

华泰柏瑞中证 1000 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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	6
§ 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	9
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	10
§ 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	12
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64

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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
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	68
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 1000ETF
场内简称	中证 1000（扩位证券简称：中证 1000ETF 华泰柏瑞）
基金主代码	516300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,012,592.00 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	2021 年 3 月 24 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	1、股票的投资策略；2、存托凭证的投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货的投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证 1000 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，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂	韩鑫普
	联系电话	021-38601777	0755-82943666
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95565
传真		021-38601799	0755-82960794
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

邮政编码	200135	518000
法定代表人	贾波	朱江涛

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	13,468,842.43
本期利润	13,932,316.29
加权平均基金份额本期利润	0.6359
本期加权平均净值利润率	18.55%
本期基金份额净值增长率	16.36%
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	29,585,809.31
期末可供分配基金份额利润	1.2856
期末基金资产净值	84,159,268.48
期末基金份额净值	3.6571
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	54.21%

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

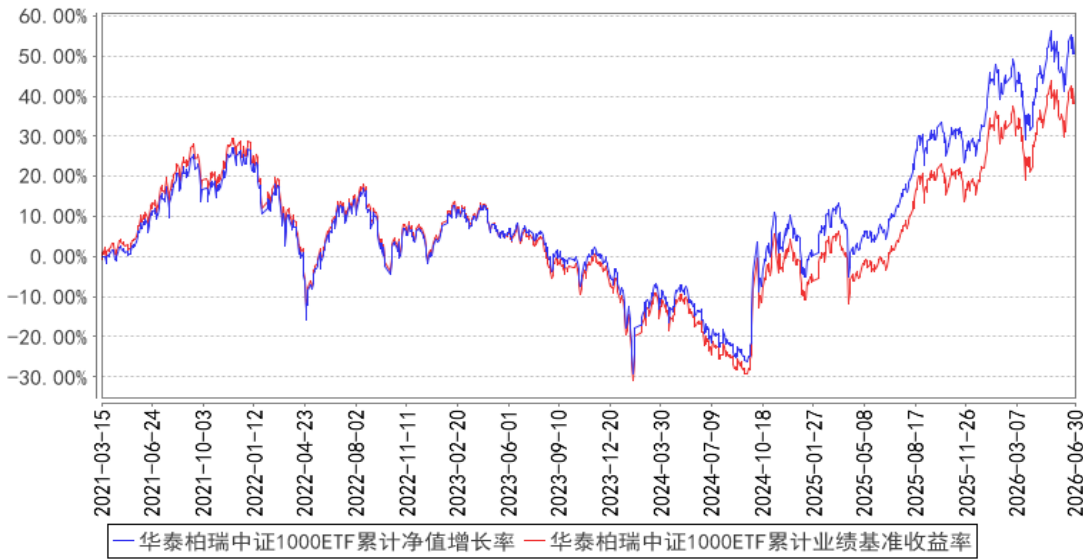
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 值增长	份额净值 增长率标	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差	①—③	②—④
----	-------------	--------------	----------------	------------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去三个月	16.13%	1.58%	15.62%	1.61%	0.51%	-0.03%
过去六个月	16.36%	1.60%	15.99%	1.62%	0.37%	-0.02%
过去一年	39.45%	1.36%	38.60%	1.38%	0.85%	-0.02%
过去三年	44.18%	1.63%	33.44%	1.65%	10.74%	-0.02%
过去五年	37.68%	1.52%	24.37%	1.54%	13.31%	-0.02%
自基金合同生效起至今	54.21%	1.49%	41.63%	1.51%	12.58%	-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1000ETF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 2021 年 3 月 15 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
第 8 页 共 71 页

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遵规守信情况的说明

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 1000 指数走势大致分为两个阶段，累计上涨 15.99%。年初小盘成长和主题投资较为活跃，商业航天、AI 应用、存储及有色资源等方向带动指数走强；3 月在外部扰动和风险偏好下降影响下，前期高弹性板块出现调整。随后市场交投逐渐恢复，科技成长、先

进制造、材料及消费服务等领域轮番表现，前期调整较多的中小市值公司出现反弹，指数重回修复。由于中证 1000 覆盖众多细分行业和新兴产业，不同公司的景气程度、盈利基础和估值水平差异较大，上半年内部强弱分化始终较为突出，指数也表现出较高的风险偏好敏感性。

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 3.6571 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.36%，业绩比较基准收益率为 15.99%。

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，中证 1000 指数能否延续修复，关键在于上半年活跃的产业线索能否转化为上市公司利润。中报和三季报将进一步检验相关公司的收入增长、订单质量、现金流及盈利改善情况，具备真实产业需求和细分竞争优势的公司更有可能获得持续关注。政策对科技创新、民营经济和中小企业发展的支持仍将发挥积极作用，为优质中小公司提供较好的发展环境。但近期部分小盘成长方向交易热度升高，中小市值公司对流动性和风险偏好变化也较为敏感，指数运行或仍伴随较大波动，需关注高估值方向的业绩预期差。

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，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。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基金份额净值低于面值。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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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 1000 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	2,743,489.62	1,642,518.61
结算备付金		4,033,955.85	4,631,935.04
存出保证金		720,227.38	788,370.26
交易性金融资产	6.4.7.2	77,036,522.86	59,543,059.13
其中：股票投资		76,980,421.40	59,543,059.13
基金投资		-	-
债券投资		56,101.46	-
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		-	9,855.16
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		84,594,688.34	66,615,738.20
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		-	4,300.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,810.46	28,543.48
应付托管费		3,603.48	5,708.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,581.55	21,796.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	411,424.37	512,978.26
负债合计		435,419.86	573,326.76
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	54,573,459.17	49,830,537.62
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	29,585,809.31	16,211,873.82
净资产合计		84,159,268.48	66,042,411.44
负债和净资产总计		84,594,688.34	66,615,738.20

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.6571 元，基金份额总额 23,012,592.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 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		14,250,543.65	11,006,010.85

1. 利息收入		35,145.63	61,049.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	35,145.63	61,049.88
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）		13,626,550.68	9,711,269.31
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,103,033.44	8,773,407.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,986.01	13,029.69
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	1,113,208.15	293,692.16
股利收益	6.4.7.19	405,323.08	631,139.95
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	463,473.86	1,320,028.62
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	125,373.48	-86,336.96
减：二、营业总支出		318,227.36	545,613.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	157,201.78	317,230.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,043.75	63,446.03
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		4,009.50	1,293.49
8. 其他费用	6.4.7.23	123,972.33	163,643.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,932,316.29	10,460,397.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		13,932,316.29	10,460,397.33

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,932,316.29	10,460,397.33

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 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	49,830,537.62	-	16,211,873.82	66,042,411.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	49,830,537.62	-	16,211,873.82	66,042,411.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,742,921.55	-	13,373,935.49	18,116,857.04
(一)、综合收益总额	-	-	13,932,316.29	13,932,316.29
(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)	4,742,921.55	-	-558,380.80	4,184,540.75
其中：1. 基金申购款	61,657,980.03	-	27,677,609.30	89,335,589.33
2. 基金赎回款	-56,915,058.48	-	-28,235,990.10	-85,151,048.58
(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	54,573,459.17	-	29,585,809.31	84,159,268.48
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	173,146,497.75	-	2,815,138.00	175,961,635.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	173,146,497.75	-	2,815,138.00	175,961,635.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-99,601,352.42	-	4,969,420.29	-94,631,932.13
（一）、综合收益总额	-	-	10,460,397.33	10,460,397.33
（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）	-99,601,352.42	-	-5,490,977.04	-105,092,329.46
其中：1. 基金申购款	113,830,116.98	-	5,656,862.11	119,486,979.09
2. 基金赎回款	-213,431,469.40	-	-11,147,839.15	-224,579,308.55
（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	73,545,145.33	-	7,784,558.29	81,329,703.62

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 1000 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[2021]第 235 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数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《华泰柏瑞中证 1000 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 222,600,550.00 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(2021)第 0294 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,602,182.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,632.00 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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]118 号核准,本基金 222,602,182.00 份基金份额于 2021 年 3 月 24 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 1000 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或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;本基金参与融资业务时,在任何交易日日终,持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争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。本基金的业绩比较基准为中

证 1000 指数收益率。

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	2,743,489.62
等于：本金	2,742,505.96
加：应计利息	983.66
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	2,743,489.62

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		70,124,200.75	-	76,980,421.40	6,856,220.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	56,100.00	1.46	56,101.46	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	56,100.00	1.46	56,101.46	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		70,180,300.75	1.46	77,036,522.86	6,856,220.65

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	4,918,680.00	—	—	
其中： 股指期货投资	4,918,680.00	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	4,918,680.00	—	—	

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
IM2609	中证 1000 股指期货 2609	3.00	5,091,000.00	172,320.00
合计				172,320.00
减：可抵销期货暂收款				172,320.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	18,129.16
其中：交易所市场	18,129.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,464.96
应退退补款	328,830.25

合计	411,424.37
----	------------

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	21,012,592.00	49,830,537.62
本期申购	26,000,000.00	61,657,980.03
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-56,915,058.48
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	23,012,592.00	54,573,459.17

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	17,770,692.69	-1,558,818.87	16,211,873.82
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	17,770,692.69	-1,558,818.87	16,211,873.82
本期利润	13,468,842.43	463,473.86	13,932,316.29
本期基金份额交易产生的变动数	1,464,793.51	-2,023,174.31	-558,380.80
其中：基金申购款	28,869,629.95	-1,192,020.65	27,677,609.30
基金赎回款	-27,404,836.44	-831,153.66	-28,235,990.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,704,328.63	-3,118,519.32	29,585,809.31

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	13,666.66
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	21,350.91
其他	128.06
合计	35,145.63

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	7,116,325.99
股票投资收益——赎回差价收入	4,986,707.45
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	12,103,033.44

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	57,130,114.23
减：卖出股票成本总额	49,952,448.68
减：交易费用	61,339.56
买卖股票差价收入	7,116,325.99

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	85,151,048.58
减：现金支付赎回款总额	45,157,332.58
减：赎回股票成本总额	35,007,008.55
减：交易费用	—
赎回差价收入	4,986,707.45

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	2.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,983.84
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	4,986.01

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）成交总额	13,685.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,700.00
减：应计利息总额	0.71
减：交易费用	0.55
买卖债券差价收入	4,983.84

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	1,113,208.15

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	405,323.08
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	405,323.08

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	535,553.86
股票投资	535,553.86
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	-72,080.00
权证投资	-
期货投资	-72,080.00
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	463,473.86

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	125,373.48
合计	125,373.48

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	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
注册登记费	59,507.37
IOPV 计算发布费	9,916.99
合计	123,972.33

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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商、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、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

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（%）
招商证券	124,069,789.80	100.00	229,903,392.00	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
招商证券	13,685.10	100.00	65,031.90	100.00

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（%）

招商证券	24,816.19	100.00	18,129.16	100.00
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（%）
招商证券	45,984.77	100.00	22,629.75	100.00

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 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管理费	157,201.78	317,230.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,917.16	6,436.65
应支付基金管理人的净管理费	144,284.62	310,793.44

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 0.50%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×0.50%/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	33,043.75	63,446.03

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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（%）
华泰证券股份 有限公司	1,143,699.00	4.9699	944,541.00	4.4951

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

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
—	—	—	—	—	—

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	钧威电子	网下申购	4,833	50,263.20
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,274	47,887.92

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：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
110101	宝钛转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	190	19,000.00	19,000.29	-
118070	南芯转债	2026 年 6 月 18 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	90	9,000.00	9,000.51	-
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.15	-
127114	宣化转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	231	23,100.00	23,100.51	-

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
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	5,600	52,753.25	50,680.00	-

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 0.07% (2025 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 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	2,743,489.62	-	-	-	-	-	-2,743,489.62
结算备付金	4,033,955.85	-	-	-	-	-	-4,033,955.85
存出保证金	109,307.38	-	-	-	-	-610,920.00	720,227.38
交易性金融资产	-	-	-	-	56,101.46	76,980,421.40	77,036,522.86
其他资产	-	-	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	6,886,752.85	-	-	-	56,101.46	77,651,834.03	84,594,688.34
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,810.46	10,810.46
应付托管费	-	-	-	-	-	3,603.48	3,603.48
应交税费	-	-	-	-	-	9,581.55	9,581.55
其他负债	-	-	-	-	-	-411,424.37	411,424.37
负债总计	-	-	-	-	-	-435,419.86	435,419.86
利率敏感度缺口	6,886,752.85	-	-	-	56,101.46	77,216,414.17	84,159,268.48
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	1,642,518.61	-	-	-	-	-	-1,642,518.61
结算备付金	4,631,935.04	-	-	-	-	-	-4,631,935.04
存出保证金	74,226.26	-	-	-	-	-714,144.00	788,370.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	59,543,059.13	59,543,059.13
应收清算款	-	-	-	-	-	9,855.16	9,855.16
资产总计	6,348,679.91	-	-	-	-	60,267,058.29	66,615,738.20
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,543.48	28,543.48
应付托管费	-	-	-	-	-	5,708.71	5,708.71
应付清算款	-	-	-	-	-	4,300.02	4,300.02
应交税费	-	-	-	-	-	21,796.29	21,796.29
其他负债	-	-	-	-	-	-512,978.26	512,978.26
负债总计	-	-	-	-	-	-573,326.76	573,326.76
利率敏感度缺口	6,348,679.91	-	-	-	-	-59,693,731.17	66,042,411.44

□						. 53	4
---	--	--	--	--	--	------	---

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 0.07%(2025 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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	76,980,421.40	91.47	59,543,059.13	90.16
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	76,980,421.40	91.47	59,543,059.13	90.16

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 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,049,597.07	3,231,478.19
	业绩比较基准下降 5%	-4,049,597.07	-3,231,478.19

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	76,929,741.40	59,468,399.13
第二层次	106,781.46	74,660.00
第三层次	-	-
合计	77,036,522.86	59,543,059.13

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 89,335,589.33 元(2025 年度:178,851,670.69 元),其中包括以股票支付的申购款 34,921,590.07 元和以现金支付的申购款 54,413,999.26 元(2025 年度:其中包括以股票支付的申购款 64,107,409.42 元和以现金支付的申购款 114,744,261.27 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	76,980,421.40	91.00
	其中：股票	76,980,421.40	91.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,101.46	0.07
	其中：债券	56,101.46	0.07
	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	6,777,445.47	8.01
8	其他各项资产	780,720.01	0.92
9	合计	84,594,688.34	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	294,545.30	0.35
B	采矿业	1,813,578.10	2.15
C	制造业	55,597,907.07	66.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,988,261.38	2.36
E	建筑业	1,022,274.00	1.21
F	批发和零售业	1,660,483.14	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	1,192,395.74	1.42
H	住宿和餐饮业	58,968.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,491,963.76	8.90
J	金融业	1,666,150.11	1.98
K	房地产业	984,861.00	1.17
L	租赁和商务服务业	805,617.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	867,731.00	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	809,625.80	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,671.00	0.03
Q	卫生和社会工作	161,956.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	466,489.00	0.55
S	综合	74,944.00	0.09
	合计	76,980,421.40	91.47

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	688766	普冉股份	952	729,803.20	0.87
2	603083	剑桥科技	2,200	560,714.00	0.67
3	688110	东芯股份	2,615	532,675.50	0.63
4	000636	风华高科	7,300	527,352.00	0.63
5	688146	中船特气	1,458	510,285.42	0.61
6	002428	云南锗业	4,200	504,756.00	0.60
7	002484	江海股份	4,800	504,000.00	0.60
8	688048	长光华芯	925	464,350.00	0.55
9	688627	精智达	644	460,460.00	0.55
10	601208	东材科技	6,500	460,135.00	0.55
11	688409	富创精密	1,425	436,406.25	0.52
12	605376	博迁新材	1,500	406,950.00	0.48
13	688630	芯碁微装	716	393,363.24	0.47
14	301511	德福科技	2,600	374,010.00	0.44
15	300672	国科微	1,200	354,000.00	0.42
16	600869	远东股份	10,500	351,435.00	0.42
17	600667	太极实业	11,800	344,324.00	0.41
18	688548	广钢气体	6,356	331,147.60	0.39
19	301217	铜冠铜箔	2,000	330,140.00	0.39
20	002222	福晶科技	3,510	323,902.80	0.38
21	600206	有研新材	4,800	319,680.00	0.38
22	000811	冰轮环境	5,580	313,707.60	0.37
23	688141	杰华特	2,017	309,609.50	0.37
24	600330	天通股份	9,948	306,796.32	0.36
25	603005	晶方科技	5,256	283,140.72	0.34
26	605111	新洁能	2,746	272,238.44	0.32
27	603306	华懋科技	2,600	269,594.00	0.32
28	300806	斯迪克	2,400	268,800.00	0.32
29	688668	鼎通科技	720	268,776.00	0.32
30	688536	思瑞浦	729	265,421.61	0.32
31	688167	炬光科技	749	265,303.29	0.32
32	002636	金安国纪	2,200	263,934.00	0.31
33	688025	杰普特	556	261,320.00	0.31
34	002245	蔚蓝锂芯	13,732	256,925.72	0.31
35	002456	欧菲光	27,100	256,366.00	0.30
36	601126	四方股份	4,000	252,800.00	0.30
37	688519	南亚新材	662	251,586.48	0.30
38	688403	汇成股份	6,239	247,688.30	0.29
39	688205	德科立	1,179	245,456.01	0.29

40	300236	上海新阳	1,800	236,700.00	0.28
41	300776	帝尔激光	1,100	236,456.00	0.28
42	300088	长信科技	20,200	234,320.00	0.28
43	300762	上海瀚讯	5,120	233,728.00	0.28
44	301396	宏景科技	700	232,120.00	0.28
45	300438	鹏辉能源	2,800	231,980.00	0.28
46	600246	万通发展	12,200	231,800.00	0.28
47	603588	高能环境	12,040	231,168.00	0.27
48	300398	飞凯材料	3,700	228,475.00	0.27
49	000962	东方钨业	2,400	217,440.00	0.26
50	688147	微导纳米	1,330	215,300.40	0.26
51	688362	甬矽电子	2,221	214,104.40	0.25
52	600641	先导基电	5,300	211,258.00	0.25
53	300568	星源材质	10,900	204,048.00	0.24
54	301205	联特科技	600	200,460.00	0.24
55	300456	赛微电子	4,700	199,609.00	0.24
56	688502	茂莱光学	285	197,676.00	0.23
57	300655	晶瑞电材	9,191	196,871.22	0.23
58	688123	聚辰股份	925	196,655.00	0.23
59	603063	禾望电气	3,700	195,693.00	0.23
60	600552	凯盛科技	6,000	195,480.00	0.23
61	300870	欧陆通	560	193,586.40	0.23
62	301626	苏州天脉	500	191,980.00	0.23
63	603678	火炬电子	2,300	190,900.00	0.23
64	002497	雅化集团	9,300	189,441.00	0.23
65	002859	洁美科技	1,700	186,167.00	0.22
66	688596	正帆科技	2,354	186,107.24	0.22
67	688388	嘉元科技	4,208	185,152.00	0.22
68	688503	聚和材料	1,382	183,391.40	0.22
69	600259	中稀有色	1,800	182,898.00	0.22
70	600353	旭光电子	4,000	182,400.00	0.22
71	300083	创世纪	13,300	181,146.00	0.22
72	688549	中巨芯	4,847	178,418.07	0.21
73	688333	铂力特	1,738	177,971.20	0.21
74	300811	铂科新材	1,869	177,349.41	0.21
75	301018	申菱环境	1,520	175,727.20	0.21
76	688300	联瑞新材	719	175,723.60	0.21
77	300131	英唐智控	9,100	173,173.00	0.21
78	601636	旗滨集团	16,800	171,864.00	0.20
79	300319	麦捷科技	5,700	168,891.00	0.20
80	688652	京仪装备	840	168,142.80	0.20
81	600186	莲花控股	11,900	166,600.00	0.20
82	600577	精达股份	17,000	166,260.00	0.20

83	601677	明泰铝业	9,960	165,336.00	0.20
84	002378	章源钨业	4,910	164,386.80	0.20
85	603663	三祥新材	1,700	163,710.00	0.19
86	300184	力源信息	9,300	163,215.00	0.19
87	600226	亨通股份	17,000	163,030.00	0.19
88	688545	兴福电子	1,209	160,869.54	0.19
89	300260	新莱应材	1,600	160,736.00	0.19
90	002617	露笑科技	15,400	158,466.00	0.19
91	688392	骄成超声	696	158,117.28	0.19
92	688127	蓝特光学	1,611	157,233.60	0.19
93	300323	华灿光电	7,700	157,080.00	0.19
94	002747	埃斯顿	4,200	156,786.00	0.19
95	001267	汇绿生态	2,900	155,150.00	0.18
96	600114	东睦股份	4,100	154,816.00	0.18
97	002046	国机精工	2,100	154,665.00	0.18
98	688372	伟测科技	830	154,380.00	0.18
99	002192	融捷股份	1,700	151,980.00	0.18
100	000766	通化金马	7,800	151,320.00	0.18
101	002536	飞龙股份	3,200	150,976.00	0.18
101	688102	斯瑞新材	3,200	150,976.00	0.18
102	688390	固德威	1,389	150,720.39	0.18
103	603283	赛腾股份	1,834	148,517.32	0.18
104	603516	淳中科技	1,100	148,071.00	0.18
105	300077	国民技术	4,700	147,345.00	0.18
106	000969	安泰科技	6,000	147,240.00	0.17
107	601777	千里科技	17,900	146,064.00	0.17
108	300747	锐科激光	2,750	145,997.50	0.17
109	002149	西部材料	2,700	145,827.00	0.17
110	002364	中恒电气	2,700	145,260.00	0.17
111	002716	湖南白银	17,900	144,811.00	0.17
112	002171	楚江新材	10,500	142,485.00	0.17
113	688800	瑞可达	1,473	141,363.81	0.17
114	600331	宏达股份	12,700	139,573.00	0.17
115	688195	腾景科技	718	138,272.44	0.16
116	603127	昭衍新药	3,600	137,592.00	0.16
116	603667	五洲新春	2,100	137,592.00	0.16
117	002176	江特电机	13,700	137,137.00	0.16
118	300657	弘信电子	3,100	136,462.00	0.16
119	600961	株冶集团	4,200	136,038.00	0.16
120	603929	亚翔集成	500	136,010.00	0.16
121	002317	众生药业	5,500	135,135.00	0.16
122	688559	海目星	1,590	133,432.80	0.16
123	300602	飞荣达	2,600	133,120.00	0.16

124	300102	乾照光电	5,100	132,804.00	0.16
125	688484	南芯科技	2,326	131,395.74	0.16
126	300065	海兰信	5,800	129,398.00	0.15
127	688700	东威科技	1,447	129,361.80	0.15
128	300166	东方国信	7,300	129,283.00	0.15
129	300503	昊志机电	1,400	129,220.00	0.15
130	002015	协鑫能科	7,900	128,928.00	0.15
131	300738	奥飞数据	6,272	126,819.84	0.15
132	300170	汉得信息	8,300	126,492.00	0.15
133	300303	聚飞光电	11,400	126,084.00	0.15
134	300199	翰宇药业	5,700	125,856.00	0.15
135	300409	道氏技术	6,300	125,559.00	0.15
136	601020	华钰矿业	5,200	124,748.00	0.15
137	002354	天娱数科	13,400	124,620.00	0.15
138	301550	斯菱智驱	1,360	124,344.80	0.15
139	002405	四维图新	19,100	123,577.00	0.15
140	000688	国城矿业	3,600	123,228.00	0.15
141	002326	永太科技	5,200	122,980.00	0.15
142	605090	九丰能源	3,300	122,661.00	0.15
143	600301	华锡有色	2,000	122,640.00	0.15
144	600596	新安股份	7,657	122,205.72	0.15
145	300693	盛弘股份	2,500	121,875.00	0.14
146	688005	容百科技	3,949	120,839.40	0.14
147	688400	凌云光	1,823	120,682.60	0.14
148	002654	万润科技	5,400	120,204.00	0.14
149	002611	东方精工	6,800	120,088.00	0.14
150	000970	中科三环	7,900	120,001.00	0.14
151	002506	协鑫集成	37,700	119,886.00	0.14
152	300085	银之杰	3,400	118,898.00	0.14
153	688432	有研硅	2,956	118,151.32	0.14
154	600388	龙净环保	8,100	117,855.00	0.14
155	301171	易点天下	3,470	117,841.20	0.14
156	600888	新疆众和	7,400	117,586.00	0.14
157	603026	石大胜华	1,300	116,181.00	0.14
158	600459	贵研铂业	4,000	115,520.00	0.14
159	603876	鼎胜新材	4,440	115,484.40	0.14
160	301392	汇成真空	400	115,456.00	0.14
161	688515	裕太微	461	114,678.36	0.14
162	603236	移远通信	2,236	114,416.12	0.14
163	002947	恒铭达	1,500	114,075.00	0.14
164	301071	力量钻石	1,220	112,850.00	0.13
165	300342	天银机电	2,400	112,800.00	0.13
166	001301	尚太科技	1,200	112,212.00	0.13

167	300607	拓斯达	2,700	111,321.00	0.13
168	600338	西藏珠峰	7,300	111,252.00	0.13
169	002151	北斗星通	3,500	111,125.00	0.13
170	688368	晶丰明源	511	110,641.72	0.13
171	688106	金宏气体	2,657	110,212.36	0.13
172	300726	宏达电子	1,300	109,941.00	0.13
173	688531	日联科技	618	109,905.12	0.13
174	600323	瀚蓝环境	4,000	109,840.00	0.13
175	601678	滨化股份	16,600	109,394.00	0.13
176	688097	博众精工	1,709	107,752.45	0.13
177	688449	联芸科技	1,246	107,542.26	0.13
178	301095	广立微	900	106,245.00	0.13
179	688150	莱特光电	1,547	106,155.14	0.13
180	688433	华曙高科	1,240	106,144.00	0.13
181	688158	优刻得	2,881	105,905.56	0.13
182	000875	电投绿能	20,500	105,575.00	0.13
183	002745	木林森	8,400	105,420.00	0.13
184	688131	皓元医药	1,109	104,911.40	0.12
185	300593	新雷能	3,480	104,608.80	0.12
186	002249	大洋电机	13,900	104,250.00	0.12
187	603881	数据港	4,167	104,175.00	0.12
188	688327	云从科技	8,346	103,991.16	0.12
189	600201	生物股份	8,900	103,685.00	0.12
190	688717	艾罗能源	1,240	102,386.80	0.12
191	601778	晶科科技	23,800	102,340.00	0.12
192	600531	豫光金铅	6,900	101,844.00	0.12
193	002518	科士达	1,900	101,821.00	0.12
194	605020	永和股份	2,500	101,800.00	0.12
195	002237	恒邦股份	6,900	101,361.00	0.12
196	002290	禾盛新材	1,100	101,057.00	0.12
197	002145	钛能化学	21,390	100,746.90	0.12
198	603267	鸿远电子	1,300	100,724.00	0.12
199	601975	招商南油	27,000	100,710.00	0.12
200	688116	天奈科技	2,629	100,427.80	0.12
201	601918	新集能源	11,600	99,644.00	0.12
202	002174	游族网络	7,900	99,619.00	0.12
203	002389	航天彩虹	5,600	99,512.00	0.12
204	300576	容大感光	1,942	99,469.24	0.12
205	600877	电科芯片	5,800	99,354.00	0.12
206	600155	华创云信	17,900	98,808.00	0.12
207	300821	东岳硅材	4,800	98,688.00	0.12
208	601137	博威合金	4,400	98,252.00	0.12
209	000620	盈新发展	28,000	98,000.00	0.12

209	300296	利亚德	17,500	98,000.00	0.12
210	301297	富乐德	1,600	97,984.00	0.12
211	600529	山东药玻	5,300	97,785.00	0.12
212	688003	天准科技	768	97,766.40	0.12
213	000422	湖北宜化	6,900	96,945.00	0.12
214	001287	中电港	3,100	96,565.00	0.11
215	300459	汤姆猫	28,400	96,276.00	0.11
216	300253	卫宁健康	14,300	96,239.00	0.11
217	002815	崇达技术	5,800	96,222.00	0.11
218	002139	拓邦股份	10,100	96,152.00	0.11
219	000686	东北证券	11,300	94,920.00	0.11
220	002396	星网锐捷	4,920	94,316.40	0.11
221	688208	道通科技	3,734	94,059.46	0.11
222	300773	拉卡拉	6,120	93,636.00	0.11
223	300353	东土科技	4,500	93,510.00	0.11
224	603124	江南新材	500	93,490.00	0.11
225	688029	南微医学	1,300	93,340.00	0.11
226	001339	智微智能	910	93,074.80	0.11
227	688262	国芯科技	2,145	92,728.35	0.11
228	000672	上峰材料	3,900	92,352.00	0.11
229	002643	万润股份	4,400	92,180.00	0.11
230	002958	青衣商行	33,500	91,790.00	0.11
231	300257	开山股份	3,200	91,776.00	0.11
232	688605	先锋精科	882	91,745.64	0.11
233	688206	概伦电子	2,065	91,624.05	0.11
234	688352	硕中科技	3,782	91,448.76	0.11
235	600366	宁波韵升	6,200	91,016.00	0.11
236	600151	航天机电	8,100	90,882.00	0.11
237	600179	安通控股	20,500	90,200.00	0.11
238	002048	宁波华翔	3,900	89,700.00	0.11
239	688380	中微半导	1,360	89,637.60	0.11
240	002979	雷赛智能	1,600	89,248.00	0.11
240	301005	超捷股份	800	89,248.00	0.11
241	002254	泰和新材	4,900	89,131.00	0.11
242	002400	省广集团	14,100	88,971.00	0.11
243	601375	中原证券	22,100	88,179.00	0.10
244	600063	皖维高新	11,600	88,160.00	0.10
245	000762	西藏矿业	3,300	88,110.00	0.10
246	000681	视觉中国	4,400	87,736.00	0.10
247	002895	川恒股份	3,000	87,600.00	0.10
248	688332	中科蓝讯	556	87,570.00	0.10
249	002182	宝武镁业	5,600	87,192.00	0.10
250	002948	青岛银行	17,100	86,868.00	0.10

251	600550	保变电气	7,400	86,802.00	0.10
252	600872	中炬高新	5,000	86,800.00	0.10
253	603690	至纯科技	2,440	86,376.00	0.10
254	300468	四方精创	4,100	86,141.00	0.10
255	688516	奥特维	1,500	86,085.00	0.10
256	600428	中远海特	11,000	85,910.00	0.10
257	300613	富瀚微	1,070	85,685.60	0.10
258	300315	掌趣科技	21,900	85,410.00	0.10
259	300684	中石科技	1,400	85,400.00	0.10
260	301031	中熔电气	711	84,928.95	0.10
261	688031	星环科技	731	84,196.58	0.10
262	300182	捷成股份	17,700	84,075.00	0.10
263	301029	怡合达	3,100	83,731.00	0.10
264	600986	浙文互联	11,900	83,062.00	0.10
265	301219	腾远钴业	1,513	82,912.40	0.10
266	601519	大智慧	9,600	82,848.00	0.10
267	000690	宝新能源	17,600	82,720.00	0.10
268	603358	华达科技	1,900	82,650.00	0.10
269	300008	天海防务	13,600	82,416.00	0.10
270	000682	东方电子	6,500	82,095.00	0.10
271	000534	万泽股份	3,000	82,080.00	0.10
272	300814	中富电路	400	81,800.00	0.10
272	600761	安徽合力	5,000	81,800.00	0.10
273	300049	福瑞医科	2,100	81,648.00	0.10
274	603009	北特科技	1,700	81,549.00	0.10
275	688593	新相微	2,091	81,381.72	0.10
276	002545	东方铁塔	5,000	81,100.00	0.10
277	002270	华明装备	4,300	81,055.00	0.10
278	300687	赛意信息	2,600	80,600.00	0.10
279	000612	焦作万方	7,600	80,484.00	0.10
280	300181	佐力药业	5,700	80,370.00	0.10
281	688690	纳微科技	1,821	80,306.10	0.10
282	300007	汉威科技	2,100	80,220.00	0.10
283	000901	航天科技	4,500	80,055.00	0.10
284	601606	长城军工	2,900	79,721.00	0.09
285	002768	国恩股份	1,528	79,547.68	0.09
286	300827	上能电气	2,583	79,530.57	0.09
287	600416	湘电股份	8,100	79,380.00	0.09
288	600821	金开新能	12,700	79,375.00	0.09
289	300035	中科电气	5,500	79,310.00	0.09
290	002897	意华股份	900	79,182.00	0.09
291	300573	兴齐眼药	1,940	79,074.40	0.09
292	688279	峰岬科技	352	79,002.88	0.09

293	002993	奥海科技	1,100	78,771.00	0.09
294	600345	长江通信	1,200	78,612.00	0.09
295	002706	良信股份	7,200	78,552.00	0.09
296	603301	振德医疗	900	78,444.00	0.09
297	603662	柯力传感	1,100	78,287.00	0.09
298	002539	云图控股	6,900	78,108.00	0.09
299	002183	怡亚通	14,600	77,818.00	0.09
300	000973	佛塑科技	5,400	77,490.00	0.09
301	300229	拓尔思	5,600	77,392.00	0.09
302	000917	电广传媒	11,500	76,935.00	0.09
303	688486	龙迅股份	1,203	76,486.74	0.09
304	002965	祥鑫科技	1,500	76,425.00	0.09
305	300779	惠城环保	1,520	76,304.00	0.09
306	000603	盛达资源	3,300	76,230.00	0.09
307	603950	长源东谷	900	75,987.00	0.09
308	600867	通化东宝	9,400	75,576.00	0.09
309	603613	国联股份	4,100	75,522.00	0.09
310	688006	杭可科技	2,065	75,475.75	0.09
311	688726	拉普拉斯	1,425	75,311.25	0.09
312	688001	华兴源创	878	75,244.60	0.09
313	002250	联化科技	5,500	75,185.00	0.09
314	300133	华策影视	10,600	75,048.00	0.09
315	300244	迪安诊断	4,000	74,960.00	0.09
316	000833	粤桂股份	3,200	74,944.00	0.09
317	301316	慧博云通	1,900	74,822.00	0.09
318	688063	派能科技	1,399	74,524.73	0.09
319	688686	奥普特	442	74,428.38	0.09
320	688779	五矿新能	9,170	74,368.70	0.09
321	300031	宝通科技	2,600	74,282.00	0.09
322	300009	安科生物	9,400	73,790.00	0.09
323	300777	中简科技	2,800	73,584.00	0.09
324	002929	润建股份	1,100	73,568.00	0.09
325	601609	金田股份	6,800	73,440.00	0.09
326	603997	继峰股份	6,200	73,346.00	0.09
327	600728	佳都科技	17,200	73,272.00	0.09
328	688088	虹软科技	2,059	73,197.45	0.09
329	001896	豫能控股	4,400	73,084.00	0.09
330	000758	中色股份	11,100	72,927.00	0.09
331	600458	时代新材	4,400	72,820.00	0.09
332	300045	华力创通	4,200	72,408.00	0.09
333	000680	山推股份	7,200	72,360.00	0.09
334	002498	汉缆股份	10,600	72,292.00	0.09
335	600490	鹏欣资源	12,400	72,168.00	0.09

336	002922	伊戈尔	2,200	72,160.00	0.09
337	688353	华盛锂电	618	71,731.26	0.09
338	601187	厦门银行	10,500	71,715.00	0.09
339	600285	羚锐制药	3,700	71,706.00	0.09
340	002468	申通快递	4,900	71,344.00	0.08
341	688691	灿芯股份	613	71,065.09	0.08
342	600120	浙江东方	16,500	70,950.00	0.08
343	000778	新兴铸管	19,100	70,861.00	0.08
344	300327	中颖电子	2,200	70,510.00	0.08
345	300185	通裕重工	25,800	70,434.00	0.08
346	600184	光电股份	2,200	70,422.00	0.08
347	301510	固高科技	2,200	70,246.00	0.08
348	002507	涪陵榨菜	6,500	70,200.00	0.08
349	601333	广深铁路	25,500	70,125.00	0.08
350	600064	南京高科	9,800	69,874.00	0.08
351	600619	海立股份	4,400	69,740.00	0.08
352	601528	瑞丰银行	15,770	69,703.40	0.08
353	300638	广和通	3,760	69,597.60	0.08
354	300725	药石科技	1,900	69,540.00	0.08
355	603323	苏农银行	17,902	69,280.74	0.08
356	300674	宇信科技	4,600	69,230.00	0.08
357	603619	中曼石油	3,700	69,227.00	0.08
358	300113	顺网科技	3,800	69,198.00	0.08
359	600452	涪陵电力	7,386	68,911.38	0.08
360	688382	益方生物	3,822	68,796.00	0.08
361	600267	海正药业	6,800	68,748.00	0.08
361	600739	辽宁成大	6,800	68,748.00	0.08
362	002896	中大力德	900	68,742.00	0.08
363	300775	三角防务	3,100	68,324.00	0.08
364	603505	金石资源	3,390	68,308.50	0.08
365	000543	皖能电力	9,000	68,130.00	0.08
366	600133	东湖高新	8,600	67,940.00	0.08
367	603305	旭升集团	5,600	67,872.00	0.08
368	002170	芭田股份	6,200	67,332.00	0.08
369	300130	新国都	3,200	67,328.00	0.08
370	600635	大众公用	15,700	67,196.00	0.08
371	601963	重庆银行	6,600	66,528.00	0.08
372	002675	东诚药业	5,300	66,515.00	0.08
373	300034	钢研高纳	3,880	66,503.20	0.08
374	603319	美湖股份	2,000	66,420.00	0.08
375	000628	高新发展	1,400	66,360.00	0.08
376	000998	隆平高科	8,800	66,352.00	0.08
377	301127	武汉天源	3,200	66,304.00	0.08

378	600750	华润江中	3,000	66,210.00	0.08
379	600320	振华重工	16,000	66,080.00	0.08
379	600559	老白干酒	5,900	66,080.00	0.08
380	600509	天富能源	7,800	65,910.00	0.08
381	002936	郑州银行	39,900	65,835.00	0.08
382	002276	万马股份	6,500	65,715.00	0.08
383	000035	中国天楹	13,600	65,688.00	0.08
384	002544	普天科技	3,600	65,592.00	0.08
385	300322	硕贝德	2,600	65,520.00	0.08
386	000767	晋控电力	17,100	65,493.00	0.08
387	300457	赢合科技	3,100	65,348.00	0.08
388	002549	凯美特气	3,100	65,255.00	0.08
389	605196	华通线缆	2,500	65,250.00	0.08
390	000935	四川双马	2,500	65,225.00	0.08
391	301196	唯科科技	520	65,218.40	0.08
392	002324	普利特	5,400	65,178.00	0.08
393	002681	奋达科技	14,500	64,815.00	0.08
394	000685	中山公用	5,800	64,728.00	0.08
395	000581	威孚高科	3,800	64,676.00	0.08
396	002373	千方科技	9,000	64,620.00	0.08
397	002036	联创电子	8,500	64,345.00	0.08
398	002807	江阴银行	17,340	64,331.40	0.08
399	300098	高新兴	14,000	64,260.00	0.08
400	001227	兰州银行	32,100	64,200.00	0.08
401	300624	万兴科技	1,237	64,163.19	0.08
402	000420	吉林化纤	15,800	63,990.00	0.08
403	002913	奥士康	1,000	63,940.00	0.08
404	688567	孚能科技	6,085	63,892.50	0.08
405	000563	陕国投 A	23,100	63,756.00	0.08
406	000801	四川九洲	4,900	63,406.00	0.08
407	600726	华电能源	8,900	63,368.00	0.08
408	300820	英杰电气	700	63,161.00	0.08
409	002158	汉钟精机	1,700	63,036.00	0.07
410	002338	奥普光电	1,100	62,920.00	0.07
411	600456	宝钛股份	2,300	62,905.00	0.07
412	000099	中信海直	4,300	62,608.00	0.07
413	002639	雪人集团	4,500	62,595.00	0.07
414	300455	航天智装	2,900	62,466.00	0.07
415	000810	创维数字	4,700	62,275.00	0.07
416	002063	远光软件	12,200	62,220.00	0.07
417	002023	海特高新	4,800	62,208.00	0.07
418	688321	微芯生物	2,361	62,165.13	0.07
419	600633	浙数文化	6,100	62,098.00	0.07

420	600072	中船科技	7,300	61,977.00	0.07
421	002268	电科网安	4,800	61,920.00	0.07
422	002701	奥瑞金	14,500	61,770.00	0.07
423	601222	林洋能源	11,600	61,712.00	0.07
424	002925	盈趣科技	2,500	61,650.00	0.07
425	300850	新强联	2,300	61,640.00	0.07
426	688584	上海合晶	1,714	61,618.30	0.07
427	600216	浙江医药	5,400	61,560.00	0.07
427	688107	安路科技	1,350	61,560.00	0.07
428	600908	无锡银行	12,100	61,468.00	0.07
429	688083	中望软件	948	61,383.00	0.07
430	300378	鼎捷数智	1,700	61,370.00	0.07
431	600210	紫江企业	9,800	60,760.00	0.07
432	002531	天顺风能	7,200	60,696.00	0.07
433	300618	寒锐钴业	1,700	60,690.00	0.07
434	300855	图南股份	1,940	60,644.40	0.07
435	300357	我武生物	2,600	60,632.00	0.07
436	600933	爱柯迪	4,100	60,598.00	0.07
437	600409	三友化工	9,900	60,489.00	0.07
438	002698	博实股份	5,000	60,350.00	0.07
439	000791	甘肃能源	7,900	60,040.00	0.07
440	300224	正海磁材	4,500	59,985.00	0.07
441	300101	振芯科技	3,700	59,829.00	0.07
442	000029	深深房 A	2,700	59,535.00	0.07
443	000727	冠捷科技	21,800	59,514.00	0.07
444	600446	金证股份	5,900	59,354.00	0.07
445	600773	西藏城投	4,600	59,202.00	0.07
446	300416	苏试试验	2,900	59,102.00	0.07
447	600258	首旅酒店	5,400	58,968.00	0.07
448	603297	永新光学	400	58,780.00	0.07
449	002104	恒宝股份	5,700	58,767.00	0.07
450	603456	九洲药业	4,300	58,738.00	0.07
451	002020	京新药业	4,700	58,703.00	0.07
452	301571	国科天成	900	58,662.00	0.07
453	603638	艾迪精密	2,500	58,625.00	0.07
454	688612	威迈斯	1,977	58,499.43	0.07
455	300682	朗新科技	5,900	58,410.00	0.07
456	603300	海南华铁	12,820	58,331.00	0.07
457	300348	长亮科技	6,600	58,080.00	0.07
458	603337	杰克科技	1,600	57,968.00	0.07
459	688062	迈威生物	2,049	57,884.25	0.07
460	603698	航天工程	1,500	57,840.00	0.07
461	600859	王府井	6,300	57,834.00	0.07

462	301293	三博脑科	1,200	57,816.00	0.07
463	000902	新洋丰	5,000	57,800.00	0.07
464	002832	比音勒芬	2,800	57,792.00	0.07
465	600629	华建集团	4,760	57,643.60	0.07
466	301216	万凯新材	2,500	57,475.00	0.07
467	000012	南玻 A	11,100	57,276.00	0.07
468	603220	中贝通信	2,680	57,271.60	0.07
469	002541	鸿路钢构	3,300	57,156.00	0.07
470	002091	江苏国泰	7,900	57,117.00	0.07
471	002488	金固股份	6,400	57,024.00	0.07
472	603713	密尔克卫	800	56,936.00	0.07
473	601860	紫金银行	23,500	56,870.00	0.07
474	002212	天融信	9,500	56,810.00	0.07
475	300601	康泰生物	5,000	56,700.00	0.07
476	300276	三丰智能	7,900	56,643.00	0.07
477	600113	浙江东日	1,700	56,406.00	0.07
478	603612	索通发展	3,100	56,203.00	0.07
479	603871	嘉友国际	5,500	56,155.00	0.07
480	600572	康恩贝	14,300	56,056.00	0.07
481	603927	中科软	4,400	55,924.00	0.07
482	600718	东软集团	7,700	55,748.00	0.07
483	600850	电科数字	3,824	55,677.44	0.07
484	000555	神州信息	5,400	55,620.00	0.07
485	000837	秦川机床	5,000	55,550.00	0.07
486	002100	天康生物	8,800	55,528.00	0.07
487	002081	金螳螂	12,800	55,424.00	0.07
488	600528	中铁工业	8,400	55,356.00	0.07
489	002239	奥特佳	22,400	55,328.00	0.07
490	600461	洪城环境	6,100	55,266.00	0.07
491	002635	安洁科技	2,700	55,215.00	0.07
492	002011	盾安环境	5,200	55,172.00	0.07
493	300761	立华股份	3,360	55,137.60	0.07
494	002779	中坚科技	700	54,992.00	0.07
495	001337	四川黄金	1,500	54,990.00	0.07
496	301263	泰恩康	2,660	54,503.40	0.06
497	301291	明阳电气	1,511	54,380.89	0.06
498	600621	华鑫股份	4,200	54,264.00	0.06
499	688591	泰凌微	1,577	54,217.26	0.06
500	300723	一品红	1,450	54,056.00	0.06
501	002077	大港股份	2,800	54,012.00	0.06
502	600478	科力远	10,707	53,963.28	0.06
503	300861	美畅股份	2,140	53,906.60	0.06
504	300529	健帆生物	3,500	53,900.00	0.06

505	301275	汉朔科技	1,200	53,880.00	0.06
506	002416	爱施德	6,000	53,760.00	0.06
507	300415	伊之密	2,700	53,757.00	0.06
508	002458	益生股份	6,910	53,690.70	0.06
509	600389	江山股份	2,750	53,680.00	0.06
510	600022	山东钢铁	43,200	53,568.00	0.06
511	600835	上海机电	2,600	53,560.00	0.06
512	002408	齐翔腾达	11,400	53,466.00	0.06
513	002019	亿帆医药	5,700	53,295.00	0.06
514	002597	金禾实业	2,700	52,920.00	0.06
514	600361	创新新材	14,700	52,920.00	0.06
515	301035	润丰股份	1,140	52,896.00	0.06
516	600056	中国医药	6,000	52,500.00	0.06
517	600864	哈投股份	10,100	52,419.00	0.06
518	002906	华阳集团	2,100	52,416.00	0.06
519	002121	科陆电子	9,600	52,320.00	0.06
520	300070	碧水源	16,400	52,316.00	0.06
521	600744	华银电力	8,100	52,083.00	0.06
522	002838	道恩股份	1,700	52,054.00	0.06
523	600993	马应龙	2,400	51,888.00	0.06
524	600771	广誉远	4,000	51,800.00	0.06
525	000829	天音控股	6,600	51,480.00	0.06
526	601311	骆驼股份	6,600	51,414.00	0.06
527	600645	中源协和	3,000	51,330.00	0.06
528	600776	东方通信	3,900	51,246.00	0.06
529	002251	步步高	15,100	51,038.00	0.06
530	300660	江苏雷利	1,828	50,928.08	0.06
531	002332	仙琚制药	6,300	50,778.00	0.06
532	000600	建投能源	5,800	50,750.00	0.06
533	601369	陕鼓动力	5,600	50,680.00	0.06
534	688306	均普智能	5,006	50,560.60	0.06
535	300872	天阳科技	3,200	50,560.00	0.06
536	688016	心脉医疗	569	50,436.16	0.06
537	603328	依顿电子	4,000	50,120.00	0.06
538	002534	西子洁能	2,700	50,085.00	0.06
539	002010	传化智联	11,200	50,064.00	0.06
540	000089	深圳机场	8,300	50,049.00	0.06
541	002004	华邦健康	12,700	49,911.00	0.06
542	601619	嘉泽新能	11,600	49,880.00	0.06
543	600057	厦门象屿	9,200	49,864.00	0.06
544	601101	昊华能源	4,700	49,632.00	0.06
545	002258	利尔化学	3,900	49,569.00	0.06
546	600037	歌华有线	7,900	49,533.00	0.06

547	301489	思泉新材	300	49,374.00	0.06
548	600211	西藏药业	1,320	49,354.80	0.06
549	600623	华谊集团	6,100	49,227.00	0.06
550	300493	润欣科技	3,300	49,203.00	0.06
551	688798	艾为电子	671	49,197.72	0.06
552	300026	红日药业	16,900	49,010.00	0.06
553	002368	太极股份	3,500	48,965.00	0.06
554	001359	平安电工	390	48,847.50	0.06
555	002003	伟星股份	5,800	48,836.00	0.06
556	301078	孩子王	7,200	48,672.00	0.06
557	002006	精工科技	3,300	48,543.00	0.06
558	605123	派克新材	500	48,505.00	0.06
559	601069	西部黄金	2,200	48,400.00	0.06
560	002839	张家港行	12,400	48,360.00	0.06
561	002075	沙钢股份	14,200	48,280.00	0.06
562	301050	雷电微力	1,440	48,153.60	0.06
563	002099	海翔药业	9,100	48,048.00	0.06
564	002226	江南化工	10,700	48,043.00	0.06
565	600783	鲁信创投	2,400	47,808.00	0.06
566	688543	国科军工	1,211	47,773.95	0.06
567	002668	TCL 智家	4,300	47,644.00	0.06
568	000990	诚志股份	5,800	47,444.00	0.06
569	600827	百联股份	6,400	47,424.00	0.06
570	600475	华光环能	3,100	47,275.00	0.06
571	002292	奥飞娱乐	7,200	47,232.00	0.06
572	603360	百傲化学	2,900	47,212.00	0.06
573	600587	新华医疗	3,970	47,163.60	0.06
574	600480	凌云股份	5,670	47,117.70	0.06
575	002985	北摩高科	1,700	47,090.00	0.06
576	002246	北化股份	2,500	47,000.00	0.06
577	300969	恒帅股份	500	46,880.00	0.06
578	600391	航发科技	1,400	46,830.00	0.06
579	300772	运达股份	3,800	46,740.00	0.06
580	002123	梦网科技	6,500	46,735.00	0.06
581	000795	英洛华	5,400	46,710.00	0.06
582	000156	华数传媒	7,400	46,694.00	0.06
583	300337	银邦股份	4,000	46,640.00	0.06
584	000403	派林生物	5,300	46,587.00	0.06
585	600916	中国黄金	6,800	46,512.00	0.06
586	000048	京基智农	2,100	46,389.00	0.06
587	301345	涛涛车业	200	46,200.00	0.05
588	002215	诺 普 信	5,600	46,088.00	0.05
589	600399	抚顺特钢	11,200	46,032.00	0.05

590	603118	共进股份	3,800	46,018.00	0.05
591	002233	塔牌集团	6,600	46,002.00	0.05
592	000923	河钢资源	3,700	45,917.00	0.05
592	603733	仙鹤股份	1,700	45,917.00	0.05
593	605507	国邦医药	3,100	45,880.00	0.05
594	002345	潮宏基	5,000	45,850.00	0.05
595	600651	飞乐音响	8,200	45,838.00	0.05
596	301458	钧崴电子	784	45,832.64	0.05
597	688789	宏华数科	862	45,832.54	0.05
598	000650	仁和药业	9,000	45,810.00	0.05
598	603530	神马电力	900	45,810.00	0.05
599	603887	城地香江	4,900	45,766.00	0.05
600	603809	豪能股份	5,200	45,604.00	0.05
601	300446	航天智造	2,700	45,441.00	0.05
602	600315	上海家化	2,700	45,414.00	0.05
603	002315	焦点科技	1,950	45,396.00	0.05
604	300047	天源迪科	5,100	45,288.00	0.05
605	002051	中工国际	4,000	45,280.00	0.05
606	300595	欧普康视	4,300	45,279.00	0.05
607	000065	北方国际	4,600	45,218.00	0.05
608	000712	锦龙股份	5,100	45,186.00	0.05
609	002967	广电计量	2,500	45,125.00	0.05
610	600556	天下秀	10,200	45,084.00	0.05
611	300036	超图软件	4,000	45,080.00	0.05
612	688153	唯捷创芯	1,401	45,000.12	0.05
613	600507	方大特钢	11,100	44,955.00	0.05
614	002557	洽洽食品	2,500	44,900.00	0.05
615	002550	千红制药	7,200	44,712.00	0.05
616	301589	诺瓦星云	300	44,694.00	0.05
617	300376	易事特	8,700	44,544.00	0.05
618	688698	伟创电气	846	44,372.70	0.05
619	600717	天津港	11,400	44,346.00	0.05
620	002043	兔宝宝	4,000	44,320.00	0.05
621	000049	德赛电池	1,890	44,169.30	0.05
622	600012	皖通高速	2,800	44,128.00	0.05
623	601890	亚星锚链	5,400	44,118.00	0.05
624	002097	山河智能	6,100	44,103.00	0.05
625	000927	中国铁物	19,400	44,038.00	0.05
626	301238	瑞泰新材	1,800	43,920.00	0.05
627	000966	长源电力	11,200	43,904.00	0.05
628	603194	中力股份	1,200	43,872.00	0.05
629	300363	博腾股份	2,700	43,848.00	0.05
630	000880	潍柴重机	1,900	43,719.00	0.05

631	601702	华峰铝业	3,100	43,710.00	0.05
632	300910	瑞丰新材	1,556	43,630.24	0.05
633	600787	中储股份	10,400	43,472.00	0.05
634	301389	隆扬电子	500	43,395.00	0.05
635	000506	招金黄金	3,700	43,364.00	0.05
636	002928	华夏航空	6,200	43,338.00	0.05
637	603169	兰石重装	6,100	43,188.00	0.05
638	600116	三峡水利	7,700	43,120.00	0.05
639	600268	国电南自	3,700	42,994.00	0.05
640	600420	国药现代	5,400	42,930.00	0.05
641	301087	可孚医疗	900	42,885.00	0.05
642	603393	新天然气	2,000	42,820.00	0.05
643	002960	青鸟智控	5,039	42,680.33	0.05
644	002073	软控股份	8,300	42,662.00	0.05
645	603533	掌阅科技	2,100	42,609.00	0.05
646	603039	泛微网络	1,180	42,562.60	0.05
647	600273	嘉化能源	6,500	42,380.00	0.05
648	600996	贵广网络	6,100	42,334.00	0.05
649	301487	盟固利	2,200	42,130.00	0.05
650	300685	艾德生物	2,500	42,100.00	0.05
651	600129	太极集团	3,100	42,067.00	0.05
652	300990	同飞股份	400	42,028.00	0.05
653	688523	航天环宇	802	42,024.80	0.05
654	688182	灿勤科技	973	41,907.11	0.05
655	000676	智度股份	8,200	41,902.00	0.05
655	603218	日月股份	4,100	41,902.00	0.05
656	688289	圣湘生物	2,903	41,803.20	0.05
657	600158	中体产业	6,200	41,788.00	0.05
658	603599	广信股份	4,360	41,768.80	0.05
659	600502	安徽建工	9,600	41,760.00	0.05
660	002690	美亚光电	2,900	41,557.00	0.05
661	300925	法本信息	2,800	41,412.00	0.05
662	603496	恒为科技	1,800	41,364.00	0.05
663	600325	华发股份	17,900	41,349.00	0.05
664	688165	埃夫特	2,021	41,228.40	0.05
665	002204	大连重工	7,800	41,184.00	0.05
666	600094	大名城	11,900	41,174.00	0.05
667	000860	顺鑫农业	4,200	41,160.00	0.05
667	600328	中盐化工	6,860	41,160.00	0.05
668	300634	彩讯股份	2,100	41,097.00	0.05
669	002125	湘潭电化	3,000	40,980.00	0.05
670	002017	东信和平	2,800	40,964.00	0.05
671	603826	坤彩科技	1,600	40,896.00	0.05

672	301039	中集车辆	5,800	40,890.00	0.05
673	300075	数字政通	4,000	40,880.00	0.05
674	688139	海尔生物	1,540	40,686.80	0.05
675	300598	诚迈科技	1,430	40,612.00	0.05
676	603883	老百姓	3,700	40,552.00	0.05
677	601568	北元化工	11,900	40,460.00	0.05
678	600058	五矿发展	3,500	40,425.00	0.05
679	300913	兆龙互连	840	40,244.40	0.05
680	300580	贝斯特	2,000	40,220.00	0.05
681	600789	鲁抗医药	5,900	40,179.00	0.05
682	600710	苏美达	4,200	40,152.00	0.05
683	002891	中宠股份	1,500	40,080.00	0.05
684	600185	珠免集团	8,900	40,050.00	0.05
685	002163	海南发展	4,800	40,032.00	0.05
686	300428	立中集团	2,200	39,996.00	0.05
687	002221	东华能源	7,600	39,976.00	0.05
688	002987	京北方	4,102	39,912.46	0.05
689	603171	税友股份	1,000	39,850.00	0.05
690	002537	海联金汇	7,500	39,675.00	0.05
691	600686	金龙汽车	3,500	39,515.00	0.05
692	600266	城建发展	10,100	39,491.00	0.05
693	300180	华峰超纤	10,000	39,400.00	0.05
694	688050	爱博医疗	1,078	39,293.10	0.05
695	301522	上大股份	1,500	39,255.00	0.05
696	600395	盘江股份	8,600	39,216.00	0.05
697	688091	上海谊众	974	39,154.80	0.05
698	300298	三诺生物	2,800	39,060.00	0.05
699	002867	周大生	3,500	39,025.00	0.05
700	300443	金雷股份	1,800	38,844.00	0.05
701	002847	盐津铺子	870	38,802.00	0.05
702	601969	海南矿业	4,900	38,759.00	0.05
703	000503	国新健康	6,300	38,745.00	0.05
704	603730	岱美股份	3,459	38,637.03	0.05
705	000552	甘肃能化	17,200	38,528.00	0.05
706	002372	伟星新材	4,700	38,493.00	0.05
707	300188	国投智能	4,100	38,335.00	0.05
708	300482	万孚生物	2,300	38,203.00	0.05
709	600782	新钢股份	15,400	38,192.00	0.05
710	002755	奥赛康	2,800	38,136.00	0.05
711	300678	中科信息	1,700	38,080.00	0.05
712	002127	南极电商	13,800	37,812.00	0.04
713	600269	赣粤高速	9,400	37,412.00	0.04
714	600059	古越龙山	5,100	37,332.00	0.04

715	600123	兰花科创	6,990	37,326.60	0.04
716	600575	淮河能源	11,700	37,323.00	0.04
717	688439	振华风光	805	37,191.00	0.04
718	002588	史丹利	4,700	37,130.00	0.04
719	603100	川仪股份	2,050	37,002.50	0.04
720	603477	巨星农牧	2,500	37,000.00	0.04
721	600654	中安科	13,900	36,974.00	0.04
722	603027	千禾味业	5,296	36,913.12	0.04
723	688190	云路股份	403	36,556.13	0.04
724	600017	日照港	14,600	36,500.00	0.04
725	603583	捷昌驱动	1,600	36,480.00	0.04
726	603888	新华网	2,140	36,444.20	0.04
727	002881	美格智能	1,000	36,440.00	0.04
728	688660	电气风电	4,219	36,367.78	0.04
729	601908	京运通	11,600	36,308.00	0.04
730	000848	承德露露	4,900	36,260.00	0.04
731	688068	热景生物	418	36,198.80	0.04
732	600664	哈药股份	12,100	36,179.00	0.04
733	301500	飞南资源	1,380	35,949.00	0.04
734	601965	中国汽研	3,000	35,880.00	0.04
735	000061	农产品	6,400	35,840.00	0.04
736	600757	长江传媒	4,900	35,819.00	0.04
737	600373	中文传媒	5,400	35,802.00	0.04
737	603227	雪峰科技	5,100	35,802.00	0.04
738	600751	海航科技	12,300	35,793.00	0.04
739	601200	上海环境	5,420	35,772.00	0.04
740	600033	福建高速	11,100	35,742.00	0.04
741	601326	秦港股份	11,300	35,708.00	0.04
742	600866	星湖科技	8,100	35,559.00	0.04
743	002061	浙江交科	10,720	35,376.00	0.04
744	603556	海兴电力	1,600	35,200.00	0.04
745	002761	浙江建投	5,300	35,139.00	0.04
746	002096	易普力	4,000	35,120.00	0.04
747	300525	博思软件	4,700	34,968.00	0.04
748	301563	云汉芯城	200	34,878.00	0.04
749	600649	城投控股	10,100	34,845.00	0.04
750	600055	万东医疗	3,400	34,748.00	0.04
751	002605	姚记科技	1,900	34,713.00	0.04
752	603108	润达医疗	3,900	34,710.00	0.04
753	600928	西安银行	10,600	34,662.00	0.04
754	300770	新媒股份	1,100	34,639.00	0.04
755	000928	中钢国际	6,900	34,362.00	0.04
756	002572	索菲亚	4,700	34,310.00	0.04

757	300171	东富龙	3,100	34,286.00	0.04
758	605599	菜百股份	2,500	34,250.00	0.04
759	300294	博雅生物	2,400	34,176.00	0.04
759	603508	思维列控	1,600	34,176.00	0.04
760	300360	炬华科技	2,900	34,075.00	0.04
761	000950	重药控股	6,800	34,068.00	0.04
762	003010	若羽臣	1,400	34,020.00	0.04
763	300153	科泰电源	1,500	33,930.00	0.04
764	002511	中顺洁柔	5,100	33,915.00	0.04
765	002320	海峡股份	5,400	33,858.00	0.04
766	300680	隆盛科技	1,490	33,852.80	0.04
767	603317	天味食品	2,600	33,826.00	0.04
768	600729	重百集团	1,800	33,804.00	0.04
769	688776	国光电气	550	33,737.00	0.04
770	603279	景津装备	2,800	33,600.00	0.04
771	688326	经纬恒润	473	33,526.24	0.04
772	600305	恒顺醋业	5,300	33,443.00	0.04
773	603166	福达股份	2,500	33,425.00	0.04
774	600597	光明乳业	5,500	33,385.00	0.04
775	300841	康华生物	700	33,292.00	0.04
776	600971	恒源煤电	4,800	33,120.00	0.04
777	603033	三维股份	3,293	33,061.72	0.04
778	002941	新疆交建	3,500	33,040.00	0.04
779	601952	苏垦农发	4,400	32,956.00	0.04
780	002626	金达威	2,500	32,950.00	0.04
781	002516	旷达科技	5,900	32,922.00	0.04
782	600006	东风股份	6,400	32,832.00	0.04
783	600422	昆药集团	4,200	32,802.00	0.04
784	002563	森马服饰	6,500	32,760.00	0.04
785	002351	漫步者	3,600	32,724.00	0.04
786	301363	美好医疗	1,784	32,700.72	0.04
787	002892	科力尔	3,580	32,506.40	0.04
788	000028	国药一致	1,714	32,411.74	0.04
789	002194	武汉凡谷	3,300	32,340.00	0.04
790	600075	新疆天业	8,000	32,320.00	0.04
791	300641	正丹股份	2,100	32,298.00	0.04
792	002216	三全食品	2,800	32,284.00	0.04
793	600740	山西焦化	10,100	32,219.00	0.04
794	002243	力合科创	4,900	32,193.00	0.04
795	600612	老凤祥	1,000	32,150.00	0.04
796	603099	长白山	900	32,103.00	0.04
797	002434	万里扬	5,300	32,065.00	0.04
798	600882	妙可蓝多	2,000	31,980.00	0.04

799	600557	康缘药业	2,700	31,779.00	0.04
800	600248	陕建股份	11,900	31,773.00	0.04
801	300119	瑞普生物	2,200	31,746.00	0.04
802	301678	新恒汇	400	31,536.00	0.04
803	601900	南方传媒	2,900	31,494.00	0.04
804	000930	中粮科技	7,400	31,450.00	0.04
805	600163	中闽能源	6,100	31,415.00	0.04
806	603072	天和磁材	800	31,360.00	0.04
807	600252	中恒集团	17,800	31,328.00	0.04
808	300633	开立医疗	1,700	31,263.00	0.04
809	688408	中信博	972	31,249.80	0.04
810	301421	波长光电	300	31,065.00	0.04
811	000813	德展健康	10,200	30,906.00	0.04
812	000828	东莞控股	3,300	30,888.00	0.04
813	002181	粤传媒	3,100	30,845.00	0.04
814	300284	苏文科	6,100	30,500.00	0.04
815	600675	中华企业	14,800	30,488.00	0.04
816	600167	联美控股	5,400	30,186.00	0.04
817	301155	海力风电	700	30,030.00	0.04
818	300783	三只松鼠	1,900	30,020.00	0.04
819	688631	莱斯信息	636	29,834.76	0.04
820	603915	国茂股份	2,100	29,799.00	0.04
821	601096	宏盛华源	6,800	29,512.00	0.04
822	688252	天德钰	1,228	29,472.00	0.04
823	600812	华北制药	6,900	29,463.00	0.04
824	002901	大博医疗	700	29,246.00	0.03
825	301175	中科环保	5,900	29,205.00	0.03
826	301267	华夏眼科	2,000	29,180.00	0.03
827	603992	松霖科技	900	29,160.00	0.03
828	601033	永兴股份	2,175	29,145.00	0.03
829	603162	海通发展	3,242	29,080.74	0.03
830	002045	国光电器	3,700	29,045.00	0.03
831	002827	高争民爆	1,200	28,968.00	0.03
832	688586	江航装备	2,475	28,932.75	0.03
833	000059	华锦股份	7,700	28,875.00	0.03
834	002705	新宝股份	2,600	28,808.00	0.03
835	000719	中原传媒	2,500	28,575.00	0.03
836	000567	海德股份	4,781	28,542.57	0.03
837	301413	安培龙	400	28,352.00	0.03
838	300080	易成新能	7,500	28,200.00	0.03
839	002978	安宁股份	1,100	28,193.00	0.03
840	002946	新乳业	2,000	28,160.00	0.03
841	300127	银河磁体	1,000	27,950.00	0.03

842	002110	三钢闽光	9,700	27,936.00	0.03
843	600682	南京新百	5,400	27,810.00	0.03
844	688100	威胜信息	909	27,806.31	0.03
845	001914	招商积余	3,400	27,744.00	0.03
846	000550	江铃汽车	1,700	27,574.00	0.03
847	300768	迪普科技	2,000	27,540.00	0.03
848	301600	慧翰股份	300	27,420.00	0.03
849	603093	南华期货	1,500	27,225.00	0.03
850	300809	华辰装备	1,000	27,050.00	0.03
851	688032	禾迈股份	320	27,046.40	0.03
852	300702	天宇股份	1,340	27,014.40	0.03
853	002060	广东建工	8,900	26,967.00	0.03
854	688658	悦康药业	2,093	26,915.98	0.03
855	002727	一心堂	2,800	26,852.00	0.03
856	000913	钱江摩托	2,600	26,650.00	0.03
857	300134	大富科技	3,100	26,505.00	0.03
858	300341	麦克奥迪	2,000	26,500.00	0.03
859	301592	六九一二	200	26,470.00	0.03
860	601882	海天精工	1,300	26,299.00	0.03
861	002840	华统股份	3,600	26,244.00	0.03
862	688552	航天南湖	931	26,189.03	0.03
863	688522	纳睿雷达	1,291	25,845.82	0.03
864	600963	岳阳林纸	8,500	25,840.00	0.03
865	002093	国脉科技	4,100	25,830.00	0.03
866	301047	义翘神州	400	25,824.00	0.03
867	002737	葵花药业	2,300	25,783.00	0.03
868	301000	肇民科技	800	25,608.00	0.03
869	603299	苏盐井神	2,900	25,491.00	0.03
870	301091	深城交	1,640	25,420.00	0.03
871	301488	豪恩汽电	200	25,364.00	0.03
872	605198	安德利	400	25,344.00	0.03
873	600640	国脉文化	2,600	25,142.00	0.03
874	601595	上海电影	1,500	24,900.00	0.03
875	601107	四川成渝	5,100	24,888.00	0.03
876	300926	博俊科技	1,400	24,850.00	0.03
877	603025	大豪科技	1,820	24,824.80	0.03
878	002101	广东鸿图	2,600	24,804.00	0.03
879	301015	百洋医药	1,300	24,778.00	0.03
880	603707	健友股份	3,500	24,745.00	0.03
881	301109	军信股份	1,980	24,670.80	0.03
882	600639	浦东金桥	2,700	24,624.00	0.03
883	301207	华兰疫苗	1,500	24,435.00	0.03
884	688443	智翔金泰	1,048	24,366.00	0.03

885	600997	开滦股份	5,100	24,225.00	0.03
886	603919	金徽酒	1,600	24,080.00	0.03
887	603355	莱克电气	900	23,742.00	0.03
888	301551	无线传媒	1,200	23,676.00	0.03
889	601801	皖新传媒	4,800	23,664.00	0.03
890	000498	山东路桥	5,000	23,650.00	0.03
891	600929	雪天盐业	5,200	23,608.00	0.03
892	600508	上海能源	3,200	23,584.00	0.03
893	002267	陕天然气	3,600	23,544.00	0.03
894	600643	爱建集团	6,300	23,373.00	0.03
895	603132	金徽股份	1,500	23,370.00	0.03
896	000899	赣能股份	2,400	23,184.00	0.03
897	600335	国机汽车	4,900	22,932.00	0.03
898	688639	华恒生物	1,418	22,886.52	0.03
899	301565	中仑新材	1,000	22,790.00	0.03
900	688128	中国电研	959	22,766.66	0.03
901	601921	浙版传媒	3,400	22,746.00	0.03
902	300492	华图山鼎	660	22,671.00	0.03
903	688351	微电生理	998	22,614.68	0.03
904	603043	广州酒家	1,800	22,320.00	0.03
905	301327	华宝新能	460	22,112.20	0.03
906	002041	登海种业	2,800	22,036.00	0.03
907	600662	外服控股	5,400	21,762.00	0.03
908	001369	双欣材料	1,600	21,632.00	0.03
909	002053	云南能投	2,200	21,626.00	0.03
910	601949	中国出版	4,600	21,390.00	0.03
911	603327	福蓉科技	2,493	21,140.64	0.03
912	601858	中国科传	1,200	20,772.00	0.02
913	300579	数字认证	1,000	20,700.00	0.02
914	003006	百亚股份	1,400	20,314.00	0.02
915	301662	宏工科技	200	20,264.00	0.02
916	301631	壹连科技	280	20,120.80	0.02
917	603057	紫燕食品	900	20,070.00	0.02
918	601083	锦江航运	2,000	19,880.00	0.02
919	605555	德昌股份	1,580	19,750.00	0.02
920	603202	天有为	400	19,656.00	0.02
921	002961	瑞达期货	1,000	19,580.00	0.02
922	603567	珍宝岛	4,400	19,272.00	0.02
923	000885	城发环境	1,600	19,248.00	0.02
924	301101	明月镜片	700	19,068.00	0.02
925	601038	一拖股份	1,800	19,062.00	0.02
926	002882	金龙羽	1,000	18,890.00	0.02
927	301622	英思特	400	18,840.00	0.02

928	603866	桃李面包	5,100	18,768.00	0.02
929	605333	沪光股份	1,100	18,755.00	0.02
930	603193	润本股份	1,000	18,550.00	0.02
931	301381	赛维时代	1,000	18,440.00	0.02
932	002651	利君股份	2,500	18,275.00	0.02
933	301061	匠心家居	520	18,236.40	0.02
934	301268	铭利达	1,300	18,174.00	0.02
935	600618	氯碱化工	1,800	18,090.00	0.02
936	600403	大有能源	3,400	17,986.00	0.02
937	301153	中科江南	1,100	17,919.00	0.02
938	601089	福元医药	1,100	17,908.00	0.02
939	603693	江苏新能	1,420	17,877.80	0.02
940	603418	友升股份	400	17,668.00	0.02
941	301556	托普云农	300	17,538.00	0.02
942	605116	奥锐特	900	17,028.00	0.02
943	002287	奇正藏药	900	16,956.00	0.02
944	603983	丸美生物	600	16,884.00	0.02
945	688232	新点软件	945	16,802.10	0.02
946	001236	弘业期货	2,400	16,680.00	0.02
947	603055	台华新材	2,100	16,359.00	0.02
948	301262	海看股份	900	16,173.00	0.02
949	301371	敷尔佳	620	16,120.00	0.02
950	301215	中汽股份	3,100	16,089.00	0.02
951	600956	新天绿能	2,300	16,077.00	0.02
952	688177	百奥泰	955	16,063.10	0.02
953	601022	宁波远洋	2,100	16,002.00	0.02
954	301225	恒勃股份	200	15,758.00	0.02
955	000030	富奥股份	4,000	15,480.00	0.02
956	600657	信达地产	6,700	15,477.00	0.02
957	003039	顺控发展	1,400	15,414.00	0.02
958	000058	深赛格	2,400	14,736.00	0.02
959	600746	江苏索普	2,800	14,644.00	0.02
960	301339	通行宝	1,400	14,322.00	0.02
961	603013	亚普股份	900	14,211.00	0.02
962	601003	柳钢股份	4,200	14,154.00	0.02
963	002911	佛燃能源	1,480	14,045.20	0.02
964	603219	富佳股份	900	14,022.00	0.02
965	605118	力鼎光电	400	13,956.00	0.02
966	605296	神农集团	500	13,940.00	0.02
967	601026	道生天合	900	13,122.00	0.02
968	605099	共创草坪	400	12,880.00	0.02
969	603248	锡华科技	600	12,654.00	0.02
970	603395	红四方	600	12,000.00	0.01

971	603402	陕西旅游	200	11,830.00	0.01
972	001382	新亚电缆	700	10,948.00	0.01
973	601068	中铝国际	2,500	10,800.00	0.01
974	301658	首航新能	400	10,788.00	0.01
975	603014	威高血净	300	9,819.00	0.01
976	605011	杭州热电	600	9,276.00	0.01
977	001233	海安集团	200	8,940.00	0.01
978	603103	横店影视	600	8,586.00	0.01
979	301177	迪阿股份	300	8,271.00	0.01
980	301584	建发致新	400	7,976.00	0.01
981	603406	天富龙	300	7,785.00	0.01
982	301632	广东建科	500	7,740.00	0.01
983	301602	超研股份	500	6,870.00	0.01
984	301665	泰禾股份	300	6,288.00	0.01
985	603376	大明电子	200	4,956.00	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	001309	德明利	662,829.00	1.00
2	300548	长芯博创	565,878.00	0.86
3	300666	江丰电子	465,749.00	0.71
4	300475	香农芯创	443,496.00	0.67
5	002222	福晶科技	397,069.00	0.60
6	688167	炬光科技	390,434.17	0.59
7	002428	云南锗业	364,903.00	0.55
8	301377	鼎泰高科	336,550.00	0.51
9	000636	风华高科	324,662.00	0.49
10	002484	江海股份	316,461.00	0.48
11	002497	雅化集团	308,107.00	0.47
12	300620	光库科技	304,732.00	0.46
13	002456	欧菲光	303,030.00	0.46
14	688668	鼎通科技	297,124.08	0.45
15	002487	大金重工	293,798.00	0.44
16	300456	赛微电子	279,172.00	0.42
17	300672	国科微	274,557.00	0.42
18	300438	鹏辉能源	271,198.00	0.41
19	002245	蔚蓝锂芯	269,079.00	0.41

20	688627	精智达	268,557.70	0.41
----	--------	-----	------------	------

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	001309	德明利	1,323,647.20	2.00
2	688498	源杰科技	1,003,593.82	1.52
3	300548	长芯博创	952,319.00	1.44
4	300666	江丰电子	943,784.00	1.43
5	300475	香农芯创	928,225.00	1.41
6	301377	鼎泰高科	649,381.00	0.98
7	300620	光库科技	600,853.00	0.91
8	600105	永鼎股份	581,821.00	0.88
9	601869	长飞光纤	484,750.00	0.73
10	002487	大金重工	440,778.00	0.67
11	301526	国际复材	429,803.65	0.65
12	688313	仕佳光子	427,548.40	0.65
13	300953	震裕科技	385,087.60	0.58
14	002428	云南锗业	373,183.00	0.57
15	002222	福晶科技	344,577.00	0.52
16	688200	华峰测控	341,003.12	0.52
17	603256	宏和科技	316,342.00	0.48
18	001203	大中矿业	308,285.00	0.47
19	002497	雅化集团	290,763.00	0.44
20	002456	欧菲光	279,525.00	0.42

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	66,939,675.57
卖出股票收入（成交）总额	57,130,114.23

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）	56,101.46	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,101.46	0.07

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	127114	宜化转债	231	23,100.51	0.03
2	110101	宝钛转债	190	19,000.29	0.02
3	118070	南芯转债	90	9,000.51	0.01
4	118072	鼎通转债	50	5,000.15	0.01

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	720,227.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	780,720.01

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

注：截至本报告期末，本基金未持有积极投资的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,390	16,555.82	8,840,525.00	38.42	14,172,067.00	61.58

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	500.00	0.0022

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（2021 年 3 月 15 日） 基金份额总额	222,602,182.00
本报告期期初基金份额总额	21,012,592.00
本报告期基金总申购份额	26,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	23,012,592.00

§ 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。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、公募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，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无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在开展基金托管业务过程中无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

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(%)	
招商证券	6	124,069,789.80	100.00	24,816.19	100.00	-
华泰证券	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
- (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 (%)
招商证券	13,685.10	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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 1000 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相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 12 日
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	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金调低管理费率 and 托管费率并修改基金合同和托管协议的公	证监会规定报刊和网站	2026 年 05 月 27 日

	告		
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 27 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金变更基金简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 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

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(%)
机构	1	20260506-20260507;	655,787.00	30,946,736.00	30,972,717.00	629,806.00	2.74
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,这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。(3)基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小,基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形,从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。(4)基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金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