

华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 2 月 3 日（基金合同生效日）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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56

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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
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	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 A500 指数增强	
基金主代码	026433	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 3 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	597,964,942.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	026433	026434
报告期末下属分级 基金的份额总额	344,262,444.79 份	253,702,497.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略：（1）量化选股策略 1）多因子 alpha 模型——股票超额回报预测 2）风险估测模型——有效控制预期风险 3）交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩 4）投资组合的优化和调整（2）港股通标的股票投资策略 2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、衍生品投资策略；5、存托凭证投资策略；6、融资及转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂	郭明
	联系电话	021-38601777	(010) 66105799

	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	(010) 66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200135	100140
法定代表人		贾波	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	40,777,132.68	15,709,106.29
本期利润	83,854,126.35	30,428,462.44
加权平均基金份 额本期利润	0.1001	0.1138
本期加权平均净 值利润率	9.87%	11.16%
本期基金份额净 值增长率	13.65%	13.47%
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	30,413,246.58	21,969,160.00
期末可供分配基金份额利润	0.0883	0.0866
期末基金资产净值	391,253,960.77	287,873,826.81
期末基金份额净值	1.1365	1.1347
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	13.65%	13.47%

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

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

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

4、基金成立于 2026 年 2 月 3 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	17.98%	1.31%	13.54%	1.34%	4.44%	-0.03%
自基金合同生效起至今	13.65%	1.14%	9.50%	1.28%	4.15%	-0.14%

华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	17.87%	1.31%	13.54%	1.34%	4.33%	-0.03%
自基金合同生效起至今	13.47%	1.14%	9.50%	1.28%	3.97%	-0.14%

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A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞中证A500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、A类图示日期为2026年2月3日（基金合同生效日）至2026年6月30日。C类图示日期为2026年2月3日（基金合同生效日）至2026年6月30日。

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

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§ 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		
笪篁	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2026 年 2 月 3 日	-	11 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 11 次，是指数或量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

本报告期，代表大市值公司的沪深 300 上涨 7.55%；代表中小市值公司的中证 500、中证 1000 同期涨幅分别为 20.97%、15.99%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数下跌 6.82%。横

向比较来看，股价弹性较大的中小市值公司，在本季度跑赢资源品占比较高的高股息类上市公司和大市值类上市公司。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1365 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.65%，同期业绩比较基准收益率为 9.50%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1347 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.47%，同期业绩比较基准收益率为 9.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，A 股市场面临的国内外环境相对友好。2026 年以来，尽管美伊冲突威胁全球能源供应链，得益于能源安全体系构建，以及新能源转型的成果，国内经济韧性再一次得到验证。我们认为今后一段时间，供应链安全或位于更加突出的位置，产业链的自主可控或也更加深入推进。消费转型升级等扩内需政策有望延续，人工智能及应用等产业方向的引导可能加强。海外，美国的对外政策给全球经济发展带来一定不确定性，但中长期我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力。2026 年是“十五五”规划开局之年，各领域的投资可能靠前发力，有望进一步增强市场对于中国经济的信心。在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的上升区间。

量化策略方面，在经历年初以来风险偏好的波动之后，未来股票市场的不确定性或在下降。随着半年度财报季临近，我们认为投资人可能更加关注上市公司业绩展望的边际变化。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的成长和价值类因子近期表现较好，我们认为其趋势仍有望延续。质量和量价类因子表现相对稳健，后续表现可期。同时，我们认为在后市当中，大小市值、各行业股票或均有机会，量化投资全市场选股的优势有望得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，或是很不错的配置风格均衡的多因子量化基金的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	95,289,639.88
结算备付金		3,196,909.17
存出保证金		7,281,336.00

交易性金融资产	6.4.7.2	580,794,785.46
其中：股票投资		560,665,147.10
基金投资		-
债券投资		20,129,638.36
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		-
应收股利		-
应收申购款		1,548,479.88
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		688,111,150.39
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		8,356,912.20
应付管理人报酬		408,588.95
应付托管费		76,610.44
应付销售服务费		62,644.95
应付投资顾问费		-
应交税费		6,943.58
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	71,662.69
负债合计		8,983,362.81
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	597,964,942.20
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	81,162,845.38
净资产合计		679,127,787.58

负债和净资产总计		688,111,150.39
----------	--	----------------

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 597,964,942.20 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1365 元，基金份额总额 344,262,444.79 份；下属 C 类基金份额净值 1.1347 元，基金份额总额 253,702,497.41 份。

2、本基金合同生效日为 2026 年 02 月 03 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 2 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同 生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		119,148,717.77
1. 利息收入		1,548,029.66
其中：存款利息收入	6.4.7.13	255,280.22
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		1,292,749.44
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		59,742,802.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	51,035,708.16
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	48,027.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	3,572,832.03
股利收益	6.4.7.19	5,086,235.02
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	57,796,349.82
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	61, 535. 36
减：二、营业总支出		4, 866, 128. 98
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 645, 257. 67
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	683, 485. 79
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	442, 367. 18
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		13, 154. 95
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	81, 863. 39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		114, 282, 588. 79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		114, 282, 588. 79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		114, 282, 588. 79

注：本基金合同生效日为 2026 年 02 月 03 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 2 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 561, 774, 296. 65	-	-	1, 561, 774, 296. 65

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 963,809,354.45	-	81,162,845.38	-882,646,509.07
(一)、综合收益总额	-	-	114,282,588.79	114,282,588.79
(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)	- 963,809,354.45	-	-33,119,743.41	-996,929,097.86
其中：1. 基金申购款	202,700,363.37	-	17,697,536.82	220,397,900.19
2. 基金赎回款	- 1,166,509,717.82	-	-50,817,280.23	- 1,217,326,998.05
(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	597,964,942.20	-	81,162,845.38	679,127,787.58

注：本基金合同生效日为 2026 年 02 月 03 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 2 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委

员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2811 号《关于准予华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,561,247,571.67 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(26)第 00039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2026 年 2 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,561,774,296.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 526,724.98 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含科创板、创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:股票及存托凭证资产的投资比例不低于基金资产的 80%;投资于港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%,投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率

(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 02 月 03 日(基金合同生效日)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 02 月 03 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 02 月 03 日至 2026 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量:

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

权金额，确认预期信用损失。

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 分部报告

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

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

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业

务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份

转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

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

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

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

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	95,289,639.88
等于：本金	95,287,752.02
加：应计利息	1,887.86
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	95,289,639.88

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		503,997,657.28	-	560,665,147.10	56,667,489.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	20,017,600.00	111,638.36	20,129,638.36	400.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,017,600.00	111,638.36	20,129,638.36	400.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	524,015,257.28	111,638.36	580,794,785.46	56,667,889.82

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	59,549,340.00	-	-	
其中： 股指期货投资	59,549,340.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	59,549,340.00	-	-	

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
IC2607	中证 500 股指期货 2607	10.00	17,856,400.00	557,080.00
IF2607	沪深 300 股指期货 2607	29.00	42,821,400.00	571,380.00
合计				1,128,460.00
减：可抵销期货暂收款				1,128,460.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	71,325.64
其他应付款	337.05
合计	71,662.69

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,194,779,193.36	1,194,779,193.36
本期申购	55,894,116.57	55,894,116.57
本期赎回（以“-”号填列）	-906,410,865.14	-906,410,865.14
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	344,262,444.79	344,262,444.79

华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C

项目	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	366,995,103.29	366,995,103.29
本期申购	146,806,246.80	146,806,246.80
本期赎回（以“-”号填列）	-260,098,852.68	-260,098,852.68
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	253,702,497.41	253,702,497.41

注：1、申购(含红利再投)含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2026 年 1 月 19 日起至 2026 年 1 月 30 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,561,247,571.67 元，折合为 1,561,247,571.67 份基金份额(其中 A 类基金份额 1,194,322,566.04 份，C 类基金份额 366,925,005.63 份)。根据《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 526,724.98 元，在本基金成立后，折合为 526,724.98 份基金份额(其中 A 类基金份额 456,627.32 份，C 类基金份额 70,097.66 份)，划入基金份额持有人账户。

3、根据《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》及《华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告》的相关规定，本基金于 2026 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2026 年 3 月 9 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换和定期定额投资业务，相关业务自 2026 年 3 月 10 日起开始办理。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	40,777,132.68	43,076,993.67	83,854,126.35
本期基金份额交易产生的变动数	-10,363,886.10	-26,498,724.27	-36,862,610.37
其中：基金申购款	2,869,872.62	1,851,696.25	4,721,568.87
基金赎回款	-13,233,758.72	-28,350,420.52	-41,584,179.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,413,246.58	16,578,269.40	46,991,515.98

华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	15,709,106.29	14,719,356.15	30,428,462.44
本期基金份额交易产生的变动数	6,260,053.71	-2,517,186.75	3,742,866.96
其中：基金申购款	9,667,014.98	3,308,952.97	12,975,967.95
基金赎回款	-3,406,961.27	-5,826,139.72	-9,233,100.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,969,160.00	12,202,169.40	34,171,329.40

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	85,921.98
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	169,356.83
其他	1.41
合计	255,280.22

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2月3日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	51,035,708.16
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	51,035,708.16

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 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,186,066,075.71
减：卖出股票成本总额	1,133,691,884.09
减：交易费用	1,338,483.46
买卖股票差价收入	51,035,708.16

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年2月3日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	48,027.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
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	48,027.72

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,572,832.03

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,086,235.02
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	5,086,235.02

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 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	56,667,889.82
股票投资	56,667,489.82
债券投资	400.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	1,128,460.00
权证投资	—
期货投资	1,128,460.00
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	57,796,349.82

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	61,256.45
基金转换费收入	278.91
合计	61,535.36

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	22,288.80
信息披露费	49,036.84
证券出借违约金	-
开户费	400.00
银行划款手续费	10,063.50
存托服务费	74.25
合计	81,863.39

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”	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

基金”)	
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、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
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

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 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	2,821,660,616.05	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 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
华泰证券	20,017,600.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
华泰证券	4,500,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年2月3日（基金合同生效日）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（%）

华泰证券	564,452.60	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 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,645,257.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,808,533.47
应支付基金管理人的净管理费	1,836,724.20

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	683,485.79

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费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：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C	合计
中国工商银行股份有限公司	—	226,041.62	226,041.62
华泰证券股份有限公司	—	101,885.57	101,885.57
华泰柏瑞基金管理有限公司	—	66.84	66.84
合计	—	327,994.03	327,994.03

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	9,298,971.91	46,031.87
华泰证券	85,990,667.97	39,890.11

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金的券商保证金为存放在华泰证券基金专用账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

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 2 月 3 日（基金合同生效日）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
华泰联合证券有限责任公司	603293.SH	埃泰克	网下申购	716	23,978.84

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	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
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	-
001257	盛龙	2026 年 3	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

	股份	月 24 日		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	3,335	33,750.20	92,479.55	-
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	-
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	-
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	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁定 期内	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603293	埃泰	2026 年 4	6 个月	新股 锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

	克	月 9 日		期内						
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	-
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	-
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	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.68	141.49	2,189	43,079.52	309,721.61	-

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；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行

结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份或创业板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	3,204	1,090,945.06	2,818,014.12	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

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。

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

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

到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	95,289,639.88	-	-	-	-	-	95,289,639.88
结算备付金	3,196,909.17	-	-	-	-	-	3,196,909.17
存出保证金	-	-	-	-	-	7,281,336.00	7,281,336.00
交易性金融资产	-	-	20,129,638.36	-	-	560,665,147.10	580,794,785.46
应收申购款	-	-	-	-	-	1,548,479.88	1,548,479.88
资产总计	98,486,549.05	-	20,129,638.36	-	-	569,494,962.98	688,111,150.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,356,912.20	8,356,912.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	408,588.95	408,588.95
应付托管费	-	-	-	-	-	76,610.44	76,610.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	62,644.95	62,644.95
应交税费	-	-	-	-	-	6,943.58	6,943.58
其他负债	-	-	-	-	-	71,662.69	71,662.69
负债总计	-	-	-	-	-	8,983,362.81	8,983,362.81
利率敏感度缺口	98,486,549.05	-	20,129,638.36	-	-	560,511,600.17	679,127,787.58

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 2.96%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	560,665,147.10	82.56
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	560,665,147.10	82.56

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）
	业绩比较基准上升 5%	25,171,941.11
	业绩比较基准下降 5%	-25,171,941.11

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
--

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	556,228,770.28
第二层次	22,947,652.48
第三层次	1,618,362.70
合计	580,794,785.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	560,665,147.10	81.48
	其中：股票	560,665,147.10	81.48
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	20,129,638.36	2.93
	其中：债券	20,129,638.36	2.93
	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	98,486,549.05	14.31
8	其他各项资产	8,829,815.88	1.28
9	合计	688,111,150.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	146,958.00	0.02
B	采矿业	23,786,889.82	3.50
C	制造业	390,039,914.73	57.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,684,906.00	0.84
E	建筑业	2,959,061.00	0.44
F	批发和零售业	9,950,158.00	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	8,354,715.00	1.23
H	住宿和餐饮业	235,669.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,219,480.25	5.77
J	金融业	62,149,113.00	9.15
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	595,955.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	15,560,093.30	2.29
N	水利、环境和公共设施管理业	313,574.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,668,660.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—

	合计	560,665,147.10	82.56
--	----	----------------	-------

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	26,000	33,020,000.00	4.86
2	300750	宁德时代	67,400	26,488,874.00	3.90
3	300502	新易盛	28,720	17,433,040.00	2.57
4	603986	兆易创新	17,000	13,855,000.00	2.04
5	600519	贵州茅台	9,820	11,641,511.80	1.71
6	688256	寒武纪	6,912	11,028,441.60	1.62
7	603259	药明康德	74,200	9,238,642.00	1.36
8	688041	海光信息	24,117	8,930,525.10	1.31
9	600030	中信证券	291,500	8,374,795.00	1.23
10	601318	中国平安	167,400	7,991,676.00	1.18
11	688012	中微公司	16,162	7,571,897.00	1.11
12	601899	紫金矿业	279,000	7,014,060.00	1.03
13	002384	东山精密	26,100	6,847,335.00	1.01
14	000333	美的集团	88,700	6,699,511.00	0.99
15	300223	北京君正	26,400	6,570,960.00	0.97
16	600176	中国巨石	88,000	6,413,440.00	0.94
17	601328	交通银行	997,300	6,412,639.00	0.94
18	600183	生益科技	35,500	6,155,700.00	0.91
19	300408	三环集团	35,000	5,841,500.00	0.86
20	002371	北方华创	6,000	5,307,360.00	0.78
21	600522	中天科技	82,700	5,018,236.00	0.74
22	601211	国泰海通	266,100	4,843,020.00	0.71
23	600036	招商银行	129,900	4,611,450.00	0.68
24	688521	芯原股份	12,390	4,598,424.60	0.68
25	002475	立讯精密	63,600	4,477,440.00	0.66
26	600150	中国船舶	131,800	4,453,522.00	0.66
27	300475	香农芯创	14,120	4,236,000.00	0.62
28	603345	安井食品	52,700	4,226,013.00	0.62
29	688981	中芯国际	25,780	4,094,379.60	0.60
30	688266	泽璟制药	35,040	4,087,766.40	0.60
31	600276	恒瑞医药	77,800	4,048,712.00	0.60
32	002517	恺英网络	248,400	4,036,500.00	0.59
33	688002	睿创微纳	25,276	3,909,944.44	0.58
34	000776	广发证券	167,000	3,907,800.00	0.58
35	601166	兴业银行	235,500	3,899,880.00	0.57

36	600489	中金黄金	213,600	3,855,480.00	0.57
37	000651	格力电器	102,400	3,840,000.00	0.57
38	002415	海康威视	111,300	3,806,460.00	0.56
39	002008	大族激光	25,200	3,782,772.00	0.56
40	000792	盐湖股份	125,000	3,773,750.00	0.56
41	300438	鹏辉能源	45,300	3,753,105.00	0.55
42	601601	中国太保	130,650	3,726,138.00	0.55
43	300604	长川科技	10,400	3,550,768.00	0.52
44	002558	巨人网络	128,300	3,535,948.00	0.52
45	002493	荣盛石化	324,000	3,483,000.00	0.51
46	688111	金山办公	16,342	3,481,663.10	0.51
47	000157	中联重科	473,700	3,301,689.00	0.49
48	688629	华丰科技	17,350	3,253,298.50	0.48
49	600309	万华化学	45,100	3,085,291.00	0.45
50	600741	华域汽车	198,100	3,074,512.00	0.45
51	300661	圣邦股份	21,000	3,013,080.00	0.44
52	300014	亿纬锂能	45,800	2,978,374.00	0.44
53	601988	中国银行	519,900	2,973,828.00	0.44
54	300073	当升科技	61,700	2,964,068.00	0.44
55	000100	TCL 科技	497,200	2,893,704.00	0.43
56	002916	深南电路	6,300	2,884,770.00	0.42
57	000338	潍柴动力	105,400	2,872,150.00	0.42
58	601233	桐昆股份	132,600	2,870,790.00	0.42
59	601117	中国化学	389,500	2,862,825.00	0.42
60	688072	拓荆科技	3,204	2,818,014.12	0.41
61	600031	三一重工	162,100	2,801,088.00	0.41
62	603799	华友钴业	56,700	2,736,342.00	0.40
63	688095	福昕软件	44,990	2,673,755.70	0.39
64	601100	恒立液压	24,000	2,581,440.00	0.38
65	603993	洛阳钼业	146,000	2,562,300.00	0.38
66	300033	同花顺	10,480	2,525,680.00	0.37
67	300919	中伟新材	57,400	2,511,250.00	0.37
68	002128	电投能源	108,300	2,503,896.00	0.37
69	300037	新宙邦	26,800	2,488,380.00	0.37
70	600886	国投电力	185,500	2,469,005.00	0.36
71	000301	东方盛虹	209,400	2,397,630.00	0.35
72	300432	富临精工	119,300	2,396,737.00	0.35
73	301002	崧盛股份	61,500	2,373,900.00	0.35
74	600346	恒力石化	132,900	2,353,659.00	0.35
75	688498	源杰科技	1,200	2,263,200.00	0.33
76	300012	华测检测	159,900	2,216,214.00	0.33
77	002460	赣锋锂业	33,600	2,197,440.00	0.32
78	600900	长江电力	82,300	2,178,481.00	0.32

79	688388	嘉元科技	49,470	2,176,680.00	0.32
80	000951	中国重汽	109,235	2,131,174.85	0.31
81	688599	天合光能	147,200	2,078,464.00	0.31
82	601288	农业银行	341,200	2,071,084.00	0.30
83	601628	中国人寿	58,200	2,057,370.00	0.30
84	000034	神州数码	73,980	2,052,945.00	0.30
85	000425	徐工机械	252,700	2,044,343.00	0.30
86	688503	聚和材料	15,400	2,043,580.00	0.30
87	002532	天山铝业	190,300	2,041,919.00	0.30
88	688396	华润微	20,900	2,038,795.00	0.30
89	000630	铜陵有色	309,300	1,967,148.00	0.29
90	601877	正泰电器	78,400	1,965,488.00	0.29
91	300953	震裕科技	14,640	1,957,368.00	0.29
92	000408	藏格矿业	27,600	1,913,232.00	0.28
93	688008	澜起科技	6,136	1,901,546.40	0.28
94	000938	紫光股份	65,800	1,898,988.00	0.28
95	002463	沪电股份	12,400	1,894,720.00	0.28
96	002738	中矿资源	32,000	1,887,680.00	0.28
97	601816	京沪高铁	416,300	1,885,839.00	0.28
98	600026	中远海能	105,000	1,883,700.00	0.28
99	301536	星辰科技	14,300	1,840,553.00	0.27
100	600418	江淮汽车	70,100	1,810,683.00	0.27
101	601077	渝农商行	292,700	1,788,397.00	0.26
102	002001	新 和 成	62,500	1,776,250.00	0.26
103	688202	美迪西	21,950	1,771,584.50	0.26
104	600487	亨通光电	15,900	1,738,506.00	0.26
105	002050	三花智控	38,700	1,696,221.00	0.25
106	600050	中国联通	423,800	1,695,200.00	0.25
107	002271	东方雨虹	141,800	1,683,166.00	0.25
108	301358	湖南裕能	22,093	1,676,195.91	0.25
109	301239	普瑞眼科	54,800	1,668,660.00	0.25
110	300124	汇川技术	25,100	1,664,883.00	0.25
111	000975	山金国际	97,800	1,662,600.00	0.24
112	000426	兴业银锡	50,100	1,651,296.00	0.24
113	000807	云铝股份	74,400	1,647,216.00	0.24
114	000848	承德露露	220,100	1,628,740.00	0.24
115	600499	科达制造	117,500	1,621,500.00	0.24
116	001389	广合科技	6,800	1,613,300.00	0.24
117	605117	德业股份	14,860	1,577,834.80	0.23
118	603233	大参林	104,600	1,572,138.00	0.23
119	300373	扬杰科技	9,900	1,556,577.00	0.23
120	601231	环旭电子	48,000	1,555,200.00	0.23
121	688778	厦钨新能	28,330	1,541,152.00	0.23

122	600885	宏发股份	42,300	1,458,927.00	0.21
123	688700	东威科技	16,200	1,448,280.00	0.21
124	000783	长江证券	146,900	1,432,275.00	0.21
125	601766	中国中车	273,700	1,423,240.00	0.21
126	000001	平安银行	140,200	1,409,010.00	0.21
127	000657	中钨高新	14,300	1,368,796.00	0.20
128	600015	华夏银行	204,800	1,308,672.00	0.19
129	000933	神火股份	61,400	1,301,680.00	0.19
130	002064	华峰化学	133,900	1,270,711.00	0.19
131	688045	必易微	15,553	1,256,371.34	0.18
132	688372	伟测科技	6,747	1,254,942.00	0.18
133	002812	恩捷股份	18,500	1,237,835.00	0.18
134	600595	中孚实业	215,400	1,210,548.00	0.18
135	603019	中科曙光	11,200	1,200,976.00	0.18
136	605358	立昂微	14,600	1,132,960.00	0.17
137	688469	芯联集成	106,650	1,131,556.50	0.17
138	600938	中国海油	41,300	1,121,295.00	0.17
139	300567	精测电子	3,300	1,048,080.00	0.15
140	300059	东方财富	51,400	1,047,532.00	0.15
141	600887	伊利股份	43,600	1,044,656.00	0.15
142	601168	西部矿业	37,700	1,023,178.00	0.15
143	601319	中国人保	150,900	1,020,084.00	0.15
144	601872	招商轮船	56,500	992,705.00	0.15
145	601699	潞安环能	67,900	969,612.00	0.14
146	600104	上汽集团	99,200	968,192.00	0.14
147	688279	峰岬科技	4,300	965,092.00	0.14
148	600549	厦门钨业	11,200	954,240.00	0.14
149	688652	京仪装备	4,750	950,807.50	0.14
150	600998	九州通	199,300	934,717.00	0.14
151	603018	华设集团	171,920	883,668.80	0.13
152	300476	胜宏科技	2,500	866,075.00	0.13
153	300857	协创数据	2,500	849,750.00	0.13
154	002353	杰瑞股份	5,500	838,750.00	0.12
155	300442	润泽科技	10,000	830,700.00	0.12
156	300398	飞凯材料	13,400	827,450.00	0.12
157	601689	拓普集团	14,400	812,448.00	0.12
158	002468	申通快递	55,700	810,992.00	0.12
159	600233	圆通速递	51,400	809,550.00	0.12
160	688692	达梦数据	3,005	734,091.45	0.11
161	688536	思瑞浦	2,004	729,636.36	0.11
162	600941	中国移动	8,400	723,492.00	0.11
163	600019	宝钢股份	132,900	721,647.00	0.11
164	688630	芯碁微装	1,300	714,207.00	0.11

165	300454	深信服	7,400	711,880.00	0.10
166	688167	炬光科技	2,000	708,420.00	0.10
167	301308	江波龙	1,000	703,800.00	0.10
168	002120	韵达股份	109,500	696,420.00	0.10
169	000729	燕京啤酒	67,200	680,736.00	0.10
170	601225	陕西煤业	31,900	649,165.00	0.10
171	301608	博实结	12,826	644,634.76	0.09
172	002444	巨星科技	20,700	643,770.00	0.09
173	688063	派能科技	12,080	643,501.60	0.09
174	600795	国电电力	137,100	640,257.00	0.09
175	600546	山煤国际	58,000	633,940.00	0.09
176	601018	宁波港	200,700	632,205.00	0.09
177	601728	中国电信	118,200	613,458.00	0.09
178	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.08
179	603225	新凤鸣	28,600	561,990.00	0.08
180	002156	通富微电	7,400	561,438.00	0.08
181	002283	天润工业	56,800	548,120.00	0.08
182	601600	中国铝业	64,000	526,080.00	0.08
183	603061	金海通	1,000	502,220.00	0.07
184	002379	宏桥控股	33,900	500,703.00	0.07
185	688525	佰维存储	1,000	494,730.00	0.07
186	002202	金风科技	20,500	489,950.00	0.07
187	688717	艾罗能源	5,621	464,125.97	0.07
188	002345	潮宏基	50,600	464,002.00	0.07
189	601156	东航物流	28,400	457,808.00	0.07
190	688795	摩尔线程	600	429,894.00	0.06
191	601061	中信金属	39,400	424,338.00	0.06
192	000977	浪潮信息	5,900	413,000.00	0.06
193	688188	柏楚电子	3,868	412,715.60	0.06
194	688059	华锐精密	2,050	409,405.50	0.06
195	002078	太阳纸业	32,700	408,423.00	0.06
196	000973	佛塑科技	28,400	407,540.00	0.06
197	000415	渤海租赁	99,700	405,779.00	0.06
198	600999	招商证券	18,800	396,680.00	0.06
199	688766	普冉股份	500	383,300.00	0.06
200	002925	盈趣科技	15,500	382,230.00	0.06
201	001316	润贝航科	11,500	379,270.00	0.06
202	301606	绿联科技	6,000	366,120.00	0.05
203	300339	润和软件	9,300	358,143.00	0.05
204	688213	思特威	3,150	337,270.50	0.05
205	600027	华电国际	71,000	315,950.00	0.05
206	688160	步科股份	2,900	315,433.00	0.05
207	002484	江海股份	3,000	315,000.00	0.05

208	600801	华新建材	20,000	312,000.00	0.05
209	688820	盛合晶微	2,189	309,721.61	0.05
210	000550	江铃汽车	18,900	306,558.00	0.05
211	688578	艾力斯	2,701	294,949.20	0.04
212	301123	奕东电子	2,400	289,728.00	0.04
213	688025	杰普特	600	282,000.00	0.04
214	688702	盛科通信	700	272,993.00	0.04
215	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.04
216	000902	新洋丰	22,600	261,256.00	0.04
217	301101	明月镜片	9,500	258,780.00	0.04
218	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
219	600166	福田汽车	88,700	258,117.00	0.04
220	000039	中集集团	31,100	252,221.00	0.04
221	688017	绿的谐波	600	250,716.00	0.04
222	301150	中一科技	3,860	243,604.60	0.04
223	000519	中兵红箭	11,300	238,091.00	0.04
224	600754	锦江酒店	13,100	235,669.00	0.03
225	601577	长沙银行	26,800	233,428.00	0.03
226	688328	深科达	2,350	224,895.00	0.03
227	688049	炬芯科技	4,730	221,884.30	0.03
228	601607	上海医药	14,300	220,220.00	0.03
229	300573	兴齐眼药	5,100	207,876.00	0.03
230	301548	崇德科技	2,300	204,171.00	0.03
231	002466	天齐锂业	3,300	202,356.00	0.03
232	301087	可孚医疗	4,100	195,365.00	0.03
233	688257	新锐股份	1,900	193,610.00	0.03
234	300662	科锐国际	11,200	190,176.00	0.03
235	603638	艾迪精密	8,000	187,600.00	0.03
236	600018	上港集团	39,300	185,496.00	0.03
237	000703	恒逸石化	13,600	184,552.00	0.03
238	688110	东芯股份	900	183,330.00	0.03
239	600761	安徽合力	11,000	179,960.00	0.03
240	002080	中材科技	1,800	162,000.00	0.02
241	300867	圣元环保	8,900	161,268.00	0.02
242	688120	华海清科	500	161,090.00	0.02
243	688291	金橙子	2,700	157,896.00	0.02
244	688200	华峰测控	300	157,530.00	0.02
245	000725	京东方 A	17,800	154,504.00	0.02
246	002266	浙富控股	30,100	152,306.00	0.02
247	002850	科达利	800	151,440.00	0.02
248	002714	牧原股份	4,200	146,958.00	0.02
249	688627	精智达	200	143,000.00	0.02
250	002281	光迅科技	500	128,470.00	0.02

251	688697	纽威数控	8,600	116,874.00	0.02
252	688281	华秦科技	2,300	115,529.00	0.02
253	002948	青岛银行	20,700	105,156.00	0.02
254	600028	中国石化	23,300	103,918.00	0.02
255	300681	英搏尔	3,500	100,170.00	0.01
256	002299	圣农发展	6,600	100,056.00	0.01
257	603659	璞泰来	3,400	98,362.00	0.01
258	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
259	601677	明泰铝业	5,700	94,620.00	0.01
260	600511	国药股份	3,600	93,744.00	0.01
261	001399	惠科股份	3,335	92,479.55	0.01
262	600362	江西铜业	2,100	90,930.00	0.01
263	300759	康龙化成	3,000	86,790.00	0.01
264	600011	华能国际	10,700	81,213.00	0.01
265	600372	中航机载	7,200	78,120.00	0.01
266	002126	银轮股份	1,300	64,740.00	0.01
267	300277	汽轮科技	4,200	63,168.00	0.01
268	688220	翱捷科技	500	62,160.00	0.01
269	688046	药康生物	2,500	60,500.00	0.01
270	600039	四川路桥	7,700	60,214.00	0.01
271	300207	欣旺达	3,100	58,869.00	0.01
272	002756	永兴材料	900	50,976.00	0.01
273	002497	雅化集团	2,500	50,925.00	0.01
274	600363	联创光电	1,400	50,092.00	0.01
275	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
276	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
277	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
278	601668	中国建筑	8,300	36,022.00	0.01
279	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.01
280	688293	奥浦迈	800	33,352.00	0.00
281	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
282	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
283	301086	鸿富瀚	100	20,928.00	0.00
284	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
285	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
286	300473	德尔股份	600	18,240.00	0.00
287	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
288	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
289	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
290	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
291	300347	泰格医药	300	14,400.00	0.00
292	601939	建设银行	1,300	12,519.00	0.00
293	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00

294	002833	弘亚数控	500	9,645.00	0.00
295	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
296	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
297	603198	迎驾贡酒	100	2,960.00	0.00
298	300348	长亮科技	300	2,640.00	0.00
299	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
300	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
301	002221	东华能源	400	2,104.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	36,773,646.65	5.41
2	600519	贵州茅台	28,160,856.60	4.15
3	300308	中际旭创	26,636,433.60	3.92
4	601899	紫金矿业	25,931,217.00	3.82
5	601318	中国平安	24,012,993.00	3.54
6	601211	国泰海通	14,585,957.00	2.15
7	300502	新易盛	13,580,099.00	2.00
8	000333	美的集团	13,513,180.60	1.99
9	600036	招商银行	13,445,133.00	1.98
10	603259	药明康德	13,173,934.00	1.94
11	000792	盐湖股份	12,372,790.00	1.82
12	601166	兴业银行	12,209,062.00	1.80
13	601328	交通银行	11,639,413.00	1.71
14	002475	立讯精密	11,254,279.00	1.66
15	600150	中国船舶	11,135,602.44	1.64
16	600309	万华化学	11,095,044.00	1.63
17	688041	海光信息	10,715,024.57	1.58
18	600030	中信证券	10,000,437.00	1.47
19	301358	湖南裕能	9,713,100.20	1.43
20	603993	洛阳钼业	9,651,908.00	1.42

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	21,044,292.00	3.10
2	300750	宁德时代	13,949,109.00	2.05
3	601899	紫金矿业	13,579,284.00	2.00
4	600519	贵州茅台	12,751,611.00	1.88

5	601318	中国平安	11,797,557.00	1.74
6	600183	生益科技	10,876,437.00	1.60
7	002475	立讯精密	10,581,028.00	1.56
8	002463	沪电股份	9,684,879.00	1.43
9	301358	湖南裕能	9,599,391.00	1.41
10	002938	鹏鼎控股	8,511,147.00	1.25
11	600036	招商银行	8,301,370.00	1.22
12	601211	国泰海通	8,223,842.00	1.21
13	300037	新宙邦	8,196,723.00	1.21
14	000792	盐湖股份	8,162,265.00	1.20
15	002460	赣锋锂业	8,135,315.00	1.20
16	002709	天赐材料	8,045,084.00	1.18
17	000408	藏格矿业	8,027,610.00	1.18
18	688002	睿创微纳	7,974,585.68	1.17
19	002466	天齐锂业	7,931,968.20	1.17
20	600309	万华化学	7,918,127.00	1.17

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	1,637,689,541.37
卖出股票收入（成交）总额	1,186,066,075.71

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	20,129,638.36	2.96
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,129,638.36	2.96

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	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净
----	-----	------	----	------	--------

	码		(张)		值比例 (%)
1	019827	26 国债 01	200,000	20,129,638.36	2.96

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价
注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形
本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券（600030）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所和中国银行间市场交易商协会的处罚。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库
基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,281,336.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,548,479.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,829,815.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	5,996	57,415.35	137,132.86	0.04	344,125,311.93	99.96
华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C	20,854	12,165.65	92,991,465.85	36.65	160,711,031.56	63.35
合计	26,554	22,518.83	93,128,598.71	15.57	504,836,343.49	84.43

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	0.00	0.0000
	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C	46,518.18	0.0183
	合计	46,518.18	0.0078

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 A	华泰柏瑞中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 （2026 年 2 月 3 日）基金份额总额	1,194,779,193.36	366,995,103.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	55,894,116.57	146,806,246.80
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	906,410,865.14	260,098,852.68
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	344,262,444.79	253,702,497.41

§ 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：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
华泰证券	3	2,821,660,616.05	100.00	564,452.60	100.00	—

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

(1) 具有相应的业务经营资格；

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

特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

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

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

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

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

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

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

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、租用证券公司交易单元的变更情况：本基金于 2026 年 02 月 03 日成立，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额	成交金额	占当期 债券回 购成交	成交金额	占当期 权证 成交总

		的比例 (%)		总额的 比例 (%)		额的比 例 (%)
华泰证券	20,017,600.00	100.00	4,500,000,000.00	100.00	-	-

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
4	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
5	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
6	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
7	华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 07 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	华泰柏瑞中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 04 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 26 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 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