# 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

本基金于 2024 年 11 月 26 日根据收费方式分不同，新增 I 类份额，I 类相关指标从 2024 年 11 月 26 日开始计算。

本基金于 2024 年 12 月 13 日根据收费方式分不同，新增 Y 类份额，Y 类相关指标从 2024 年 12 月 13 日开始计算。

# §2 基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 |
| 基金主代码 | 460300 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 5 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 6,375,527,420.40 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为沪深 300ETF 的联接基金。沪深 300ETF 是主要采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数 × 95% ＋银行活期存款税后收益率 × 5% |
| 风险收益特征 | 本基金为沪深 300ETF 的联接基金，采用主要投资于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与沪深 300 指数的表现密切相关。本 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 | | | |
| 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 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 I | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 Y |
| 下属分级基金的交易代码 | 460300 | 006131 | 022699 | 022948 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,974,813,102.97 份 | 3,785,383,412.09 份 | 549,320,474.13 份 | 66,010,431.21 份 |

### 2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 510300 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 5 月 4 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2012 年 5 月 28 日 |
| 基金管理人名称 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |

### 2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 I | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 Y |
| 1.本期已实现收益 | 7,144,718.39 | 11,141,277.17 | 1,409,196.98 | 232,789.14 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2.本期利润 | -250,322,979.27 | -425,151,216.80 | -44,919,607.12 | -7,913,409.39 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1327 | -0.1184 | -0.1203 | -0.1291 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,195,748,349.66 | 4,117,592,390.72 | 609,644,781.61 | 73,395,345.30 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1119 | 1.0878 | 1.1098 | 1.1119 |

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。

## 3.2 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

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -10.83% | 1.20% | -11.88% | 1.22% | 1.05% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.19% | 1.19% | -1.92% | 1.22% | 1.73% | -0.03% |
| 过去一年 | -3.41% | 1.06% | -5.72% | 1.08% | 2.31% | -0.02% |
| 过去三年 | 23.90% | 1.06% | 17.46% | 1.09% | 6.44% | -0.03% |
| 过去五年 | -1.90% | 1.04% | -9.55% | 1.07% | 7.65% | -0.03% |
| 过去七年 | 27.85% | 1.10% | 14.26% | 1.12% | 13.59% | -0.02% |
| 过去十年 | 54.38% | 1.08% | 33.28% | 1.10% | 21.10% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 124.04% | 1.23% | 65.34% | 1.27% | 58.70% | -0.04% |

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -10.88% | 1.20% | -11.88% | 1.22% | 1.00% | -0.02% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去六个月 | -0.31% | 1.19% | -1.92% | 1.22% | 1.61% | -0.03% |
| 过去一年 | -3.65% | 1.06% | -5.72% | 1.08% | 2.07% | -0.02% |
| 过去三年 | 22.97% | 1.06% | 17.46% | 1.09% | 5.51% | -0.03% |
| 过去五年 | -3.12% | 1.04% | -9.55% | 1.07% | 6.43% | -0.03% |
| 过去七年 | 25.56% | 1.10% | 14.26% | 1.12% | 11.30% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 39.63% | 1.14% | 23.84% | 1.16% | 15.79% | -0.02% |

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 I

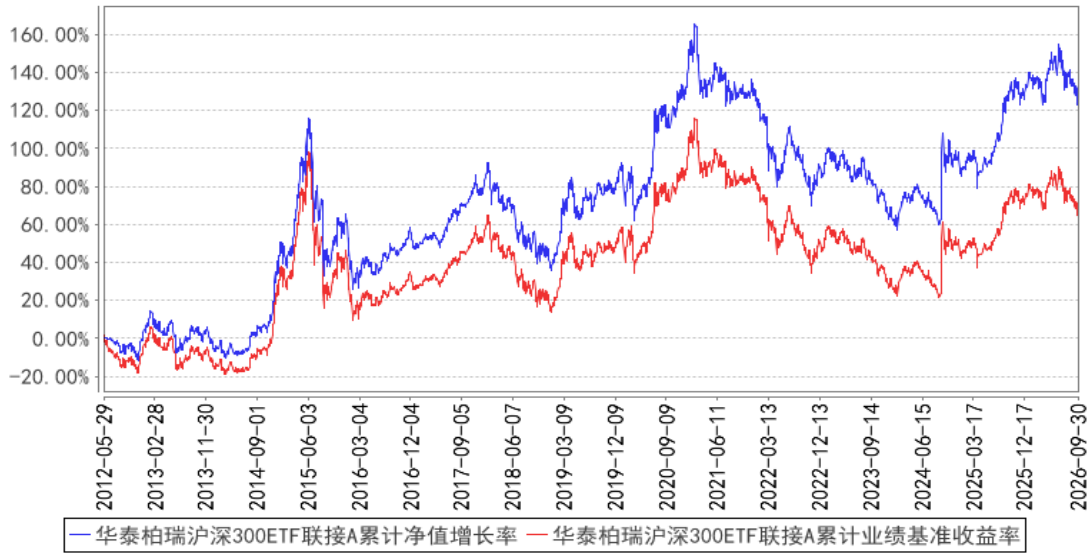
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -10.85% | 1.20% | -11.88% | 1.22% | 1.03% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.25% | 1.19% | -1.92% | 1.22% | 1.67% | -0.03% |
| 过去一年 | -3.52% | 1.06% | -5.72% | 1.08% | 2.20% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.29% | 0.99% | 12.71% | 1.00% | 4.58% | -0.01% |

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 Y

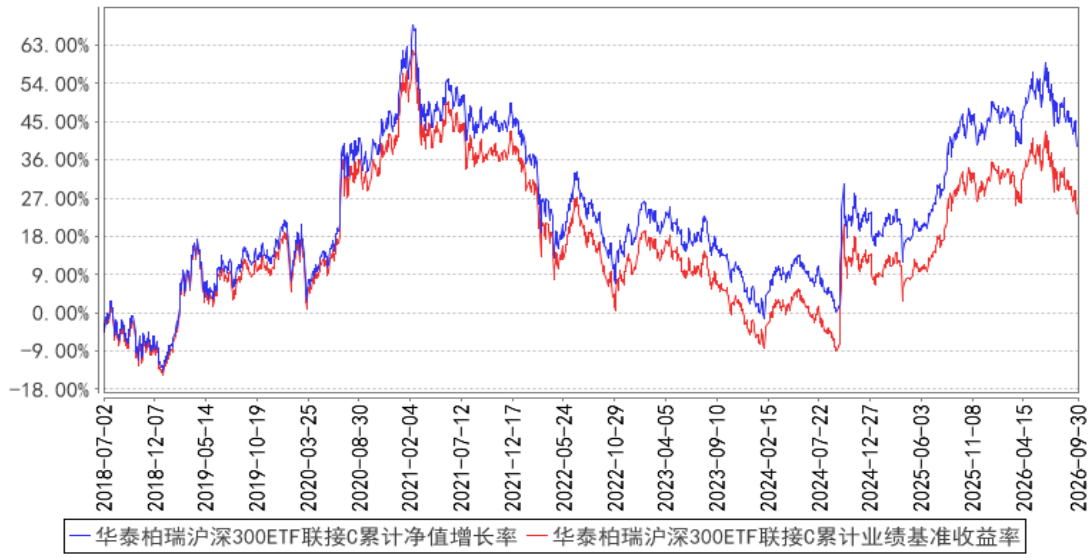
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -10.83% | 1.20% | -11.88% | 1.22% | 1.05% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.19% | 1.19% | -1.92% | 1.22% | 1.73% | -0.03% |
| 过去一年 | -3.41% | 1.06% | -5.72% | 1.08% | 2.31% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.56% | 0.99% | 7.91% | 1.01% | 4.65% | -0.02% |

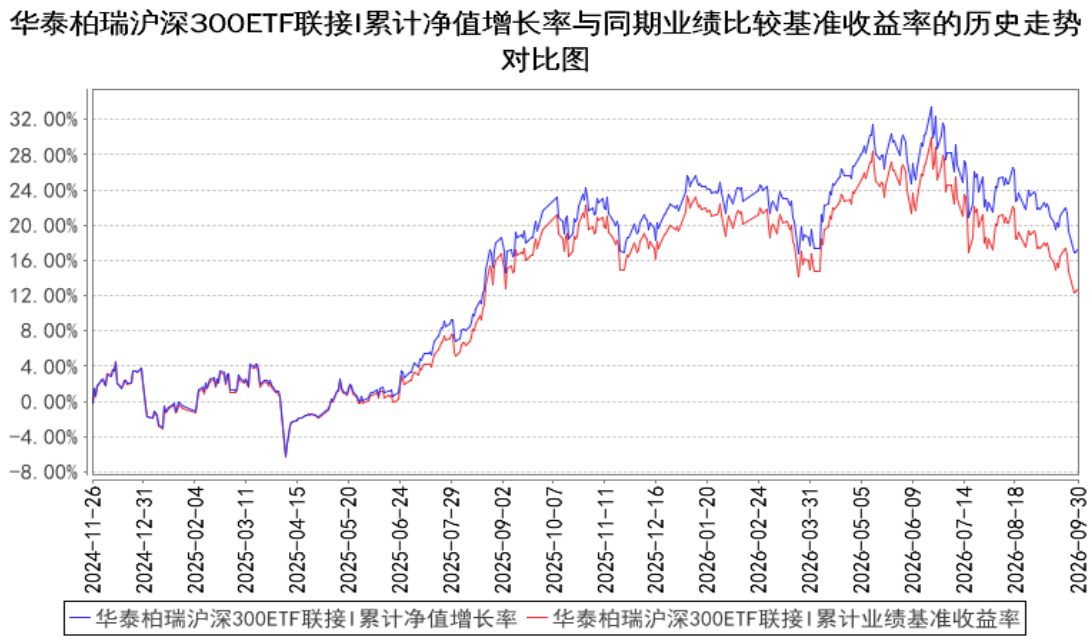
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

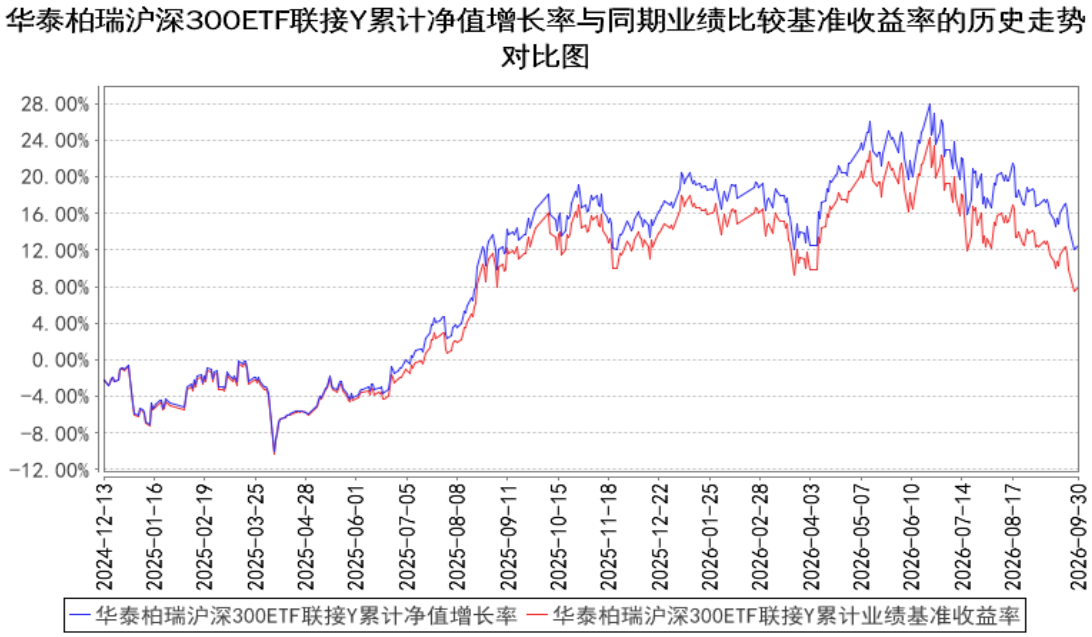
华泰柏瑞沪深300ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图




华泰柏瑞沪深300ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图






注：A 类图示日期为 2012 年 5 月 29 日至 2026 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2018 年 7 月 2 日至 2026 年 9 月 30 日。I 类图示日期为 2024 年 11 月 26 日至 2026 年 9 月 30 日。Y 类图示日期为 2024 年 12 月 13 日至 2026 年 9 月 30 日。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 柳军 | 副总经理、本基 | 2012 年 5 月 29 日 | - | 25 年 | 副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 金的基金经理 | | | | 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理，兼任华泰盈科资产管理有限公司证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 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。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、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 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 |

### 4.1.1 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遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 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中的公平交易模块，

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 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，A 股市场在内外部多重因素交织下整体走弱，主要宽基指数普遍回调，结构分化达到近年少见程度。从运行特征看，市场风险偏好较上半年明显回落，交易活跃度有所收敛，前期累积涨幅较大的成长与科技板块调整幅度居前，具备高股息与防御属性的红利类资产则逆势走强，风格切换特征鲜明。行业层面，煤炭、石油石化等资源红利方向领涨，电子、通信等硬科技方向领跌。本报告期内，本基金标的指数沪深 300 指数下跌 12.49%，区间由期初 4,979.43 点变动至期末 4,357.62 点。

展望 2026 年四季度，A 股资产走势的核心矛盾将聚焦于市场风险偏好的修复节奏与政策效果的验证。从支撑因素看，政策端保持积极，十五五开局年各项重点任务持续推进，A 股整体估值经三季度调整后已回落至历史合理偏低区间，横向对比全球主要资本市场具备一定的估值性价比与投资吸引力。同时仍需警惕潜在风险：中东地缘冲突与能源价格波动带来的通胀压力、主要经济体央行政策收紧、全球关税与贸易摩擦的不确定性，以及海外科技资产波动向境内市场传导的可能。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A 的基金份额净值为 1.1119 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.83%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%，截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C 的基金份额净值为 1.0878 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.88%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%，截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 I 的基金份额净值为 1.1098 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.85%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%，截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 Y 的基金份额净值为 1.1119 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.83%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 162,981,753.52 | 2.28 |
| | 其中：股票 | 162,981,753.52 | 2.28 |
| 2 | 基金投资 | 6,337,693,521.61 | 88.56 |
| 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 | 616,954,286.59 | 8.62 |
| 8 | 其他资产 | 38,537,645.93 | 0.54 |
| 9 | 合计 | 7,156,167,207.65 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,020,314.00 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 5,334,175.96 | 0.08 |
| C | 制造业 | 99,091,019.80 | 1.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,077,927.56 | 0.09 |
| E | 建筑业 | 2,359,322.00 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | 269,160.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,522,343.00 | 0.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,254,392.40 | 0.06 |
| J | 金融业 | 33,321,532.80 | 0.48 |
| K | 房地产业 | 874,388.00 | 0.01 |
| L | 租赁和商务服务业 | 687,970.00 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,671,684.00 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 370,272.00 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 127,252.00 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 162,981,753.52 | 2.33 |

### 5.2.2 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 688825 | 长鑫科技 | 295,247 | 11,411,296.55 | 0.16 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 11,600 | 9,377,904.00 | 0.13 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 16,240 | 6,317,360.00 | 0.09 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 19,200 | 5,589,312.00 | 0.08 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 110,800 | 4,571,608.00 | 0.07 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 75,600 | 4,028,724.00 | 0.06 |
| 7 | 002371 | 北方华创 | 4,800 | 2,956,656.00 | 0.04 |
| 8 | 603259 | 药明康德 | 16,800 | 2,811,312.00 | 0.04 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 2,200 | 2,768,964.00 | 0.04 |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 89,800 | 2,562,892.00 | 0.04 |

## 5.4 报告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。

## 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 | 指数型 | 交易型开放式 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 6,337,693,521.61 | 90.59 |

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IF2612 | 沪深 300 股指期货 2612 | 120 | 154,778,400.00 | -3,124,020.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -3,124,020.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -6,272,516.65 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -3,525,120.00 |

### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 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。

### 5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11.3 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。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1 本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，招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到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。

### 5.12.2 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。

### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 19,253,292.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | 339,067.17 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 18,945,286.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 38,537,645.93 |

### 5.12.4 报告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。

### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688825 | 长鑫科技 | 11,411,296.55 | 0.16 | 新股锁定期内 |

### 5.12.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 I | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 Y |
|---|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,771,808,534.46 | 2,761,409,148.57 | 20,759,920.42 | 54,119,171.72 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 376,660,754.24 | 1,529,838,816.65 | 1,030,302,479.15 | 18,597,483.24 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 173,656,185.73 | 505,864,553.13 | 501,741,925.44 | 6,706,223.75 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,974,813,102.97 | 3,785,383,412.09 | 549,320,474.13 | 66,010,431.21 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 20260714-20260721; | 735,158,980.91 | 431,816,219.02 | - | 1,166,975,199.93 | 18.30 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。 | | | | | | |

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

# §9 备查文件目录

## 9.1 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

## 9.2 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

## 9.3 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 10 月 27 日**