

华泰柏瑞中证全指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：中泰证券股份有限公司

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。

基金托管人中泰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 4 月 14 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遵规守信情况的说明	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	12
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遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62

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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	66
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证全指指数增强	
基金主代码	026690	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 14 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中泰证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	110,267,526.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	华泰柏瑞中证全指指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	026690	026691
报告期末下属分级 基金的份额总额	64,540,254.44 份	45,727,272.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	1、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	中证全指指数收益率×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。

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	中泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂	王秀荣
	联系电话	021-38601777	0531-68889484
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	wangxr01@zts.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95538
传真		021-38601799	0531-68889445
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	济南市高新区经十路 7000 号汉 峪金融商务中心五区 3 号楼
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	山东省济南市经十路 7000 号汉 峪金融商务中心五区 3 号楼 35

		层
邮政编码	200135	250101
法定代表人	贾波	王洪

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	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 4 月 14 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	华泰柏瑞中证全指指数增强 C
本期已实现收益	2,255,593.51	2,833,359.50
本期利润	-2,497,806.04	-450,336.52
加权平均基金份 额本期利润	-0.0266	-0.0050
本期加权平均净 值利润率	-2.68%	-0.50%
本期基金份额净 值增长率	-4.76%	-4.80%
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	-3,069,963.15	-2,195,051.27
期末可供分配基 金份额利润	-0.0476	-0.0480
期末基金资产净 值	61,470,291.29	43,532,220.94

期末基金份额净值	0.9524	0.9520
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	-4.76%	-4.80%

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

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

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

4、本基金基金合同于 2026 年 4 月 14 日起生效。

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

华泰柏瑞中证全指指数增强 A

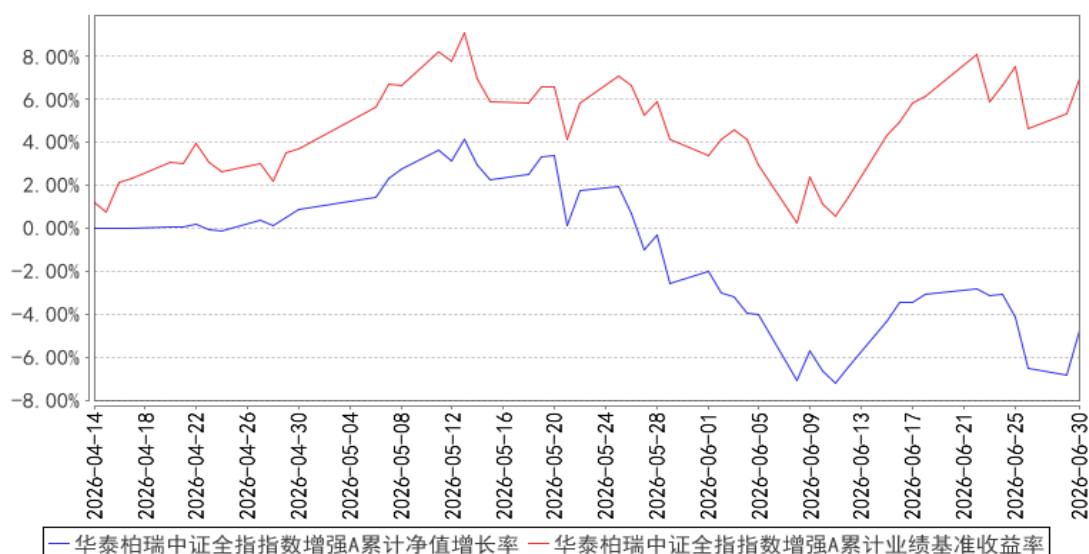
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	-4.76%	1.11%	6.98%	1.24%	-11.74%	-0.13%

华泰柏瑞中证全指指数增强 C

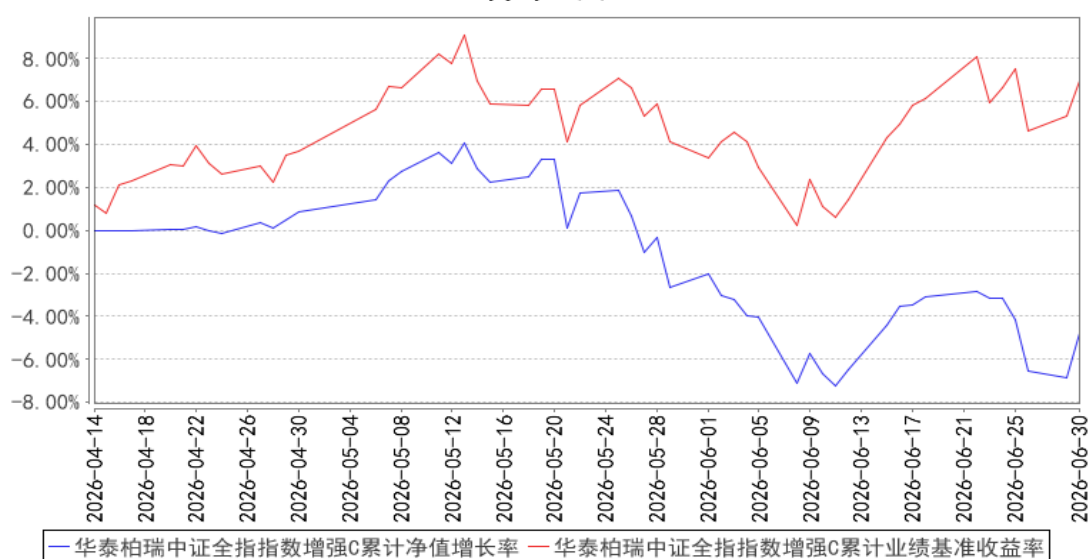
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	-4.80%	1.11%	6.98%	1.24%	-11.78%	-0.13%

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

华泰柏瑞中证全指指数增强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



华泰柏瑞中证全指指数增强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4月14日（基金合同生效日）至2026年6月30日。C类图示日期为2026年4月14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		
孔令焯	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2026 年 4 月 14 日	-	11 年	英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份有限公司高级分析师。2017 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022 年 8 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
雷文渊	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2026 年 4 月 14 日	-	7 年	复旦大学数学专业本科、金融专业硕士。2018 年 7 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。2022 年 8 月至 2026 年 1 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

					2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 股市场整体呈震荡上行态势，指数重心稳步抬升，但板块间分化显著，市场结构轮动加快。年初，商业航天、有色金属、化工等板块领涨，市场风险偏好明显回升；此后

受地缘冲突事件扰动，市场短期承压，但随着情绪修复，股指迅速反弹并创出阶段新高。进入二季度，伴随 AI 产业链一季报景气度验证，行情主线逐步向光通信、半导体等科技成长板块切换，算力、光模块等细分领域持续走强，推动创业板指与科创 50 大幅跑赢全市场。交易层面，市场日均成交额一度放大至历史新高，此后稳定维持在 3 万亿以上的较高水平，显示资金参与热情持续高涨，但板块间资金流向不平衡。AI 相关产业链持续获得增量资金青睐，而传统行业则面临明显资金流出，股价与流动性分化加剧，市场交易拥挤度亦呈结构性抬升。

本报告期，代表大盘价值风格的上证 50 小幅回调，下跌 1.38%；沪深 300 则在权重股支撑下上涨 7.55%。成长风格表现尤为突出，创业板指和科创 50 分别上涨 35.58%和 64.25%，显著领跑全市场。中小市值方面，中证 1000 和中证 2000 亦分别录得 15.99%和 9.10%的涨幅，呈现大中盘成长明显跑赢小盘与大盘价值、双创板块表现大幅优于全市场的格局。

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略，股票仓位保持在较高水平，超额收益受仓位影响相对较小。

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全指指数增强 A 的基金份额净值为 0.9524 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.76%，同期业绩比较基准收益率为 6.98%，截至本报告期末华泰柏瑞中证全指指数增强 C 的基金份额净值为 0.9520 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.80%，同期业绩比较基准收益率为 6.98%。

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 2026 年三季度，我们认为短期市场乐观情绪和预期将随着中报验证逐步修正，板块间的极致分化将有一定程度修复，由乐观情绪驱动的跟风资金与被市场分化挤压的调仓资金将面临波动率扩大，前期持续上涨的高拥挤度板块将出现分化。随着改革政策变得更加积极，新兴产业稳步发展，在股票市场整体估值处在合理区间的前提下，市场中长期仍有上涨空间。从行情发展的历史经验总结来看，在流动性保持充裕的前提下，市场风格有可能从估值提升逐渐偏向盈利增长驱动，业绩兑现不达预期的板块可能出现一定波动，板块间分化可能较为显著。

虽然贸易冲突、地缘政治等风险因素可能将长期存在，但我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力，相信新质生产力的长期优势。在不出现极端情况的前提下，我们对未来几个季度的 A 股股票市场持谨慎乐观的态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，当前市场呈现风格轮动加快、板块分化加剧的特征。在此环境下，兼具主题热度与基本面优秀的股票更容易受到资金的青睐，技术面因子亦可借助捕捉资金流向特征，有效获取超额收益。与此同时，基本面因子持续筛选出估值合理、业绩优异且具备良好成长性的标

的，为模型提供了较强的稳定性支撑。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，经济基本面向好。我们在坚持控制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的超额收益。

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，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人的投资运作进行了监督，对基金净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真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，认为其真实、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：华泰柏瑞中证全指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	7,024,674.45
结算备付金		17,961.60
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	99,441,144.28
其中：股票投资		99,441,144.28
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		34,599.63
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		106,518,379.96
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		1,381,398.03

应付管理人报酬		75,252.41
应付托管费		9,406.58
应付销售服务费		7,677.61
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	42,133.10
负债合计		1,515,867.73
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	110,267,526.65
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-5,265,014.42
净资产合计		105,002,512.23
负债和净资产总计		106,518,379.96

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 110,267,526.65 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.9524 元，基金份额总额 64,540,254.44 份；下属 C 类基金份额净值 0.9520 元，基金份额总额 45,727,272.21 份。

2、本基金基金合同生效日为 2026 年 4 月 14 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 4 月 14 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：华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 14 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 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,515,069.70
1. 利息收入		105,100.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	56,275.79
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		48,824.39
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,399,229.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,832,908.04
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	566,321.83
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	-8,037,095.57
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	17,695.82
减：二、营业总支出		433,072.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	313,116.96
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,139.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	38,734.30
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		2.66
8. 其他费用	6.4.7.23	42,079.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,948,142.56
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,948,142.56
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-2,948,142.56

注：本基金基金合同生效日为 2026 年 4 月 14 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 4 月 14 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：华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 14 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 4 月 14 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	262,344,804.39	-	-	262,344,804.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 152,077,277.74	-	-5,265,014.42	-157,342,292.16
(一)、综合收益总额	-	-	-2,948,142.56	-2,948,142.56
(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)	- 152,077,277.74	-	-2,316,871.86	-154,394,149.60
其中：1. 基金申购款	7,921,805.61	-	65,935.61	7,987,741.22
2. 基金赎回款	- 159,999,083.35	-	-2,382,807.47	-162,381,890.82
(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	110,267,526.65	-	-5,265,014.42	105,002,512.23

注：本基金基金合同生效日为 2026 年 4 月 14 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 4 月 14 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：

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

华泰柏瑞中证全指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[2026]5号《关于准予华泰柏瑞中证全指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《华泰柏瑞中证全指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262,319,472.02元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2026)验字第70025451_B04号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》于2026年4月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为262,344,804.39份基金份额,其中认购资金利息折合25,332.37份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中泰证券股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。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《华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金资产投资于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、北京证券交易所股票及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、存托凭证、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)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、国债期货、股票期权等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款(包括定期

存款、协议存款、通知存款等)、资产支持证券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的相关规定)。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。本基金的投资组合比例为:投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的资产不低于非现金基金资产的 80%;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,现金或到期日在一年以内的政府债券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:中证全指指数收益率 $\times$ 95%+人民币活期存款税后利率 $\times$ 5%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 04 月 14 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 04 月 14 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 04 月 14 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 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[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	7,024,674.45
等于：本金	7,023,558.74
加：应计利息	1,115.71
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	7,024,674.45

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	107,478,239.85	-	99,441,144.28	-8,037,095.57
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		107,478,239.85	-	99,441,144.28	-8,037,095.57

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

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	41,679.30
其他应付款	453.80
合计	42,133.10

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证全指指数增强 A

项目	本期 2026 年 4 月 14 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	119,905,515.49	119,905,515.49
本期申购	3,536,842.01	3,536,842.01
本期赎回（以“-”号填列）	-58,902,103.06	-58,902,103.06
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	64,540,254.44	64,540,254.44

华泰柏瑞中证全指指数增强 C

项目	本期 2026 年 4 月 14 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	142,439,288.90	142,439,288.90

本期申购	4,384,963.60	4,384,963.60
本期赎回（以“-”号填列）	-101,096,980.29	-101,096,980.29
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	45,727,272.21	45,727,272.21

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 3 月 23 日至 2026 年 4 月 10 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 262,319,472.02 元，折合为 262,319,472.02 份基金份额（其中 A 类基金份额 119,893,308.80 份，C 类基金份额 142,426,163.22 份）。根据《华泰柏瑞中证全指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 25,332.37 元在本基金成立后，折合为 25,332.37 份基金份额（其中 A 类基金份额 12,206.69 份，C 类基金份额 13,125.68 份），划入基金份额持有人账户。

3、根据《华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》及《华泰柏瑞中证全指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 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 5 月 14 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自 2026 年 5 月 15 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

华泰柏瑞中证全指指数增强 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	2,255,593.51	-4,753,399.55	-2,497,806.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,287,616.29	715,459.18	-572,157.11
其中：基金申购款	95,426.46	-70,051.58	25,374.88
基金赎回款	-1,383,042.75	785,510.76	-597,531.99
本期已分配利润	-	-	-

本期末	967,977.22	-4,037,940.37	-3,069,963.15
-----	------------	---------------	---------------

华泰柏瑞中证全指指数增强 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	2,833,359.50	-3,283,696.02	-450,336.52
本期基金份额交易产生的变动数	-2,168,288.89	423,574.14	-1,744,714.75
其中：基金申购款	109,455.32	-68,894.59	40,560.73
基金赎回款	-2,277,744.21	492,468.73	-1,785,275.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	665,070.61	-2,860,121.88	-2,195,051.27

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,314.19
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	17,961.60
其他	-
合计	56,275.79

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4月14日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,832,908.04
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,832,908.04

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 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	319,134,509.62
减：卖出股票成本总额	313,946,456.81
减：交易费用	355,144.77
买卖股票差价收入	4,832,908.04

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 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	566,321.83
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	566,321.83

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 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,037,095.57
股票投资	-8,037,095.57
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	—
权证投资	—
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	-8,037,095.57

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	17,659.97
基金转换费收入	35.85
合计	17,695.82

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,885.52
信息披露费	26,793.78
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	42,079.30

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构

中泰证券股份有限公司(“中泰证券”)	基金托管人、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

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 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	313,116.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	130,781.68
应支付基金管理人的净管理费	182,335.28

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 14 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	39,139.64

注：支付基金托管人中泰证券的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%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×0.1%÷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 4 月 14 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		
	华泰柏瑞中证全指指数 增强 A	华泰柏瑞中证全指指数 增强 C	合计
中泰证券股份有限公司	-	14,598.53	14,598.53
合计	-	14,598.53	14,598.53

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 0.2%的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	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
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	10.11	10.11	3,807	38,488.77	38,488.77	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,631	16,489.41	16,489.41	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	10.12	27.73	623	6,304.76	17,275.79	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	44.56	468.67	46	2,049.76	21,558.82	-

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
300214	日科化学	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	10.25	2026 年 7 月 13 日	12.30	32,300	285,839.60	331,075.00	-

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 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	7,024,674.45	-	-	-	-	-	7,024,674.45
结算备付金	17,961.60	-	-	-	-	-	17,961.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-99,441,144.28	99,441,144.28
应收申购款	-	-	-	-	-	34,599.63	34,599.63
资产总计	7,042,636.05	-	-	-	-	-99,475,743.91	106,518,379.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,381,398.03	1,381,398.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	75,252.41	75,252.41
应付托管费	-	-	-	-	-	9,406.58	9,406.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,677.61	7,677.61
其他负债	-	-	-	-	-	42,133.10	42,133.10
负债总计	-	-	-	-	-	1,515,867.73	1,515,867.73
利率敏感度缺口	7,042,636.05	-	-	-	-	-97,959,876.18	105,002,512.23

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	99,441,144.28	94.70
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	99,441,144.28	94.70

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%	3,076,306.53
	业绩比较基准下降 5%	-3,076,306.53

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	99,016,256.49
第二层次	386,053.18
第三层次	38,834.61
合计	99,441,144.28

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	99,441,144.28	93.36
	其中：股票	99,441,144.28	93.36
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,042,636.05	6.61
8	其他各项资产	34,599.63	0.03
9	合计	106,518,379.96	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	451,838.00	0.43
B	采矿业	3,024,352.60	2.88
C	制造业	70,043,177.60	66.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,938,490.18	1.85
E	建筑业	1,685,826.00	1.61
F	批发和零售业	2,488,254.90	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,666,942.00	1.59
H	住宿和餐饮业	204,536.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,848,857.30	7.47
J	金融业	3,709,207.60	3.53
K	房地产业	853,990.00	0.81
L	租赁和商务服务业	376,472.80	0.36
M	科学研究和技术服务业	2,718,759.00	2.59
N	水利、环境和公共设施管理业	1,575,538.30	1.50
O	居民服务、修理和其他服务业	9,300.00	0.01
P	教育	257,888.00	0.25
Q	卫生和社会工作	11,470.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	576,244.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	99,441,144.28	94.70

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	688536	思瑞浦	2,200	800,998.00	0.76
2	688220	翱捷科技	5,400	671,328.00	0.64
3	300483	首华燃气	34,600	608,268.00	0.58
4	688202	美迪西	7,200	581,112.00	0.55
5	001339	智微智能	5,590	571,745.20	0.54
6	301095	广立微	4,800	566,640.00	0.54
7	301365	矩阵股份	14,600	553,486.00	0.53
8	601939	建设银行	56,500	544,095.00	0.52
9	002079	苏州固锝	36,100	542,583.00	0.52
10	301371	敷尔佳	20,500	533,000.00	0.51
11	300681	英搏尔	17,200	492,264.00	0.47
12	300661	圣邦股份	3,400	487,832.00	0.46
13	603826	坤彩科技	19,000	485,640.00	0.46
14	002833	弘亚数控	24,900	480,321.00	0.46
15	688390	固德威	4,400	477,444.00	0.45
16	002432	九安医疗	6,700	473,556.00	0.45
17	603175	超颖电子	5,300	472,177.00	0.45
18	002990	盛视科技	5,900	466,100.00	0.44
19	300438	鹏辉能源	5,600	463,960.00	0.44
20	301193	家联科技	25,000	463,500.00	0.44
21	601988	中国银行	80,600	461,032.00	0.44
22	688275	万润新能	3,600	459,180.00	0.44
23	002810	山东赫达	18,400	454,480.00	0.43
24	301081	严牌股份	31,500	430,920.00	0.41
25	300992	泰福泵业	17,100	426,303.00	0.41
26	002966	苏州银行	61,000	424,560.00	0.40
27	002803	吉宏股份	16,400	423,776.00	0.40
28	300223	北京君正	1,700	423,130.00	0.40
29	300656	民德电子	10,800	411,372.00	0.39
30	688110	东芯股份	2,008	409,029.60	0.39
31	002668	TCL 智家	36,500	404,420.00	0.39
32	688226	威腾电气	9,400	402,602.00	0.38
33	688103	国力电子	5,400	401,814.00	0.38
34	600872	中炬高新	23,100	401,016.00	0.38
35	300763	锦浪科技	4,400	397,540.00	0.38
36	603127	昭衍新药	10,100	386,022.00	0.37
37	300953	震裕科技	2,880	385,056.00	0.37
38	301307	美利信	5,100	383,979.00	0.37
39	300609	汇纳科技	11,700	367,614.00	0.35

40	600971	恒源煤电	53,000	365,700.00	0.35
41	001212	中旗新材	7,600	360,088.00	0.34
42	301479	弘景光电	5,960	358,792.00	0.34
43	300568	星源材质	19,000	355,680.00	0.34
44	301321	翰博高新	8,000	353,200.00	0.34
45	002460	赣锋锂业	5,400	353,160.00	0.34
46	688097	博众精工	5,600	353,080.00	0.34
47	600149	廊坊发展	78,400	352,016.00	0.34
48	002246	北化股份	18,700	351,560.00	0.33
49	301510	固高科技	11,000	351,230.00	0.33
50	300073	当升科技	7,300	350,692.00	0.33
51	301316	慧博云通	8,900	350,482.00	0.33
52	603042	华脉科技	24,270	349,488.00	0.33
53	601699	潞安环能	24,200	345,576.00	0.33
54	688717	艾罗能源	4,136	341,509.52	0.33
55	001314	亿道信息	5,500	339,900.00	0.32
56	300154	瑞凌股份	44,900	337,648.00	0.32
57	001313	粤海饲料	47,500	336,775.00	0.32
58	605208	永茂泰	21,100	336,545.00	0.32
59	002566	益盛药业	55,200	333,408.00	0.32
60	300943	春晖智控	7,400	332,630.00	0.32
61	605007	五洲特纸	24,800	332,072.00	0.32
62	300214	日科化学	32,300	331,075.00	0.32
63	301393	昊帆生物	5,100	330,327.00	0.31
64	000776	广发证券	13,600	318,240.00	0.30
65	002216	三全食品	27,600	318,228.00	0.30
66	600502	安徽建工	72,500	315,375.00	0.30
67	603198	迎驾贡酒	10,600	313,760.00	0.30
68	300432	富临精工	15,600	313,404.00	0.30
68	688759	必贝特	9,800	313,404.00	0.30
69	300765	石药创新	11,500	313,145.00	0.30
70	600641	先导基电	7,800	310,908.00	0.30
71	300448	浩云科技	53,800	309,888.00	0.30
72	300901	中胤时尚	20,900	308,693.00	0.29
73	001289	龙源电力	19,400	303,222.00	0.29
74	301317	鑫磊股份	5,400	303,048.00	0.29
75	688797	臻宝科技	453	302,433.59	0.29
76	603320	迪贝电气	17,300	301,885.00	0.29
77	300786	国林科技	12,000	300,840.00	0.29
78	300696	爱乐达	11,500	299,345.00	0.29
79	301396	宏景科技	900	298,440.00	0.28
80	300731	科创新源	5,100	297,636.00	0.28
81	300536	农尚环境	35,000	297,150.00	0.28

82	000599	青岛双星	70,300	296,666.00	0.28
83	600919	江苏银行	27,500	296,450.00	0.28
84	300583	赛托生物	26,300	295,349.00	0.28
85	002970	锐明技术	5,500	293,865.00	0.28
86	301326	捷邦科技	2,100	292,677.00	0.28
87	300814	中富电路	1,400	286,300.00	0.27
88	600051	宁波联合	50,800	286,004.00	0.27
89	002293	罗莱生活	28,900	285,821.00	0.27
90	603701	德宏股份	13,000	285,740.00	0.27
91	002061	浙江交科	86,000	283,800.00	0.27
92	002396	星网锐捷	14,790	283,524.30	0.27
93	002738	中矿资源	4,800	283,152.00	0.27
94	002111	威海广泰	31,400	282,600.00	0.27
95	601677	明泰铝业	17,000	282,200.00	0.27
96	601579	会稽山	19,200	282,048.00	0.27
97	300745	欣锐科技	6,600	278,652.00	0.27
98	300424	航新科技	17,700	278,598.00	0.27
99	002284	亚太股份	29,300	278,057.00	0.26
100	601882	海天精工	13,700	277,151.00	0.26
101	300606	金太阳	6,500	276,640.00	0.26
102	002154	报喜鸟	77,500	275,900.00	0.26
103	300137	先河环保	15,800	275,552.00	0.26
104	300955	嘉亨家化	7,600	274,284.00	0.26
105	002092	中泰化学	71,600	274,228.00	0.26
106	300128	锦富技术	46,300	274,096.00	0.26
107	002379	宏桥控股	18,500	273,245.00	0.26
108	300086	康芝药业	46,200	272,580.00	0.26
109	300106	西部牧业	27,700	272,568.00	0.26
110	002695	煌上煌	26,700	271,005.00	0.26
111	301162	国能日新	6,100	266,875.00	0.25
112	002025	航天电器	3,500	266,770.00	0.25
113	600123	兰花科创	49,800	265,932.00	0.25
114	688503	聚和材料	2,000	265,400.00	0.25
115	601107	四川成渝	54,000	263,520.00	0.25
116	002727	一心堂	27,300	261,807.00	0.25
117	000802	北京文化	74,500	259,260.00	0.25
118	002245	蔚蓝锂芯	13,800	258,198.00	0.25
119	002357	富临运业	28,900	257,210.00	0.24
120	000408	藏格矿业	3,700	256,484.00	0.24
121	002615	哈尔斯	36,800	253,920.00	0.24
122	600449	宁夏建材	22,700	253,786.00	0.24
123	688516	奥特维	4,400	252,516.00	0.24
124	300461	田中精机	6,800	251,872.00	0.24

125	002541	鸿路钢构	14,500	251,140.00	0.24
126	600489	中金黄金	13,900	250,895.00	0.24
127	688700	东威科技	2,800	250,320.00	0.24
128	600500	中化国际	31,800	248,994.00	0.24
129	300587	天铁科技	64,600	248,710.00	0.24
130	002917	金奥博	23,400	246,636.00	0.23
131	688131	皓元医药	2,600	245,960.00	0.23
132	301093	华兰股份	1,800	244,134.00	0.23
133	003010	若羽臣	10,000	243,000.00	0.23
134	301018	申菱环境	2,100	242,781.00	0.23
135	601328	交通银行	37,700	242,411.00	0.23
136	002518	科士达	4,500	241,155.00	0.23
137	603668	天马科技	18,800	238,008.00	0.23
138	002022	科华生物	51,700	236,786.00	0.23
139	002458	益生股份	30,400	236,208.00	0.22
140	002545	东方铁塔	14,500	235,190.00	0.22
141	001358	兴欣新材	9,100	235,144.00	0.22
142	301389	隆扬电子	2,700	234,333.00	0.22
143	002382	蓝帆医疗	45,800	232,664.00	0.22
144	600661	昂立教育	33,200	229,412.00	0.22
145	603010	万盛股份	12,600	228,312.00	0.22
146	001376	百通能源	21,800	226,720.00	0.22
147	002497	雅化集团	11,100	226,107.00	0.22
148	002802	洪汇新材	21,400	225,128.00	0.21
149	600999	招商证券	10,500	221,550.00	0.21
150	603458	勘设股份	15,300	221,085.00	0.21
151	300006	莱美药业	43,000	220,590.00	0.21
152	601700	风范股份	50,200	218,872.00	0.21
153	300013	新宁物流	55,900	218,010.00	0.21
154	603929	亚翔集成	800	217,616.00	0.21
155	300084	海默科技	17,900	215,337.00	0.21
156	688141	杰华特	1,400	214,900.00	0.20
157	600885	宏发股份	6,200	213,838.00	0.20
158	301130	西点药业	8,900	213,422.00	0.20
159	001300	三柏硕	18,800	212,440.00	0.20
160	300617	安靠智电	4,000	211,960.00	0.20
161	001872	招商港口	10,900	211,787.00	0.20
162	600844	金煤科技	87,500	211,750.00	0.20
163	301012	扬电科技	8,800	206,712.00	0.20
164	603063	禾望电气	3,900	206,271.00	0.20
165	601918	新集能源	24,000	206,160.00	0.20
166	688099	晶晨股份	2,000	205,800.00	0.20
167	001301	尚太科技	2,200	205,722.00	0.20

168	688213	思特威	1,920	205,574.40	0.20
169	002531	天顺风能	24,300	204,849.00	0.20
170	001378	德冠新材	11,320	202,741.20	0.19
171	301529	福赛科技	2,100	202,356.00	0.19
172	600926	杭州银行	14,000	202,300.00	0.19
173	600963	岳阳林纸	66,400	201,856.00	0.19
174	603285	键邦股份	4,500	201,645.00	0.19
175	301248	杰创智能	2,400	201,432.00	0.19
176	603345	安井食品	2,500	200,475.00	0.19
177	301205	联特科技	600	200,460.00	0.19
178	603016	新宏泰	5,900	199,184.00	0.19
179	603915	国茂股份	14,000	198,660.00	0.19
180	688359	三孚新科	1,000	198,440.00	0.19
181	301489	思泉新材	1,200	197,496.00	0.19
182	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.19
183	000534	万泽股份	7,200	196,992.00	0.19
184	601872	招商轮船	11,200	196,784.00	0.19
185	605020	永和股份	4,800	195,456.00	0.19
186	002495	佳隆股份	95,200	195,160.00	0.19
187	002136	安纳达	14,900	194,892.00	0.19
188	688090	瑞松科技	1,820	193,739.00	0.18
189	601199	江南水务	34,500	191,130.00	0.18
190	002947	恒铭达	2,500	190,125.00	0.18
191	001389	广合科技	800	189,800.00	0.18
192	002850	科达利	1,000	189,300.00	0.18
193	002235	安妮股份	24,400	189,100.00	0.18
194	301111	粤万年青	7,300	188,924.00	0.18
195	001256	炜冈科技	6,900	188,301.00	0.18
196	603937	丽岛新材	13,400	187,868.00	0.18
197	688218	江苏北人	3,400	186,864.00	0.18
198	300169	天晟新材	37,400	186,626.00	0.18
199	600135	乐凯胶片	23,300	186,167.00	0.18
200	688372	伟测科技	1,000	186,000.00	0.18
201	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.18
202	002394	联发股份	20,800	185,536.00	0.18
203	002397	梦洁股份	48,400	184,888.00	0.18
204	000628	高新发展	3,900	184,860.00	0.18
205	603660	苏州科达	15,000	183,750.00	0.17
206	002099	海翔药业	34,700	183,216.00	0.17
207	002916	深南电路	400	183,160.00	0.17
208	600230	沧州大化	14,000	182,280.00	0.17
209	603558	健盛集团	16,400	181,876.00	0.17
210	002319	乐通股份	17,600	181,632.00	0.17

211	603968	醋化股份	19,600	181,496.00	0.17
212	605117	德业股份	1,700	180,506.00	0.17
213	000573	粤宏远 A	50,900	180,186.00	0.17
214	000428	华天酒店	58,900	179,056.00	0.17
215	300022	吉峰科技	23,000	178,710.00	0.17
216	300740	水羊股份	9,600	176,736.00	0.17
217	603188	亚邦股份	44,600	176,616.00	0.17
218	300473	德尔股份	5,800	176,320.00	0.17
219	002861	瀛通通讯	7,900	176,012.00	0.17
220	600150	中国船舶	5,200	175,708.00	0.17
221	002885	京泉华	4,300	175,698.00	0.17
222	600250	南京商旅	22,700	175,017.00	0.17
223	688246	嘉和美康	8,474	174,140.70	0.17
224	300840	酷特智能	8,400	173,292.00	0.17
225	300853	申昊科技	5,600	172,984.00	0.16
226	002979	雷赛智能	3,100	172,918.00	0.16
227	300351	永贵电器	10,400	171,600.00	0.16
228	301048	金鹰重工	19,900	171,339.00	0.16
229	002247	聚力文化	79,900	168,589.00	0.16
230	002120	韵达股份	26,500	168,540.00	0.16
231	603121	华培动力	14,300	168,025.00	0.16
232	002353	杰瑞股份	1,100	167,750.00	0.16
233	688388	嘉元科技	3,805	167,420.00	0.16
234	002273	水晶光电	4,700	166,756.00	0.16
235	000825	太钢不锈	48,900	166,749.00	0.16
236	603980	吉华集团	25,000	166,000.00	0.16
237	300693	盛弘股份	3,400	165,750.00	0.16
238	300518	新迅达	5,000	165,250.00	0.16
239	000036	华联控股	37,800	165,186.00	0.16
240	002685	华东重机	25,300	163,438.00	0.16
241	688156	路德科技	5,400	163,350.00	0.16
242	300521	爱司凯	5,900	162,840.00	0.16
243	605376	博迁新材	600	162,780.00	0.16
244	002283	天润工业	16,800	162,120.00	0.15
245	000848	承德露露	21,800	161,320.00	0.15
246	301040	中环海陆	6,600	160,842.00	0.15
247	605088	冠盛股份	5,700	160,626.00	0.15
248	688307	中润光学	2,000	159,900.00	0.15
249	000790	华神科技	45,800	159,842.00	0.15
250	300277	汽轮科技	10,600	159,424.00	0.15
251	003023	彩虹集团	8,200	159,408.00	0.15
252	688556	高测股份	12,000	159,360.00	0.15
253	688800	瑞可达	1,640	157,390.80	0.15

254	603393	新天然气	7,300	156,293.00	0.15
255	301172	君逸数码	6,000	155,700.00	0.15
256	301536	星辰科技	1,200	154,452.00	0.15
257	688433	华曙高科	1,800	154,080.00	0.15
258	688328	深科达	1,600	153,120.00	0.15
259	002840	华统股份	20,900	152,361.00	0.15
260	603216	梦天家居	7,400	152,218.00	0.14
261	688379	华光新材	1,798	151,085.94	0.14
262	301658	首航新能	5,600	151,032.00	0.14
263	600651	飞乐音响	27,000	150,930.00	0.14
264	002888	惠威科技	6,800	149,464.00	0.14
265	300429	强力新材	8,400	148,848.00	0.14
266	603863	松炘资源	12,100	148,830.00	0.14
267	300790	宇瞳光学	5,700	148,827.00	0.14
268	000039	中集集团	18,300	148,413.00	0.14
269	002787	华源控股	4,600	148,120.00	0.14
270	301382	蜂助手	3,200	147,200.00	0.14
271	000338	潍柴动力	5,400	147,150.00	0.14
272	300523	辰安科技	8,000	147,040.00	0.14
273	603315	福鞍股份	9,800	146,804.00	0.14
274	300191	潜能恒信	5,300	146,545.00	0.14
275	301086	鸿富瀚	700	146,496.00	0.14
276	002443	金洲管道	15,200	144,856.00	0.14
277	301182	凯旺科技	1,400	144,578.00	0.14
278	301290	东星医疗	5,300	144,425.00	0.14
279	600989	宝丰能源	7,100	144,343.00	0.14
280	300720	海川智能	1,500	144,300.00	0.14
281	001230	劲旅环境	9,380	144,076.80	0.14
282	301285	鸿日达	1,300	143,429.00	0.14
283	688198	佰仁医疗	1,600	142,784.00	0.14
284	002921	联诚精密	5,200	142,168.00	0.14
285	601858	中国科传	8,200	141,942.00	0.14
286	600037	歌华有线	22,600	141,702.00	0.13
287	301189	奥尼电子	2,400	141,432.00	0.13
288	003027	同兴科技	8,100	141,183.00	0.13
289	002494	华斯股份	31,700	140,748.00	0.13
290	688301	奕瑞科技	1,120	138,880.00	0.13
291	301118	恒光股份	5,100	138,873.00	0.13
292	002841	视源股份	4,000	138,120.00	0.13
293	000967	盈峰环境	13,100	137,943.00	0.13
294	600838	上海九百	19,200	137,280.00	0.13
295	300990	同飞股份	1,300	136,591.00	0.13
296	301122	采纳股份	4,600	135,286.00	0.13

297	603158	腾龙股份	11,000	134,530.00	0.13
298	600785	新华百货	13,720	134,456.00	0.13
299	300984	金沃股份	2,500	134,325.00	0.13
300	300467	迅游科技	3,600	133,848.00	0.13
301	002820	桂发祥	15,900	133,560.00	0.13
302	001211	双枪科技	5,600	133,504.00	0.13
303	300677	英科医疗	3,400	133,178.00	0.13
304	300948	冠中生态	5,000	133,150.00	0.13
305	600712	南宁百货	28,700	132,020.00	0.13
306	301302	华如科技	4,900	131,908.00	0.13
307	002338	奥普光电	2,300	131,560.00	0.13
308	000923	河钢资源	10,600	131,546.00	0.13
309	301060	兰卫医学	16,100	131,537.00	0.13
310	301201	诚达药业	3,600	130,896.00	0.12
311	002068	黑猫股份	8,700	130,761.00	0.12
312	603270	金帝股份	3,900	130,689.00	0.12
313	301265	华新科技	4,700	129,485.00	0.12
314	603960	克来机电	7,400	128,834.00	0.12
315	600683	京投发展	11,200	128,800.00	0.12
316	002034	旺能环境	8,400	127,260.00	0.12
317	301468	博盈特焊	3,020	125,964.20	0.12
318	601128	常熟银行	21,630	125,886.60	0.12
319	605166	聚合顺	13,100	125,629.00	0.12
320	000990	诚志股份	15,300	125,154.00	0.12
321	600281	华阳新材	30,500	125,050.00	0.12
322	300839	博汇股份	10,600	124,126.00	0.12
323	600929	雪天盐业	27,300	123,942.00	0.12
324	002876	三利谱	3,500	123,235.00	0.12
325	300164	通源石油	15,400	123,200.00	0.12
326	300572	安车检测	4,300	121,991.00	0.12
327	603638	艾迪精密	5,200	121,940.00	0.12
328	600704	物产中大	25,800	121,776.00	0.12
329	002905	金逸影视	18,000	121,500.00	0.12
330	002761	浙江建投	18,200	120,666.00	0.11
331	300475	香农芯创	400	120,000.00	0.11
332	600509	天富能源	14,200	119,990.00	0.11
333	301198	喜悦智行	8,900	119,260.00	0.11
334	601997	贵阳银行	23,100	118,503.00	0.11
335	600830	香溢融通	14,800	117,956.00	0.11
336	002301	齐心集团	16,300	117,849.00	0.11
337	605299	舒华体育	8,800	117,480.00	0.11
338	603057	紫燕食品	5,200	115,960.00	0.11
339	300135	宝利国际	38,000	115,900.00	0.11

340	002919	名臣健康	6,100	115,839.00	0.11
341	688052	纳芯微	400	115,324.00	0.11
342	002785	万里石	2,600	115,206.00	0.11
343	301259	艾布鲁	4,350	114,187.50	0.11
344	002824	和胜股份	3,300	114,114.00	0.11
345	300417	南华仪器	11,100	113,886.00	0.11
346	603867	新化股份	3,400	113,866.00	0.11
347	301106	骏成科技	5,460	113,240.40	0.11
348	688045	必易微	1,400	113,092.00	0.11
349	002627	三峡旅游	19,700	112,487.00	0.11
350	688609	九联科技	10,200	112,302.00	0.11
351	000598	兴蓉环境	17,400	111,708.00	0.11
352	300393	中来股份	15,200	110,808.00	0.11
353	600299	安迪苏	14,100	110,685.00	0.11
354	603229	奥翔药业	14,300	110,682.00	0.11
355	300246	宝莱特	7,800	109,746.00	0.10
356	300592	华凯易佰	6,200	109,740.00	0.10
357	002221	东华能源	20,800	109,408.00	0.10
358	300843	胜蓝股份	700	109,375.00	0.10
359	301128	强瑞技术	700	109,130.00	0.10
360	002479	富春环保	25,800	108,618.00	0.10
361	301232	飞沃科技	700	107,765.00	0.10
362	301180	万祥科技	8,600	107,758.00	0.10
363	600269	赣粤高速	27,000	107,460.00	0.10
364	002906	华阳集团	4,300	107,328.00	0.10
365	600323	瀚蓝环境	3,900	107,094.00	0.10
366	001267	汇绿生态	2,000	107,000.00	0.10
367	002746	仙坛股份	20,900	106,590.00	0.10
368	300905	宝丽迪	2,100	106,260.00	0.10
369	603777	来伊份	6,800	105,604.00	0.10
370	688319	欧林生物	2,400	105,552.00	0.10
371	300938	信测标准	2,100	104,748.00	0.10
372	603023	威帝股份	28,000	104,440.00	0.10
373	301349	信德新材	1,400	103,040.00	0.10
374	688679	通源环境	2,400	101,016.00	0.10
375	688107	安路科技	2,200	100,320.00	0.10
376	605055	迎丰股份	9,700	98,940.00	0.09
377	300828	锐新科技	4,900	98,931.00	0.09
378	605133	嵘泰股份	2,500	98,425.00	0.09
379	301571	国科天成	1,500	97,770.00	0.09
380	601225	陕西煤业	4,800	97,680.00	0.09
381	601398	工商银行	13,800	97,566.00	0.09
382	300257	开山股份	3,400	97,512.00	0.09

383	001324	长青科技	5,300	97,414.00	0.09
384	603615	茶花股份	6,000	96,900.00	0.09
385	301031	中熔电气	800	95,560.00	0.09
386	603697	有友食品	9,800	93,982.00	0.09
387	000938	紫光股份	3,200	92,352.00	0.09
388	000426	兴业银锡	2,800	92,288.00	0.09
389	600026	中远海能	5,100	91,494.00	0.09
390	688428	诺诚健华	3,200	91,104.00	0.09
391	688500	慧辰股份	2,000	90,660.00	0.09
392	301066	万事利	7,800	90,558.00	0.09
393	300593	新雷能	3,000	90,180.00	0.09
394	600513	联环药业	6,200	90,148.00	0.09
395	002008	大族激光	600	90,066.00	0.09
396	000629	钒钛股份	26,900	89,846.00	0.09
397	002628	成都路桥	16,700	89,345.00	0.09
398	605228	神通科技	6,600	88,638.00	0.08
399	301372	科净源	2,800	88,228.00	0.08
400	300163	先锋新材	16,500	88,110.00	0.08
401	605289	罗曼股份	600	87,000.00	0.08
402	301225	恒勃股份	1,100	86,669.00	0.08
403	688182	灿勤科技	2,000	86,140.00	0.08
404	002105	信隆健康	17,200	84,968.00	0.08
405	600594	益佰制药	28,000	83,160.00	0.08
406	002645	华宏科技	3,000	82,530.00	0.08
407	000607	华媒控股	26,700	81,969.00	0.08
408	001215	千味央厨	2,200	81,180.00	0.08
409	603283	赛腾股份	1,000	80,980.00	0.08
410	300613	富瀚微	1,000	80,080.00	0.08
411	688059	华锐精密	400	79,884.00	0.08
412	603179	新泉股份	1,600	79,440.00	0.08
413	300469	信息发展	1,500	78,915.00	0.08
414	300550	和仁科技	5,900	78,647.00	0.07
415	688253	英诺特	1,300	78,364.00	0.07
416	300863	卡倍亿	1,000	76,630.00	0.07
417	002250	联化科技	5,600	76,552.00	0.07
418	002838	道恩股份	2,500	76,550.00	0.07
419	002188	中天服务	15,600	76,440.00	0.07
420	601187	厦门银行	11,100	75,813.00	0.07
421	603400	华之杰	1,400	75,628.00	0.07
422	002264	新华都	13,400	75,576.00	0.07
423	601038	一拖股份	7,100	75,189.00	0.07
424	300585	奥联电子	4,600	75,118.00	0.07
425	603038	华立股份	4,800	74,880.00	0.07

426	600267	海正药业	7,400	74,814.00	0.07
427	300051	璎升科技	8,500	74,460.00	0.07
428	601666	平煤股份	10,400	74,360.00	0.07
429	000798	中水渔业	10,500	74,130.00	0.07
430	300935	盈建科	2,500	73,350.00	0.07
431	300565	科信技术	7,200	73,296.00	0.07
432	603051	鹿山新材	3,800	73,264.00	0.07
433	600816	建元信托	29,900	72,956.00	0.07
434	002712	思美传媒	17,400	72,210.00	0.07
435	300072	海新能科	21,100	71,740.00	0.07
436	002993	奥海科技	1,000	71,610.00	0.07
437	002862	实丰文化	5,500	70,565.00	0.07
438	600356	恒丰纸业	9,500	70,395.00	0.07
439	300580	贝斯特	3,500	70,385.00	0.07
440	300683	海特生物	2,800	70,028.00	0.07
441	600960	渤海汽车	17,300	69,719.00	0.07
442	002995	天地在线	3,900	68,952.00	0.07
443	300552	万集科技	3,000	68,550.00	0.07
444	301391	卡莱特	1,200	68,520.00	0.07
445	000919	金陵药业	11,600	67,628.00	0.06
446	688197	首药控股	2,000	66,820.00	0.06
447	301117	佳缘科技	2,860	66,781.00	0.06
448	603665	康隆达	2,600	66,586.00	0.06
449	603617	君禾股份	9,300	66,216.00	0.06
450	688331	荣昌生物	500	65,130.00	0.06
451	000059	华锦股份	17,000	63,750.00	0.06
452	603150	万朗磁塑	900	63,720.00	0.06
453	300596	利安隆	1,200	62,976.00	0.06
454	002577	雷柏科技	3,400	62,424.00	0.06
455	600538	国发股份	10,300	62,418.00	0.06
456	603373	安邦护卫	1,720	62,332.80	0.06
457	605011	杭州热电	4,000	61,840.00	0.06
458	300749	顶固集创	2,300	61,755.00	0.06
459	603992	松霖科技	1,900	61,560.00	0.06
460	603803	瑞斯康达	5,200	61,048.00	0.06
461	300157	新锦动力	16,500	60,885.00	0.06
462	300025	华星创业	14,400	60,480.00	0.06
463	603356	华菱精工	3,600	59,472.00	0.06
464	300672	国科微	200	59,000.00	0.06
465	688680	海优新材	1,400	58,800.00	0.06
466	688127	蓝特光学	600	58,560.00	0.06
467	300168	万达信息	12,700	58,293.00	0.06
468	688001	华兴源创	680	58,276.00	0.06

469	603093	南华期货	3,200	58,080.00	0.06
469	688345	博力威	1,000	58,080.00	0.06
470	301218	华是科技	1,400	57,680.00	0.05
471	300491	通合科技	1,500	57,285.00	0.05
472	600901	江苏金租	9,900	56,925.00	0.05
473	300547	川环科技	1,700	56,763.00	0.05
474	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.05
475	688091	上海谊众	1,400	56,280.00	0.05
476	600361	创新新材	15,500	55,800.00	0.05
477	603233	大参林	3,700	55,611.00	0.05
478	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.05
479	300553	集智股份	900	55,251.00	0.05
480	001248	华润新能源	5,438	54,978.18	0.05
481	603222	济民健康	6,500	54,925.00	0.05
482	300511	雪榕生物	10,900	54,827.00	0.05
483	300049	福瑞医科	1,400	54,432.00	0.05
484	688486	龙迅股份	840	53,407.20	0.05
485	002722	物产金轮	4,500	53,055.00	0.05
486	600566	济川药业	2,300	51,037.00	0.05
487	002961	瑞达期货	2,600	50,908.00	0.05
488	301196	唯科科技	400	50,168.00	0.05
489	600928	西安银行	15,300	50,031.00	0.05
490	300610	晨化股份	5,100	49,725.00	0.05
491	601838	成都银行	2,800	49,560.00	0.05
492	300591	万里马	7,300	49,129.00	0.05
493	603336	宏辉果蔬	6,200	49,104.00	0.05
494	300242	佳云科技	10,400	48,880.00	0.05
495	301252	同星科技	1,200	48,636.00	0.05
496	301085	亚康股份	800	48,488.00	0.05
497	300004	南风股份	4,800	48,480.00	0.05
498	300201	海伦哲	2,300	48,461.00	0.05
499	002899	英派斯	2,200	47,960.00	0.05
500	000933	神火股份	2,200	46,640.00	0.04
501	000807	云铝股份	2,100	46,494.00	0.04
502	688691	灿芯股份	400	46,372.00	0.04
503	002793	罗欣药业	12,000	46,080.00	0.04
504	300835	龙磁科技	200	45,898.00	0.04
505	603017	中衡设计	4,600	45,770.00	0.04
506	000034	神州数码	1,640	45,510.00	0.04
507	000333	美的集团	600	45,318.00	0.04
508	300788	中信出版	2,000	44,940.00	0.04
509	688279	峰岬科技	200	44,888.00	0.04
510	002708	光洋股份	3,400	44,846.00	0.04

511	688069	德林海	1,200	44,832.00	0.04
512	600746	江苏索普	8,400	43,932.00	0.04
513	300845	捷安高科	3,300	43,824.00	0.04
514	300862	蓝盾光电	2,100	43,764.00	0.04
515	603118	共进股份	3,600	43,596.00	0.04
516	300233	金城医药	3,500	43,400.00	0.04
517	003042	中农联合	3,500	42,525.00	0.04
518	688123	聚辰股份	200	42,520.00	0.04
519	002870	香山股份	1,100	42,394.00	0.04
520	002678	珠江钢琴	10,000	42,300.00	0.04
521	002286	保龄宝	5,000	41,250.00	0.04
522	001965	招商公路	4,500	41,220.00	0.04
523	300986	志特新材	2,400	41,160.00	0.04
524	300957	贝泰妮	1,300	40,963.00	0.04
525	603090	宏盛股份	800	40,848.00	0.04
526	301286	侨源股份	700	40,593.00	0.04
527	688180	君实生物	1,200	40,584.00	0.04
528	002998	优彩资源	6,200	40,362.00	0.04
529	300687	赛意信息	1,300	40,300.00	0.04
530	301096	百诚医药	700	40,033.00	0.04
531	301363	美好医疗	2,160	39,592.80	0.04
532	000782	恒申新材	4,900	39,592.00	0.04
533	002638	勤上股份	8,900	39,338.00	0.04
534	601218	吉鑫科技	9,100	39,130.00	0.04
535	000042	中洲控股	5,100	39,015.00	0.04
536	601519	大智慧	4,500	38,835.00	0.04
537	603190	亚通精工	1,700	38,454.00	0.04
538	301626	苏州天脉	100	38,396.00	0.04
539	300846	首都在线	1,800	38,178.00	0.04
540	603409	汇通控股	2,072	38,021.20	0.04
541	600938	中国海油	1,400	38,010.00	0.04
542	600159	大龙地产	17,000	37,570.00	0.04
543	688093	世华科技	1,000	36,900.00	0.04
544	688158	优刻得	1,000	36,760.00	0.04
545	601009	南京银行	3,700	36,593.00	0.03
546	000935	四川双马	1,400	36,526.00	0.03
547	300858	科拓生物	2,400	36,456.00	0.03
548	000897	津滨发展	21,900	36,354.00	0.03
549	000922	佳电股份	2,600	36,296.00	0.03
550	688600	皖仪科技	1,087	36,175.36	0.03
551	600572	康恩贝	8,900	34,888.00	0.03
552	603387	基蛋生物	4,600	34,776.00	0.03
553	300867	圣元环保	1,900	34,428.00	0.03

554	301075	多瑞医药	600	34,206.00	0.03
555	603421	鼎信通讯	5,500	33,825.00	0.03
556	600257	大湖股份	7,800	33,774.00	0.03
557	600663	陆家嘴	5,300	33,284.00	0.03
558	600803	新奥股份	2,100	33,180.00	0.03
559	300381	溢多利	5,900	33,158.00	0.03
560	603033	三维股份	3,300	33,132.00	0.03
561	600508	上海能源	4,480	33,017.60	0.03
562	688316	青云科技	600	32,400.00	0.03
563	301016	雷尔伟	2,300	32,131.00	0.03
564	001317	三羊马	800	31,664.00	0.03
565	300489	光智科技	100	31,195.00	0.03
566	301156	美农生物	2,860	31,088.20	0.03
567	603138	海量数据	2,200	30,910.00	0.03
568	600027	华电国际	6,900	30,705.00	0.03
569	003018	金富科技	400	30,492.00	0.03
570	000813	德展健康	9,900	29,997.00	0.03
571	000553	安道麦 A	5,600	29,960.00	0.03
572	300856	科思股份	2,800	29,848.00	0.03
573	603819	神力股份	2,600	29,770.00	0.03
574	301246	宏源药业	1,100	29,590.00	0.03
575	002468	申通快递	2,000	29,120.00	0.03
576	600605	汇通能源	1,000	28,920.00	0.03
577	301603	乔锋智能	200	28,760.00	0.03
578	600829	人民同泰	3,700	28,712.00	0.03
579	300709	精研科技	500	28,125.00	0.03
580	600883	博闻科技	4,000	28,000.00	0.03
581	000989	九芝堂	3,500	27,195.00	0.03
582	600215	派斯林	4,600	26,680.00	0.03
583	002829	星网宇达	1,500	26,340.00	0.03
584	002515	金字火腿	2,600	26,026.00	0.02
585	000572	海马汽车	7,000	25,900.00	0.02
586	301073	君亭酒店	1,400	25,480.00	0.02
587	688448	磁谷科技	400	25,424.00	0.02
588	000526	学大教育	1,000	25,380.00	0.02
589	600331	宏达股份	2,300	25,277.00	0.02
590	601789	宁波建工	6,300	25,263.00	0.02
591	600815	厦工股份	9,700	24,929.00	0.02
592	002439	启明星辰	1,900	24,035.00	0.02
593	000570	苏常柴 A	5,100	23,817.00	0.02
594	688258	卓易信息	200	23,708.00	0.02
595	002843	泰嘉股份	1,100	23,617.00	0.02
596	002755	奥赛康	1,700	23,154.00	0.02

597	300382	斯莱克	1,000	23,110.00	0.02
598	002048	宁波华翔	1,000	23,000.00	0.02
599	601163	三角轮胎	1,800	22,842.00	0.02
600	603279	景津装备	1,900	22,800.00	0.02
601	002886	沃特股份	800	22,472.00	0.02
602	300808	久量股份	1,000	22,160.00	0.02
603	300478	杭州高新	600	22,014.00	0.02
604	002266	浙富控股	4,300	21,758.00	0.02
605	605169	洪通燃气	2,400	21,336.00	0.02
606	002380	科远智慧	600	20,508.00	0.02
607	300861	美畅股份	800	20,152.00	0.02
608	001255	博菲电气	800	20,072.00	0.02
609	002929	润建股份	300	20,064.00	0.02
610	605069	正和生态	1,200	19,776.00	0.02
611	300761	立华股份	1,200	19,692.00	0.02
612	300746	汉嘉数智	1,800	19,458.00	0.02
613	300454	深信服	200	19,240.00	0.02
614	603790	雅运股份	900	19,206.00	0.02
615	688046	药康生物	760	18,392.00	0.02
616	688035	德邦科技	200	18,360.00	0.02
617	603217	元利科技	800	17,944.00	0.02
618	600976	健民集团	700	17,437.00	0.02
619	000510	新金路	700	17,388.00	0.02
620	300543	朗科智能	2,400	17,304.00	0.02
621	600359	新农开发	3,200	17,280.00	0.02
622	001399	惠科股份	623	17,275.79	0.02
623	002591	恒大高新	2,800	17,136.00	0.02
624	600018	上港集团	3,600	16,992.00	0.02
625	603333	福华尚纬	2,100	16,926.00	0.02
626	601298	青岛港	2,100	16,905.00	0.02
627	002873	新天药业	2,300	16,836.00	0.02
628	000543	皖能电力	2,200	16,654.00	0.02
629	002062	宏润建设	2,300	16,468.00	0.02
630	002016	世荣兆业	4,100	16,400.00	0.02
631	300323	华灿光电	800	16,320.00	0.02
632	600020	中原高速	4,400	16,236.00	0.02
633	002821	凯莱英	100	16,200.00	0.02
634	600015	华夏银行	2,500	15,975.00	0.02
635	688558	国盛智科	479	15,739.94	0.01
636	601577	长沙银行	1,800	15,678.00	0.01
637	002972	科安达	800	15,648.00	0.01
638	600708	光明地产	4,800	15,408.00	0.01
639	002440	闰土股份	1,500	15,375.00	0.01

640	000975	山金国际	900	15,300.00	0.01
641	300836	佰奥智能	200	14,798.00	0.01
642	301499	维科精密	500	14,590.00	0.01
643	000810	创维数字	1,100	14,575.00	0.01
644	002392	北京利尔	1,800	14,526.00	0.01
645	603228	景旺电子	200	14,482.00	0.01
646	605389	长龄液压	150	14,400.00	0.01
647	603682	锦和商管	1,900	14,060.00	0.01
648	000949	新乡化纤	2,200	13,948.00	0.01
649	600506	统一股份	1,000	13,890.00	0.01
650	002982	湘佳股份	1,300	13,715.00	0.01
651	603958	哈森股份	800	13,552.00	0.01
652	603880	南卫股份	1,900	13,414.00	0.01
653	002403	爱仕达	1,500	13,380.00	0.01
653	301188	力诺药包	200	13,380.00	0.01
654	300769	德方纳米	200	13,300.00	0.01
655	002159	三特索道	1,000	12,370.00	0.01
656	000906	浙商中拓	2,400	12,096.00	0.01
657	603225	新凤鸣	600	11,790.00	0.01
658	300961	深水海纳	900	11,565.00	0.01
659	600327	大东方	3,700	11,470.00	0.01
660	002798	帝欧水华	2,200	10,978.00	0.01
661	600156	华升股份	1,300	10,816.00	0.01
662	603211	晋拓股份	300	10,653.00	0.01
663	002571	德力股份	1,000	10,310.00	0.01
664	600100	同方股份	1,500	10,275.00	0.01
665	600448	华纺股份	4,000	10,080.00	0.01
666	002976	瑞玛精密	390	9,828.00	0.01
667	000676	智度股份	1,900	9,709.00	0.01
668	601360	三六零	1,100	9,559.00	0.01
669	600320	振华重工	2,300	9,499.00	0.01
670	300736	百邦科技	300	9,300.00	0.01
671	301071	力量钻石	100	9,250.00	0.01
672	301662	宏工科技	90	9,118.80	0.01
673	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.01
674	301580	爱迪特	140	9,006.20	0.01
675	603026	石大胜华	100	8,937.00	0.01
676	300775	三角防务	400	8,816.00	0.01
677	300426	华智数媒	1,700	8,602.00	0.01
678	300440	运达科技	400	8,532.00	0.01
679	002923	润都股份	900	8,514.00	0.01
680	601963	重庆银行	800	8,064.00	0.01
681	603022	新通联	1,000	7,990.00	0.01

682	603122	合富中国	700	7,672.00	0.01
683	002466	天齐锂业	123	7,542.36	0.01
684	688006	杭可科技	204	7,456.20	0.01
685	003816	中国广核	1,900	7,429.00	0.01
686	000958	电投产融	1,300	7,332.00	0.01
687	601995	中金公司	200	7,230.00	0.01
688	002752	昇兴股份	1,300	7,176.00	0.01
689	688663	新风光	80	7,076.80	0.01
690	600201	生物股份	600	6,990.00	0.01
691	603110	东方材料	300	6,951.00	0.01
692	603977	国泰集团	400	6,604.00	0.01
693	000652	泰达股份	1,900	6,479.00	0.01
694	600961	株冶集团	200	6,478.00	0.01
695	300504	天邑股份	400	6,452.00	0.01
696	300398	飞凯材料	100	6,175.00	0.01
697	002725	跃岭股份	500	6,160.00	0.01
698	001203	大中矿业	200	5,990.00	0.01
699	000626	远大控股	900	5,697.00	0.01
700	300649	杭州园林	200	5,598.00	0.01
701	300998	宁波方正	200	5,566.00	0.01
702	002757	南兴股份	300	5,415.00	0.01
703	688231	隆达股份	140	5,142.20	0.00
704	605168	三人行	100	5,064.00	0.00
705	603699	纽威股份	100	5,030.00	0.00
706	002745	木林森	400	5,020.00	0.00
707	603920	世运电路	100	4,804.00	0.00
708	603009	北特科技	100	4,797.00	0.00
709	300872	天阳科技	300	4,740.00	0.00
710	300756	金马游乐	140	4,627.00	0.00
711	300571	平治信息	100	4,566.00	0.00
712	603271	永杰新材	100	4,445.00	0.00
713	002412	汉森制药	800	4,400.00	0.00
714	600546	山煤国际	400	4,372.00	0.00
715	600694	大商股份	330	4,365.90	0.00
716	000593	德龙汇能	200	4,276.00	0.00
717	000551	创元科技	200	4,126.00	0.00
718	001282	三联锻造	200	4,076.00	0.00
719	300271	华宇软件	800	3,856.00	0.00
720	688173	希荻微	200	3,828.00	0.00
721	300517	海波重科	400	3,768.00	0.00
722	000651	格力电器	100	3,750.00	0.00
723	002663	普邦股份	2,500	3,725.00	0.00
724	002671	龙泉股份	1,000	3,710.00	0.00

725	301566	达利凯普	100	3,708.00	0.00
726	300085	银之杰	100	3,497.00	0.00
727	002795	永和智控	500	3,345.00	0.00
727	600391	航发科技	100	3,345.00	0.00
728	002180	奔图科技	200	3,272.00	0.00
729	605167	利柏特	200	3,220.00	0.00
730	002887	绿茵生态	300	3,141.00	0.00
731	300177	中海达	500	3,100.00	0.00
732	002038	双鹭药业	500	2,965.00	0.00
733	300031	宝通科技	100	2,857.00	0.00
734	300966	共同药业	100	2,751.00	0.00
735	000619	海螺新材	600	2,640.00	0.00
736	600843	上工申贝	300	2,580.00	0.00
737	600256	广汇能源	500	2,470.00	0.00
738	300564	筑博设计	200	2,402.00	0.00
739	300505	川金诺	100	2,295.00	0.00
740	002819	东方中科	100	2,235.00	0.00
741	002043	兔宝宝	200	2,216.00	0.00
742	600876	凯盛新能	300	2,208.00	0.00
743	600455	博通股份	100	2,196.00	0.00
744	002486	嘉麟杰	1,000	2,140.00	0.00
745	002083	孚日股份	200	2,098.00	0.00
746	601155	新城控股	200	2,052.00	0.00
747	000001	平安银行	200	2,010.00	0.00
748	603050	科林电气	100	1,956.00	0.00
749	300399	天利科技	100	1,908.00	0.00
750	601985	中国核电	200	1,806.00	0.00
751	603727	博迈科	100	1,706.00	0.00
752	002845	同兴达	100	1,640.00	0.00
753	600761	安徽合力	100	1,636.00	0.00
754	001311	多利科技	100	1,613.00	0.00
755	600540	新赛股份	400	1,324.00	0.00
756	002559	亚威股份	100	1,271.00	0.00
757	603586	金麒麟	100	1,239.00	0.00
758	300774	倍杰特	100	1,075.00	0.00
759	000697	炼石航空	100	1,038.00	0.00
760	001286	陕西能源	100	1,014.00	0.00
761	002053	云南能投	100	983.00	0.00
762	002607	中公教育	500	900.00	0.00
763	600108	亚盛集团	300	888.00	0.00
764	600153	建发股份	100	793.00	0.00
765	002244	滨江集团	100	760.00	0.00
766	600048	保利发展	100	463.00	0.00

767	000415	渤海租赁	100	407.00	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	002966	苏州银行	1,652,168.00	1.57
2	002559	亚威股份	1,395,139.00	1.33
3	688506	百利天恒	1,336,956.18	1.27
4	601939	建设银行	1,320,496.00	1.26
5	600150	中国船舶	1,271,501.00	1.21
6	300992	泰福泵业	1,254,210.00	1.19
7	601677	明泰铝业	1,231,255.00	1.17
8	003023	彩虹集团	1,218,241.00	1.16
9	601699	潞安环能	1,215,322.00	1.16
10	603182	嘉华股份	1,190,673.00	1.13
11	002668	TCL 智家	1,181,178.00	1.12
12	688032	禾迈股份	1,174,623.81	1.12
13	688002	睿创微纳	1,164,944.31	1.11
14	603112	华翔股份	1,164,878.00	1.11
15	600048	保利发展	1,150,030.00	1.10
16	688047	龙芯中科	1,127,071.57	1.07
17	688235	百济神州	1,123,016.16	1.07
18	300696	爱乐达	1,122,064.00	1.07
19	300214	日科化学	1,119,035.00	1.07
20	600573	惠泉啤酒	1,114,604.00	1.06

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	002559	亚威股份	1,483,050.00	1.41
2	688301	奕瑞科技	1,203,772.66	1.15
3	603112	华翔股份	1,176,480.00	1.12
4	603182	嘉华股份	1,171,970.00	1.12
5	688052	纳芯微	1,171,053.58	1.12
6	688002	睿创微纳	1,119,074.37	1.07
7	000700	模塑科技	1,102,027.00	1.05
8	688235	百济神州	1,101,313.11	1.05
9	688506	百利天恒	1,093,913.83	1.04
10	688120	华海清科	1,088,245.10	1.04
11	002966	苏州银行	1,072,088.00	1.02

12	688256	寒武纪	1,069,015.24	1.02
13	688047	龙芯中科	1,064,824.00	1.01
14	688037	芯源微	1,060,539.00	1.01
15	600573	惠泉啤酒	1,047,615.00	1.00
16	688347	华虹宏力	1,029,313.55	0.98
17	688046	药康生物	1,008,554.75	0.96
18	600048	保利发展	1,005,971.00	0.96
19	688032	禾迈股份	999,772.41	0.95
20	688001	华兴源创	992,682.11	0.95

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	421,424,696.66
卖出股票收入（成交）总额	319,134,509.62

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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，建设银行（601939）在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,599.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,599.63

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	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 中证全指 指数增强 A	962	67,089.66	13,011,006.73	20.16	51,529,247.71	79.84
华泰柏瑞 中证全指 指数增强 C	1,239	36,906.60	2,650,496.53	5.80	43,076,775.68	94.20
合计	2,156	51,144.49	15,661,503.26	14.20	94,606,023.39	85.80

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	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	0.00	0.0000
	华泰柏瑞中证全指指数增强 C	13,118.47	0.0287
	合计	13,118.47	0.0119

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	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证全指指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证全指指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证全指指数增强 A	华泰柏瑞中证全指指数增强 C
基金合同生效日 (2026 年 4 月 14 日) 基金份额总额	119,905,515.49	142,439,288.90
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,536,842.01	4,384,963.60
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	58,902,103.06	101,096,980.29
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	64,540,254.44	45,727,272.21

§ 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、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，托管人的托管业务部门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，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员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 (%)	
国投证券	3	740,468,295.70	100.00	148,085.58	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 04 月 14 日成立，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例(%)	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比 例(%)
国投证券	-	-	130,000,000.00	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	华泰柏瑞中证全指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 05 月 13 日
6	华泰柏瑞中证全指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 04 月 15 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