404.00	0.11
311	000921	海信家电	41,100	1,122,852.00	0.11
312	603298	杭叉集团	46,900	1,119,034.00	0.11
313	601799	星宇股份	12,300	1,114,626.00	0.10
314	688248	南网科技	16,035	1,109,301.30	0.10
315	000738	航发控制	60,600	1,108,374.00	0.10
316	000528	柳工	146,100	1,103,055.00	0.10
317	601000	唐山港	265,443	1,101,588.45	0.10
318	688114	华大智造	21,550	1,100,774.00	0.10
319	600486	扬农化工	21,560	1,093,092.00	0.10
320	688582	芯动联科	16,808	1,092,520.00	0.10
321	600208	衢州发展	382,700	1,083,041.00	0.10
322	600008	首创环保	395,600	1,076,032.00	0.10
323	000932	华菱钢铁	308,360	1,070,009.20	0.10
324	603341	龙旗科技	25,100	1,066,499.00	0.10
325	600995	南网储能	86,700	1,066,410.00	0.10
326	600170	上海建工	479,300	1,064,046.00	0.10
327	600316	洪都航空	38,053	1,063,200.82	0.10
328	600998	九州通	226,532	1,062,435.08	0.10
329	000737	北方铜业	80,300	1,061,566.00	0.10
330	600435	北方导航	94,745	1,061,144.00	0.10
331	000987	越秀资本	135,670	1,060,939.40	0.10
332	002152	广电运通	112,069	1,051,207.22	0.10
333	603486	科沃斯	20,500	1,040,375.00	0.10
334	002262	恩华药业	55,000	1,031,250.00	0.10
335	688295	中复神鹰	17,026	1,030,754.04	0.10
336	600820	隧道股份	197,600	1,029,496.00	0.10
337	000951	中国重汽	52,600	1,026,226.00	0.10
338	000997	新大陆	62,800	1,023,640.00	0.10
339	601106	中国一重	308,500	1,018,050.00	0.10
340	600483	福能股份	99,800	1,016,962.00	0.10
341	600282	南钢股份	221,354	1,016,014.86	0.10
342	000009	中国宝安	162,783	1,014,138.09	0.10
343	600583	海油工程	198,500	998,455.00	0.09
344	002500	山西证券	193,097	996,380.52	0.09
345	603885	吉祥航空	96,575	993,756.75	0.09
346	600161	天坛生物	85,500	990,090.00	0.09
347	603816	顾家家居	44,000	983,840.00	0.09

348	603939	益丰药房	54,612	981,923.76	0.09
349	600546	山煤国际	88,200	964,026.00	0.09
350	000582	北部湾港	89,800	963,554.00	0.09
351	603338	浙江鼎力	22,600	960,500.00	0.09
352	600763	通策医疗	28,252	957,177.76	0.09
353	600685	中船防务	37,500	954,000.00	0.09
354	601666	平煤股份	133,411	953,888.65	0.09
355	600329	达仁堂	25,535	950,412.70	0.09
356	600038	中直股份	37,400	945,846.00	0.09
357	003022	联泓新科	36,500	945,350.00	0.09
358	601567	三星电气	63,200	944,208.00	0.09
359	600562	国睿科技	44,376	941,658.72	0.09
360	600602	云赛智联	58,300	937,464.00	0.09
361	688318	财富趋势	13,108	934,731.48	0.09
362	002312	川发龙蟒	101,700	932,589.00	0.09
363	688778	厦钨新能	17,128	931,763.20	0.09
364	000513	丽珠集团	32,206	930,431.34	0.09
365	000723	美锦能源	277,100	928,285.00	0.09
366	600380	健康元	98,452	927,417.84	0.09
367	601156	东航物流	57,400	925,288.00	0.09
368	300676	华大基因	26,300	922,078.00	0.09
369	600390	五矿资本	202,100	921,576.00	0.09
370	688166	博瑞医药	26,247	918,907.47	0.09
371	601880	辽港股份	662,400	914,112.00	0.09
372	603565	中谷物流	92,900	911,349.00	0.09
373	601399	国机重装	259,700	908,950.00	0.09
374	688336	三生国健	16,930	898,983.00	0.08
375	601865	福莱特	84,900	892,299.00	0.08
376	600132	重庆啤酒	21,500	887,950.00	0.08
377	600511	国药股份	34,095	887,833.80	0.08
378	600535	天士力	66,700	882,441.00	0.08
379	000739	普洛药业	52,100	867,986.00	0.08
380	300100	双林股份	31,100	863,958.00	0.08
381	600816	建元信托	354,000	863,760.00	0.08
382	000598	兴蓉环境	134,372	862,668.24	0.08
383	600977	中国电影	66,700	861,764.00	0.08
384	002244	滨江集团	112,292	853,419.20	0.08
385	002299	圣农发展	56,142	851,112.72	0.08
386	300735	光弘科技	37,200	845,928.00	0.08
387	600906	财达证券	113,100	843,726.00	0.08
388	601236	红塔证券	123,500	842,270.00	0.08
389	688278	特宝生物	15,455	840,752.00	0.08
390	601155	新城控股	81,500	836,190.00	0.08

391	600970	中材国际	117,260	836,063.80	0.08
392	600967	内蒙一机	76,500	830,025.00	0.08
393	002120	韵达股份	130,400	829,344.00	0.08
394	000883	湖北能源	189,900	820,368.00	0.08
395	300144	宋城演艺	141,000	819,210.00	0.08
396	300146	汤臣倍健	90,600	819,024.00	0.08
397	688281	华秦科技	16,122	809,808.06	0.08
398	003021	兆威机电	9,200	803,620.00	0.08
399	000027	深圳能源	128,276	795,311.20	0.07
400	002568	百润股份	46,600	788,472.00	0.07
401	600131	国网信通	54,000	788,400.00	0.07
402	300718	长盛轴承	12,900	786,513.00	0.07
403	601608	中信重工	164,800	786,096.00	0.07
404	601866	中远海发	350,551	774,717.71	0.07
405	600095	湘财股份	102,800	774,084.00	0.07
406	603737	三棵树	32,078	773,079.80	0.07
407	000088	盐田港	187,300	766,057.00	0.07
408	600801	华新建材	48,925	763,230.00	0.07
409	000800	一汽解放	128,000	761,600.00	0.07
410	601118	海南橡胶	153,903	757,202.76	0.07
411	002583	海能达	97,800	752,082.00	0.07
412	600871	石化油服	365,800	742,574.00	0.07
413	600126	杭钢股份	121,038	741,962.94	0.07
414	688363	华熙生物	20,674	739,508.98	0.07
415	600566	济川药业	33,300	738,927.00	0.07
416	002984	森麒麟	56,100	733,227.00	0.07
417	603000	人民网	49,570	733,140.30	0.07
418	600754	锦江酒店	40,400	726,796.00	0.07
419	600517	国网英大	154,200	721,656.00	0.07
420	000709	河钢股份	371,300	720,322.00	0.07
421	600655	豫园股份	174,700	718,017.00	0.07
422	000825	太钢不锈	204,900	698,709.00	0.07
423	603589	口子窖	37,300	696,764.00	0.07
424	301606	绿联科技	11,400	695,628.00	0.07
425	688192	迪哲医药	17,286	690,229.98	0.06
426	603858	步长制药	47,198	689,090.80	0.06
427	688709	成都华微	18,059	687,867.31	0.06
428	603899	晨光股份	33,300	686,979.00	0.06
429	601598	中国外运	138,500	686,960.00	0.06
430	002423	中粮资本	83,200	684,736.00	0.06
431	600598	北大荒	62,910	681,944.40	0.06
432	001286	陕西能源	67,000	679,380.00	0.06
433	002773	康弘药业	33,200	678,940.00	0.06

434	600004	白云机场	93,100	675,906.00	0.06
435	600663	陆家嘴	106,211	667,005.08	0.06
436	601966	玲珑轮胎	65,300	665,407.00	0.06
437	600582	天地科技	148,500	660,825.00	0.06
438	600350	山东高速	59,100	657,783.00	0.06
439	688563	航材股份	12,778	654,616.94	0.06
440	600848	上海临港	86,600	648,634.00	0.06
441	000429	粤高速 A	46,800	638,820.00	0.06
442	688349	三一重能	41,757	633,871.26	0.06
443	601098	中南传媒	64,013	629,887.92	0.06
444	002508	老板电器	42,000	614,040.00	0.06
445	600968	海油发展	182,900	609,057.00	0.06
446	600062	华润双鹤	37,957	608,830.28	0.06
447	603233	大参林	40,408	607,332.24	0.06
448	601928	凤凰传媒	68,100	598,599.00	0.06
449	003035	南网能源	102,100	594,222.00	0.06
450	300957	贝泰妮	18,700	589,237.00	0.06
451	300888	稳健医疗	20,720	579,952.80	0.05
452	600688	上海石化	197,300	578,089.00	0.05
453	688425	铁建重工	143,489	576,825.78	0.05
454	002670	国盛证券	52,176	573,936.00	0.05
455	600295	鄂尔多斯	53,400	572,448.00	0.05
456	601808	中海油服	51,900	561,039.00	0.05
457	688561	奇安信	23,256	557,678.88	0.05
458	600098	广州发展	94,100	556,131.00	0.05
459	688708	佳驰科技	10,816	549,452.80	0.05
460	002032	苏泊尔	13,800	546,480.00	0.05
461	000539	粤电力 A	80,200	546,162.00	0.05
462	000537	绿发电力	73,800	539,478.00	0.05
463	600808	马钢股份	214,735	536,837.50	0.05
464	002153	石基信息	73,332	530,190.36	0.05
465	600377	宁沪高速	42,500	491,725.00	0.05
466	000959	首钢股份	139,600	489,996.00	0.05
467	601298	青岛港	60,600	487,830.00	0.05
468	002265	建设工业	27,900	485,460.00	0.05
469	600292	电投水电	40,300	485,212.00	0.05
470	603833	欧派家居	15,900	478,749.00	0.04
471	301301	川宁生物	59,700	474,018.00	0.04
472	603786	科博达	11,500	470,465.00	0.04
473	002608	江苏国信	67,500	465,750.00	0.04
474	301498	乖宝宠物	11,400	462,726.00	0.04
475	600339	中油工程	150,300	461,421.00	0.04
476	600606	绿地控股	378,800	458,348.00	0.04

477	688520	神州细胞	13,330	456,019.30	0.04
478	603529	爱玛科技	23,300	454,583.00	0.04
479	600032	浙江新能	64,300	453,315.00	0.04
480	000785	居然智家	223,500	447,000.00	0.04
481	600764	中国海防	25,500	444,465.00	0.04
482	601139	深圳燃气	77,500	438,650.00	0.04
483	603658	安图生物	14,900	432,398.00	0.04
484	000937	冀中能源	107,353	427,264.94	0.04
485	300140	节能环保	82,100	408,037.00	0.04
486	688475	萤石网络	14,909	407,761.15	0.04
487	603049	中策橡胶	9,000	403,290.00	0.04
488	000898	鞍钢股份	214,500	401,115.00	0.04
489	601228	广州港	136,000	383,520.00	0.04
490	603175	超颖电子	4,300	383,087.00	0.04
491	601019	山东出版	55,400	354,560.00	0.03
492	002945	华林证券	24,200	325,006.00	0.03
493	600927	永安期货	25,500	317,475.00	0.03
494	002461	珠江啤酒	39,200	296,744.00	0.03
495	601112	振石股份	15,975	290,728.25	0.03
496	600299	安迪苏	36,600	287,310.00	0.03
497	688819	天能股份	12,881	285,958.20	0.03
498	603092	德力佳	3,200	172,704.00	0.02
499	001221	悍高集团	3,660	147,205.20	0.01
500	001386	马可波罗	9,800	138,768.00	0.01

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	3,347	2,265,718.18	0.21
2	688802	沐曦股份	2,430	1,868,402.70	0.18
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
4	001248	华润新能源	46,313	468,224.43	0.04
5	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.03
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
7	688820	盛合晶微	1,513	214,074.37	0.02
8	001399	惠科股份	5,067	140,507.91	0.01
9	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
10	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
11	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
12	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
13	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
14	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00

15	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
16	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
17	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
18	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
19	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
20	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
21	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
22	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
23	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
24	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
25	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
26	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
27	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
28	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
29	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
30	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
31	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
32	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
33	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
34	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
35	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
36	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	688498	源杰科技	12,804,576.61	1.38
2	001309	德明利	10,240,185.00	1.10
3	300475	香农芯创	5,899,838.00	0.64
4	600105	永鼎股份	5,795,845.00	0.62
5	300666	江丰电子	5,589,963.00	0.60
6	300548	长芯博创	5,057,042.00	0.55
7	601869	长飞光纤	4,930,529.00	0.53
8	688313	仕佳光子	4,652,949.57	0.50
9	002407	多氟多	4,332,789.00	0.47
10	300620	光库科技	4,279,400.90	0.46
11	688200	华峰测控	3,858,512.58	0.42
12	600711	盛屯矿业	3,740,759.00	0.40
13	603256	宏和科技	3,676,584.00	0.40
14	002812	恩捷股份	3,536,366.00	0.38
15	301377	鼎泰高科	3,488,971.00	0.38

16	688037	芯源微	3,124,424.88	0.34
17	301526	国际复材	3,060,661.00	0.33
18	600256	广汇能源	2,743,865.00	0.30
19	603308	应流股份	2,728,028.00	0.29
20	688411	海博思创	2,571,957.45	0.28

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	600487	亨通光电	18,153,198.00	1.96
2	301308	江波龙	10,906,170.00	1.18
3	688525	佰维存储	10,173,983.09	1.10
4	002353	杰瑞股份	10,032,886.90	1.08
5	000657	中钨高新	7,981,355.00	0.86
6	002156	通富微电	7,836,248.00	0.84
7	600549	厦门钨业	6,825,040.91	0.74
8	000426	兴业银锡	6,438,538.00	0.69
9	002202	金风科技	6,284,383.10	0.68
10	002837	英维克	6,041,999.20	0.65
11	300450	先导智能	5,641,621.00	0.61
12	000933	神火股份	5,183,696.00	0.56
13	601168	西部矿业	4,902,142.96	0.53
14	002080	中材科技	4,665,182.00	0.50
15	002532	天山铝业	4,646,346.00	0.50
16	600673	东阳光	4,534,637.70	0.49
17	600118	中国卫星	4,386,810.00	0.47
18	002558	巨人网络	4,079,927.00	0.44
19	002128	电投能源	3,814,621.00	0.41
20	600096	云天化	3,610,933.00	0.39

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	295,855,093.04
卖出股票收入（成交）总额	316,685,136.17

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	48,000.84	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,000.84	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118071	华峰转债	480	48,000.84	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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	4,811,669.95
2	应收清算款	161,544.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,973,214.03

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	2,265,718.18	0.21	新股锁定期内
2	688802	沐曦股份	1,868,402.70	0.18	新股锁定期内
3	301666	大普微	565,262.60	0.05	新股锁定期内
4	001248	华润新能源	327,766.20	0.03	新股锁定期内
4	001248	华润新能源	140,458.23	0.01	新股未上市
5	688781	视涯科技	267,083.60	0.03	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有	户均持有	持有人结构
----	------	-------

人户 数 (户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者		华泰柏瑞中证 500 交易 型开放式指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
6,855	57,976.63	18,006,323.00	4.53	138,050,371.00	34.74	241,373,107.00	60.73

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

8.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日） 基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	425,929,801.00
本报告期基金总申购份额	87,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	115,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	397,429,801.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动： 经公司股东书面决定，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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

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

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 (%)	
华鑫证券	1	194,277,795.26	31.88	38,856.18	31.88	—
东方财富证券	2	167,839,127.99	27.54	33,567.70	27.54	—
中金公司	2	90,937,400.54	14.92	18,189.45	14.92	—
中信建投	2	85,984,709.12	14.11	17,198.29	14.11	—
长江证券	4	39,599,159.16	6.50	7,920.78	6.50	—
中信证券	3	15,320,708.98	2.51	3,064.15	2.51	—
国泰海通证券	3	13,328,809.98	2.19	2,665.74	2.19	—
银河证券	5	1,918,128.17	0.31	383.63	0.31	—
广发证券	5	191,012.00	0.03	38.21	0.03	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	3	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—
国都证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
国联民生	2	—	—	—	—	—

证券						
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	-	-	-	-	-
金融街证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

(1) 具有相应的业务经营资格；

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

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

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

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

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

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

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

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

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 (%)
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	152,581.00	100.00	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下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华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 17 日
4	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	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 12 日

	相关业务公告		
5	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
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 10 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 27 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 05 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 02 月 27 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 01 月 26 日
11	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
12	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
联接基金	1	20260101-20260630;	251,720,861.00	42,093,746.00	52,441,500.00	241,373,107.00	60.73
产品特有风险							
本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同							

提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日