

华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证 券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	17
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
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	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63
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	63
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	63

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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	65
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
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	67
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 A500ETF
场内简称	A500 基金(扩位证券简称: A500ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	563360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 25 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,225,987,426.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票(含存托凭证)的投资策略 2、债券投资策略 3、金融衍生工具投资策略 4、资产支持证券的投资策略 5、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金,采用完全复制的被动式投资策略,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征:一方面,相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言,其风险和收益较高;另一方面,相对于采用抽样复制的指数型基金而言,其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂	帅芳
	联系电话	021-38601777	021-38677947
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgrxp@tg.gtth.com
客户服务电话		400-888-0001	021-38917599-5
传真		021-38601799	021-50872603
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	中国(上海)自由贸易试验区 商城路 618 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	上海市静安区新闻路 669 号博 华广场 19 楼
邮政编码		200135	200041

法定代表人	贾波	朱健
-------	----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,948,671,532.56
本期利润	4,666,937,075.79
加权平均基金份额本期利润	0.1584
本期加权平均净值利润率	11.99%
本期基金份额净值增长率	12.57%
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	5,124,875,929.88
期末可供分配基金份额利润	0.2306
期末基金资产净值	31,537,227,447.56
期末基金份额净值	1.4189
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	41.89%

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

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

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

3.2 基金净值表现

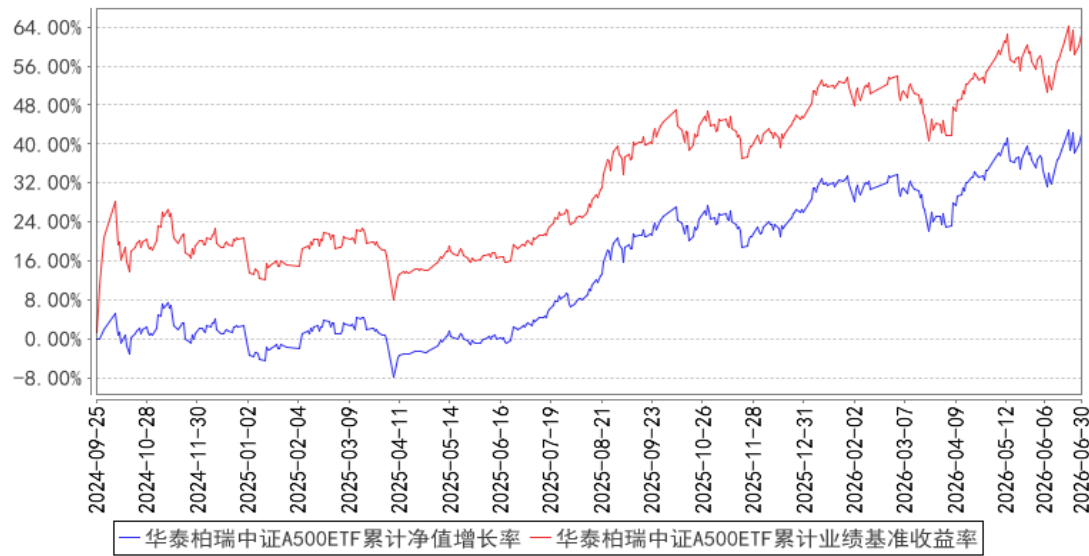
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月	14.88%	1.40%	14.26%	1.41%	0.62%	-0.01%
过去六个月	12.57%	1.28%	11.91%	1.29%	0.66%	-0.01%
过去一年	38.43%	1.14%	36.38%	1.14%	2.05%	0.00%
自基金合同生效 起至今	41.89%	1.17%	62.54%	1.35%	- 20.65%	-0.18%

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A500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2024 年 9 月 25 日至 2026 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、Heron View Partners LLC 和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 201 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶	本基金的	2024 年 9	2026 年 2	7 年	理学硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基

青	基金经理助理	月 25 日	月 25 日		金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
谭弘翔	指数投资部总监、本基金的基金经理	2024 年 9 月 25 日	-	10 年	美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融工程专业硕士。曾任上海证券交易所产品创新中心基金业务部经理。2020 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部总监。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至 2025 年 1 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、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。2021 年 6 月至 2026 年 2 月任华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 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稀土产业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。2022 年 1 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证港股通科技交易

					型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月至 2025 年 7 月任华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月至 2024 年 6 月任华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 8 月至 2025 年 7 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。2023 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月至 2024 年 6 月任华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月至 2025 年 7 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。2024 年 2 月起任华泰柏瑞上证科创板 100 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。2024 年 6 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2024 年 9 月起任华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起任华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2025 年 2 月至 2026 年 2 月任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 2 月起任华泰柏瑞上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2025 年 5 月至 2026 年 5 月任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 8 月起任华泰柏瑞中证通用航空主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起任华泰柏瑞中证全指航空航天交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月起任华泰柏瑞中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华
--	--	--	--	--	---

					泰柏瑞中证工程机械主题交易型开放式 指数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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，中证 A500 指数涨幅为 11.91%，以价格指数对比跑赢沪深 300 指数和中证 2000 指数，但弱于中证 500 和中证 1000 指数，主要原因在于二季度市场整体进入反弹期后，风格分化较为明显，大中盘成长风格尤其是算力相关板块成为拉动市场上涨的主要动能。

二季度市场的高度分化，主要是由 3 月份发生的两个重大事件所造成的。一方面，以 OpenClaw 为代表的 AI Agent 快速发展普及，进度远超去年底市场预期，Token 消耗量大幅增长，打消了

市场对于数据中心大额资本开支变现途径的顾虑，对推理算力需求的预期显著抬升，成为 AI 算力板块的新叙事。另一方面，美伊冲突从风险偏好、流动性、基本面三个维度对资本市场形成冲击，非 AI 板块缺乏主线叙事支撑，自然会因为海外央行加息预期的升温 and 国内 4、5 月份宏观数据的走弱而承压。尤其是在年初原本预期较为明朗的我国货币政策宽松和“反内卷”力度加大，也在 PPI 受供给侧扰动异常走高之后而推迟，中美又在 5 月中旬之后分别开启了战略性科技公司的 IPO 进程，整个顺周期价值风格都面临压力大、催化少、资金还被 AI 板块虹吸的不利局面。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4189 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.57%，业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，随着中美贸易谈判持续取得进展，美伊冲突在相对克制的状态下虽有反复但烈度不断下降，我国下半年所面临的外部风险明显收敛，为内部政策提供了较大的施展空间。7 月份政治局会议提出了较具雄心的政策目标，不仅要“加快推动新旧动能转换”，还要“及时谋划出台务实管用的增量政策，加大逆周期调节力度，加力扩大内需、优化供给”。

一方面，相比于 4 月份政治局会议在科技领域更多聚焦于人工智能，7 月份政治局会议提出“积极推动前沿技术突破和未来产业发展，着力打造新兴支柱产业”，意味着今年 3 月《政府工作报告》中提到的集成电路、航空航天、生物医药、低空经济等新兴支柱产业，以及未来能源、量子科技、生物制造、具身智能、脑机接口、6G 等未来产业都有望得到更多关注。

另一方面，宏观政策上大概率会适当发力，首当其冲的就是要解决上半年新增地方政府债务额度发行节奏较慢的问题，要求“加快财政支出和债券资金使用进度”，率先通过财政政策力度加大来推动投资增速修复。随后货币政策会根据经济总量和结构情况的变化而动态调整，“综合运用并适时调整货币政策工具”，并不排除宽松的可能，因此下半年顺周期板块可能沿着投资-消费方向传导，修复上半年相对疲弱的表现。

综合来看，下半年虽然大概率不会再有像二季度人工智能板块这样的历史级别机会，但不同板块之间的表现会更加均衡，在成长和价值风格上都能找到不少机会，仅仅是持有大盘宽基指数就有望获得较好的风险收益比。

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，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	198,559,034.10	284,688,590.94
结算备付金		-	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	31,418,896,319.18	49,245,332,645.61
其中：股票投资		31,417,354,248.21	49,245,332,645.61
基金投资		-	-
债券投资		1,542,070.97	-
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		-	38,933,069.33
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		31,617,515,845.91	49,568,954,305.88
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		4,373,972.60	2,672,130.16
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,659,970.16	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,871,998.75	4,609,904.64
应付托管费		1,290,666.25	1,536,634.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	65,091,788.24	110,357,439.87
负债合计		80,288,398.35	119,176,109.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	22,225,987,426.00	39,229,987,426.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,311,240,021.56	10,219,790,770.30

净资产合计		31,537,227,447.56	49,449,778,196.30
负债和净资产总计		31,617,515,845.91	49,568,954,305.88

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4189 元，基金份额总额 22,225,987,426.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,705,909,696.05	129,371,690.53
1. 利息收入		517,904.63	190,014.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	517,904.63	190,014.00
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		3,949,739,179.12	-191,236,119.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,662,566,677.63	-336,894,441.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	68.87	479,218.84
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	287,172,432.62	145,179,103.41
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	718,265,543.23	329,380,495.65
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	37,387,069.07	-8,962,700.10

减：二、营业总支出		38,972,620.26	13,838,389.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	29,096,128.04	10,233,743.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,698,709.37	3,411,248.01
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.25	0.77
8. 其他费用	6.4.7.23	177,782.60	193,396.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,666,937,075.79	115,533,301.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,666,937,075.79	115,533,301.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,666,937,075.79	115,533,301.13

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	39,229,987,426.00	-	10,219,790,770.30	49,449,778,196.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	39,229,987,426.00	-	10,219,790,770.30	49,449,778,196.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 17,004,000,000	-	- 908,550,748.74	- 17,912,550,748.

	. 00			74
(一)、综合收益总额	-	-	4, 666, 937, 075. 79	4, 666, 937, 075. 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)	- 17, 004, 000, 000. 00	-	- 5, 575, 487, 824. 53	- 22, 579, 487, 824. 53
其中：1. 基金申购款	16, 950, 000, 000. 00	-	5, 466, 745, 883. 10	22, 416, 745, 883. 10
2. 基金赎回款	- 33, 954, 000, 000. 00	-	- 11, 042, 233, 707. 63	- 44, 996, 233, 707. 63
(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	22, 225, 987, 426. 00	-	9, 311, 240, 021. 56	31, 537, 227, 447. 56
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	17, 284, 987, 426. 00	-	161, 997, 015. 74	17, 446, 984, 441. 74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	17, 284, 987, 426. 00	-	161, 997, 015. 74	17, 446, 984, 441. 74

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,803,000,000.00	-	390,942,120.51	5,193,942,120.51
(一)、综合收益总额	-	-	115,533,301.13	115,533,301.13
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	4,803,000,000.00	-	275,408,819.38	5,078,408,819.38
其中：1. 基金申购款	17,511,000,000.00	-	193,813,681.18	17,704,813,681.18
2. 基金赎回款	-12,708,000,000.00	-	81,595,138.20	-12,626,404,861.80
(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	22,087,987,426.00	-	552,939,136.25	22,640,926,562.25

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1265 号《关于准予华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数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

和《证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,999,987,426.00 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明验字(2024)第 70025451_B02 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,999,987,426.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。根据 2025 年 4 月 4 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下证券投资基金更新基金托管人信息并修改基金合同、托管协议的公告》，自 2025 年 4 月 7 日起，本基金的托管人变更为国泰海通证券股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2024]131 号核准，本基金 1,999,987,426.00 份基金份额于 2024 年 10 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华泰柏瑞中证 A500ETF 联接基金”）。华泰柏瑞中证 A500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会

计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税交易,资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日,资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易,可以选择适用简易计税方法,按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税交易,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税。

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

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	198,559,034.10

等于：本金	198,542,934.03
加：应计利息	16,100.07
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	198,559,034.10

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		27,990,896,775.02	-	31,417,354,248.21	3,426,457,473.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,542,000.00	70.97	1,542,070.97	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,542,000.00	70.97	1,542,070.97	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		27,992,438,775.02	70.97	31,418,896,319.18	3,426,457,473.19

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

单位：人民币元

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

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,012.93
其他应付款	964,942.80
应退退补款	64,007,832.51
合计	65,091,788.24

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,229,987,426.00	39,229,987,426.00
本期申购	16,950,000,000.00	16,950,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-33,954,000,000.00	-33,954,000,000.00
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	22,225,987,426.00	22,225,987,426.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,586,199,705.17	6,633,591,065.13	10,219,790,770.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,586,199,705.17	6,633,591,065.13	10,219,790,770.30
本期利润	3,948,671,532.56	718,265,543.23	4,666,937,075.79
本期基金份额交易产生的变动数	-2,409,995,307.85	-3,165,492,516.68	-5,575,487,824.53

其中：基金申购款	2,602,059,110.81	2,864,686,772.29	5,466,745,883.10
基金赎回款	-5,012,054,418.66	-6,030,179,288.97	-11,042,233,707.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,124,875,929.88	4,186,364,091.68	9,311,240,021.56

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	517,904.63
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	-
其他	-
合计	517,904.63

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,701,621,357.29
股票投资收益——赎回差价收入	960,945,320.34
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	3,662,566,677.63

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,913,834,013.74
减：卖出股票成本总额	22,189,235,689.67
减：交易费用	22,976,966.78
买卖股票差价收入	2,701,621,357.29

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	44,996,233,707.63
减：现金支付赎回款总额	21,672,467,894.63
减：赎回股票成本总额	22,362,820,492.66
减：交易费用	-
赎回差价收入	960,945,320.34

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	68.87
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	68.87

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	287,172,432.62
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	287,172,432.62

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	718,303,673.74
股票投资	718,303,673.74
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	-38,130.51
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	718,265,543.23

注：其他为可退替代的公允价值变动。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	37,387,069.07
合计	37,387,069.07

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	59,507.37
IOPV 计算发布费	9,179.29
合计	177,782.60

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
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东
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
华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华泰柏瑞中证 A500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	39,824,379,913.18	100.00	16,493,517,002.63	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
华泰证券	-	-	2,931,631.33	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
华泰证券	7,964,748.01	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
华泰证券	3,298,644.02	100.00	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	29,096,128.04	10,233,743.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,293,591.13	1,250,054.73
应支付基金管理人的净管理费	24,802,536.91	8,983,689.20

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,698,709.37	3,411,248.01

注：支付基金托管人国泰海通证券的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 9 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	13,200,000.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	13,200,000.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	13,200,000.00	13,200,000.00
报告期末持有的基金份额	0.0594%	0.0598%

占基金总份额比例		
----------	--	--

- 注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。
2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例（%）
国泰海通证 券股份有限 公司	203,530,917.00	0.9157	2,227,137,921.00	5.6771
华泰柏瑞中 证 A500 交 易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金	1,421,022,300.00	6.3935	2,152,225,900.00	5.4862
华泰证券股 份有限公司	5,820,597,770.00	26.1883	6,665,692,464.00	16.9913

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券-券商 保证金	169,404,411.08	68,848.54	318,691,295.71	39,905.83

注：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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位：股/张）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	688818	电科蓝天	网下申购	17,168	162,580.96
国泰海通证券股份有限公司	688781	视涯科技	网下申购	9,746	221,039.28
国泰海通证券股份有限公司	301696	三瑞智能	网下申购	2,157	53,234.76
国泰海通证券股份有限公司	301666	大普微	网下申购	3,048	140,451.84
华泰联合证券有限责任公司	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
国泰海通证券股份有限公司	688635	长进光子	网下申购	1,271	52,085.58
国泰海通证券股份有限公司	301599	理奇智能	网下申购	4,325	60,160.75
华泰联合证券有限责任公司	113704	春风转债	优先配售	15,420	1,542,000.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	301458	钧崑电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合证券有限责任公司	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
国泰海通证券股份有限公司	301658	首航新能	网下申购	4,369	51,554.20
华泰联合证券有限责任公司	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
国泰海通证券股份有限公司	688545	兴福电子	网下申购	9,940	116,099.20
国泰海通证券股份有限公司	301173	毓恬冠佳	网下申购	1,724	48,840.92

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
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	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

				内						
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	6,488	65,658.56	179,912.24	-
300724	捷佳伟创	2026年4月8日	6个月	询价转让流通受限	94.12	66.40	30,000	2,823,600.00	1,992,000.00	-
300803	指南针	2026年4月24日	6个月	新股锁定期内	85.11	85.76	50,000	4,255,500.00	4,288,000.00	-
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	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-

				内						
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股锁定期内	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股锁定期内	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股锁定期内	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股锁定期内	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定期内	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定期内	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定期内	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
30169	三	202	6个月	新	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

6	瑞智能	6 年 3 月 31 日		股锁定期内						
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688008	澜起科	2026 年 5 月	6 个月	询价转	250.08	276.82	50,000	12,504,000.00	13,841,000.00	-

	技	29 日		让 流 通 受 限						
688072	拓荆科技	2026年6月23日	6个月	定向增发流通受限	576.01	745.27	24,166	13,919,857.66	18,010,194.82	-
688099	晶晨股份	2026年1月28日	6个月	询价转让流通受限	82.85	99.72	50,000	4,142,500.00	4,986,000.00	-
688599	天合光能	2026年3月6日	6个月	询价转让流通受限	17.31	13.49	150,000	2,596,500.00	2,023,500.00	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股锁定期内	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股锁定期内	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科	2026年3月	6个月以上	新股锁	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-

	技	18 日		定期 内						
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定期内	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股锁定期内	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	6个月以上	新股锁定期内	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股锁定期内	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	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	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股锁定期	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

				内						
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股锁定期内	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股锁定期内	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026年6月10日	1个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	15,420	1,542,000.00	1,542,070.97	-

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	停牌日期	停牌	期末估值	复牌	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	----	------	----	------	----	-------	-------	--------	--------	----

	名称		原因	单价	日期	价				
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	169,715	48,936,587.68	141,202,880.00	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 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	198,559,034.10	-	-	-	-	-	198,559,034.10

交易性金融资产	-	-	-	-	-1,542,070.97	31,417,354,248.21	31,418,896,319.18
其他资产	-	-	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	198,559,034.10	-	-	-	-1,542,070.97	31,417,414,740.84	31,617,515,845.91
负债	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	4,373,972.60	4,373,972.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,871,998.75	3,871,998.75
应付托管费	-	-	-	-	-	1,290,666.25	1,290,666.25
应付清算款	-	-	-	-	-	5,659,970.16	5,659,970.16
应交税费	-	-	-	-	-	2.35	2.35
其他负债	-	-	-	-	-	65,091,788.24	65,091,788.24
负债总计	-	-	-	-	-	80,288,398.35	80,288,398.35
利率敏感度缺口	198,559,034.10	-	-	-	-1,542,070.97	31,337,126,342.49	31,537,227,447.56
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
货币资金	284,688,590.94	-	-	-	-	-	284,688,590.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-	49,245,332,645.61	49,245,332,645.61
应收清算款	-	-	-	-	-	38,933,069.33	38,933,069.33
资产总计	284,688,590.94	-	-	-	-	49,284,265,714.94	49,568,954,305.88
负债	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	2,672,130.16	2,672,130.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,609,904.64	4,609,904.64
应付托管费	-	-	-	-	-	1,536,634.91	1,536,634.91
其他负债	-	-	-	-	-	110,357,439.87	110,357,439.87
负债总计	-	-	-	-	-	119,176,109.58	119,176,109.58

利率敏感度缺	284,688,590.					49,165,089	49,449,778,1
口	94	-	-	-	-	,605.36	96.30

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.005%(2025 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	31,417,354,248.21	99.62	49,245,332,645.61	99.59
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	-4,373,972.60	-0.01	-2,672,130.16	-0.01

合计	31,412,980,275.61	99.61	49,242,660,515.45	99.58
----	-------------------	-------	-------------------	-------

注：其他为可退替代款。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,561,794,454.16	2,453,103,668.36
	业绩比较基准下降 5%	-1,561,794,454.16	-2,453,103,668.36

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	31,224,673,522.70	48,993,449,298.15
第二层次	143,595,242.41	246,163,364.68
第三层次	50,627,554.07	5,719,982.78
合计	31,418,896,319.18	49,245,332,645.61

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、

交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 22,416,745,883.10 元（2025 年度：65,586,395,957.63 元），其中包括以股票支付的申购款 11,051,179,956.35 元和以现金支付的申购款 11,365,565,926.75 元（2025 年度：其中包括以股票支付的申购款 34,713,634,572.68 元和以现金支付的申购款 30,872,761,384.95 元）。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	31,417,354,248.21	99.37
	其中：股票	31,417,354,248.21	99.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,542,070.97	0.00
	其中：债券	1,542,070.97	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	198,559,034.10	0.63
8	其他各项资产	60,492.63	0.00

9	合计	31,617,515,845.91	100.00
---	----	-------------------	--------

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	98,899,322.00	0.31
B	采矿业	1,292,812,306.46	4.10
C	制造业	22,200,183,424.31	70.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	684,353,596.28	2.17
E	建筑业	382,377,917.28	1.21
F	批发和零售业	243,204,147.77	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	699,330,762.15	2.22
H	住宿和餐饮业	14,603,527.61	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,763,558,320.29	5.59
J	金融业	3,045,871,074.56	9.66
K	房地产业	175,671,168.94	0.56
L	租赁和商务服务业	227,287,568.20	0.72
M	科学研究和技术服务业	375,863,870.21	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	53,870,554.36	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,526,040.00	0.03
Q	卫生和社会工作	61,603,916.64	0.20
R	文化、体育和娱乐业	24,098,039.00	0.08
S	综合	56,689,054.00	0.18
	合计	31,410,804,610.06	99.60

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00

C	制造业	5,655,576.23	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,037.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,549,638.15	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	1,060,542	1,346,888,340.00	4.27
2	300750	宁德时代	2,512,656	987,498,934.56	3.13
3	300502	新易盛	1,320,429	801,500,403.00	2.54
4	600519	贵州茅台	590,368	699,875,360.32	2.22
5	603986	兆易创新	631,514	514,683,910.00	1.63

6	601318	中国平安	10,103,173	482,325,479.02	1.53
7	688256	寒武纪	299,797	478,341,103.35	1.52
8	600036	招商银行	11,736,771	416,655,370.50	1.32
9	601899	紫金矿业	15,618,206	392,641,698.84	1.25
10	002371	北方华创	405,924	359,064,133.44	1.14
11	000333	美的集团	4,614,842	348,559,016.26	1.11
12	002475	立讯精密	4,833,400	340,271,360.00	1.08
13	688008	澜起科技	1,080,824	333,293,357.60	1.06
14	688012	中微公司	698,917	327,442,614.50	1.04
15	688041	海光信息	872,808	323,200,802.40	1.02
16	002384	东山精密	1,212,431	318,081,272.85	1.01
17	600900	长江电力	11,597,001	306,972,616.47	0.97
18	688981	中芯国际	1,891,408	300,393,418.56	0.95
19	000725	京东方 A	34,481,300	299,297,684.00	0.95
20	603259	药明康德	2,346,221	292,127,976.71	0.93
21	601166	兴业银行	16,055,178	265,873,747.68	0.84
22	600030	中信证券	9,245,797	265,631,747.81	0.84
23	300059	东方财富	12,009,900	244,761,762.00	0.78
24	600183	生益科技	1,377,687	238,890,925.80	0.76
25	600276	恒瑞医药	4,228,721	220,062,640.84	0.70
26	300274	阳光电源	1,375,171	218,679,692.42	0.69
27	601398	工商银行	30,655,949	216,737,559.43	0.69
28	300408	三环集团	1,269,700	211,912,930.00	0.67
29	002594	比亚迪	2,581,410	205,738,377.00	0.65
30	600487	亨通光电	1,866,329	204,064,412.86	0.65
31	300476	胜宏科技	577,100	199,924,753.00	0.63
32	601211	国泰海通	10,709,700	194,916,540.00	0.62
33	002463	沪电股份	1,275,010	194,821,528.00	0.62
34	300394	天孚通信	619,097	187,388,279.96	0.59
35	688498	源杰科技	95,051	179,266,186.00	0.57
36	688525	佰维存储	360,022	178,113,684.06	0.56
37	000988	华工科技	955,800	176,450,238.00	0.56
38	301308	江波龙	242,300	170,530,740.00	0.54
39	600176	中国巨石	2,278,588	166,063,493.44	0.53
40	601288	农业银行	27,200,198	165,105,201.86	0.52
41	601328	交通银行	25,273,265	162,507,093.95	0.52
42	000651	格力电器	4,248,260	159,309,750.00	0.51
43	688072	拓荆科技	193,881	159,213,074.82	0.50
44	600522	中天科技	2,582,277	156,692,568.36	0.50
45	688521	芯原股份	401,515	149,018,277.10	0.47
46	603019	中科曙光	1,384,481	148,457,897.63	0.47
47	603993	洛阳钼业	8,273,600	145,201,680.00	0.46
48	600150	中国船舶	4,280,893	144,651,374.47	0.46

49	600887	伊利股份	5,990,848	143,540,718.08	0.46
50	300604	长川科技	416,700	142,269,714.00	0.45
51	600584	长电科技	1,355,333	140,344,732.15	0.45
52	000338	潍柴动力	5,098,200	138,925,950.00	0.44
53	000858	五 粮 液	1,844,575	136,498,550.00	0.43
54	688347	华虹宏力	389,126	130,863,073.80	0.41
55	601816	京沪高铁	27,797,113	125,920,921.89	0.40
56	600309	万华化学	1,784,737	122,093,858.17	0.39
57	688120	华海清科	377,707	121,689,641.26	0.39
58	300124	汇川技术	1,801,200	119,473,596.00	0.38
59	002916	深南电路	260,063	119,082,847.70	0.38
60	002415	海康威视	3,474,600	118,831,320.00	0.38
61	002008	大族激光	781,900	117,371,009.00	0.37
62	002281	光迅科技	454,937	116,891,512.78	0.37
63	600111	北方稀土	2,394,006	115,031,988.30	0.36
64	000100	TCL 科技	19,726,900	114,810,558.00	0.36
65	300857	协创数据	326,940	111,126,906.00	0.35
66	000063	中兴通讯	3,058,200	110,676,258.00	0.35
67	300136	信维通信	919,600	109,662,300.00	0.35
68	600000	浦发银行	12,634,241	108,780,815.01	0.34
69	600089	特变电工	4,797,424	107,942,040.00	0.34
70	601857	中国石油	12,276,881	106,563,327.08	0.34
71	002028	思源电气	588,500	101,810,500.00	0.32
72	601088	中国神华	2,600,516	101,524,144.64	0.32
73	300433	蓝思科技	1,883,800	101,084,708.00	0.32
74	600031	三一重工	5,620,391	97,120,356.48	0.31
75	300475	香农芯创	313,700	94,110,000.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	1,442,225	93,787,891.75	0.30
77	002050	三花智控	2,122,600	93,033,558.00	0.29
78	601601	中国太保	3,248,917	92,659,112.84	0.29
79	000001	平安银行	9,208,800	92,548,440.00	0.29
80	300223	北京君正	369,300	91,918,770.00	0.29
81	000792	盐湖股份	3,012,600	90,950,394.00	0.29
82	002714	牧原股份	2,585,800	90,477,142.00	0.29
83	600549	厦门钨业	1,056,730	90,033,396.00	0.29
84	002353	杰瑞股份	580,500	88,526,250.00	0.28
85	600406	国电南瑞	3,809,677	87,051,119.45	0.28
86	002156	通富微电	1,147,000	87,022,890.00	0.28
87	601668	中国建筑	19,579,285	84,974,096.90	0.27
88	000657	中钨高新	866,099	82,902,996.28	0.26
89	002436	兴森科技	1,614,100	82,238,395.00	0.26
90	601919	中远海控	5,942,258	78,794,341.08	0.25
91	002602	世纪华通	5,577,332	78,640,381.20	0.25

92	300760	迈瑞医疗	572,690	77,788,482.70	0.25
93	601988	中国银行	13,550,830	77,510,747.60	0.25
94	600660	福耀玻璃	1,520,117	76,674,701.48	0.24
95	300054	鼎龙股份	722,900	76,605,713.00	0.24
96	603501	豪威集团	804,272	76,285,199.20	0.24
97	601728	中国电信	14,687,862	76,230,003.78	0.24
98	601012	隆基绿能	5,748,330	75,418,089.60	0.24
99	601225	陕西煤业	3,675,396	74,794,308.60	0.24
100	002230	科大讯飞	1,826,385	74,589,563.40	0.24
101	600941	中国移动	856,693	73,786,968.09	0.23
102	600690	海尔智家	3,555,700	72,571,837.00	0.23
103	002352	顺丰控股	2,277,200	71,185,272.00	0.23
104	601985	中国核电	7,791,849	70,360,396.47	0.22
105	002460	赣锋锂业	1,074,200	70,252,680.00	0.22
106	002709	天赐材料	1,351,900	69,528,217.00	0.22
107	603799	华友钴业	1,438,020	69,398,845.20	0.22
108	002938	鹏鼎控股	658,400	69,382,192.00	0.22
109	300757	罗博特科	112,042	69,353,998.00	0.22
110	300033	同花顺	287,370	69,256,170.00	0.22
111	688777	中控技术	582,589	68,454,207.50	0.22
112	000977	浪潮信息	977,184	68,402,880.00	0.22
113	600160	巨化股份	1,277,520	67,721,335.20	0.21
114	300442	润泽科技	779,010	64,712,360.70	0.21
115	002851	麦格米特	381,000	63,695,580.00	0.20
116	000425	徐工机械	7,769,500	62,855,255.00	0.20
117	000938	紫光股份	2,169,223	62,603,775.78	0.20
118	688126	沪硅产业	1,566,513	62,488,203.57	0.20
119	002202	金风科技	2,612,600	62,441,140.00	0.20
120	601600	中国铝业	7,507,665	61,713,006.30	0.20
121	600028	中国石化	13,819,308	61,634,113.68	0.20
122	600938	中国海油	2,267,937	61,574,489.55	0.20
123	300346	南大光电	654,412	60,631,271.80	0.19
124	002466	天齐锂业	983,000	60,277,560.00	0.19
125	600460	士兰微	1,098,061	60,020,014.26	0.19
126	002600	领益智造	3,455,300	59,914,902.00	0.19
127	601766	中国中车	11,520,254	59,905,320.80	0.19
128	300567	精测电子	186,900	59,359,440.00	0.19
129	600050	中国联通	14,823,093	59,292,372.00	0.19
130	300661	圣邦股份	407,382	58,451,169.36	0.19
131	002837	英维克	725,170	57,694,525.20	0.18
132	002080	中材科技	635,227	57,170,430.00	0.18
133	002049	紫光国微	643,400	57,101,750.00	0.18
134	002185	华天科技	2,525,910	56,353,052.10	0.18

135	002407	多氟多	1,117,700	56,142,071.00	0.18
136	002138	顺络电子	765,200	55,936,120.00	0.18
137	601628	中国人寿	1,580,939	55,886,193.65	0.18
138	688002	睿创微纳	358,789	55,501,070.41	0.18
139	002179	中航光电	1,201,300	55,500,060.00	0.18
140	601100	恒立液压	505,000	54,317,800.00	0.17
141	000568	泸州老窖	697,600	54,077,952.00	0.17
142	601872	招商轮船	3,064,477	53,842,860.89	0.17
143	600879	航天电子	2,506,738	53,368,452.02	0.17
144	002241	歌尔股份	2,359,450	53,158,408.50	0.17
145	300395	菲利华	394,099	52,702,859.27	0.17
146	603288	海天味业	1,581,870	52,454,809.20	0.17
147	601006	大秦铁路	11,291,327	52,053,017.47	0.17
148	000408	藏格矿业	744,300	51,594,876.00	0.16
149	601658	邮储银行	10,439,930	51,468,854.90	0.16
150	300390	天华新能	548,920	51,329,509.20	0.16
151	688017	绿的谐波	122,469	51,174,896.34	0.16
152	605117	德业股份	478,820	50,841,107.60	0.16
153	688469	芯联集成	4,774,038	50,652,543.18	0.16
154	600905	三峡能源	13,520,747	50,161,971.37	0.16
155	601888	中国中免	927,385	49,809,848.35	0.16
156	600489	中金黄金	2,756,000	49,745,800.00	0.16
157	002625	光启技术	1,637,132	49,637,842.24	0.16
158	000630	铜陵有色	7,635,400	48,561,144.00	0.15
159	600893	航发动力	1,261,213	48,354,906.42	0.15
160	600673	东阳光	1,426,500	47,901,870.00	0.15
161	600010	包钢股份	21,445,563	47,823,605.49	0.15
162	688396	华润微	489,335	47,734,629.25	0.15
163	601127	赛力斯	774,477	47,436,716.25	0.15
164	688111	金山办公	221,103	47,105,994.15	0.15
165	300058	蓝色光标	3,401,640	46,806,566.40	0.15
166	002273	水晶光电	1,316,700	46,716,516.00	0.15
167	601689	拓普集团	824,980	46,545,371.60	0.15
168	002027	分众传媒	9,590,100	46,416,084.00	0.15
169	300037	新宙邦	497,100	46,155,735.00	0.15
170	688271	联影医疗	452,573	45,813,964.79	0.15
171	600118	中国卫星	558,300	45,808,515.00	0.15
172	300751	迈为股份	159,755	45,124,397.30	0.14
173	600019	宝钢股份	8,266,556	44,887,399.08	0.14
174	000426	兴业银锡	1,345,700	44,354,272.00	0.14
175	600760	中航沈飞	1,076,478	44,243,245.80	0.14
176	000807	云铝股份	1,970,400	43,624,656.00	0.14
177	601168	西部矿业	1,582,209	42,941,152.26	0.14

178	600362	江西铜业	986,455	42,713,501.50	0.14
179	600104	上汽集团	4,360,116	42,554,732.16	0.13
180	300450	先导智能	1,042,500	42,450,600.00	0.13
181	600989	宝丰能源	2,085,022	42,388,497.26	0.13
182	601727	上海电气	5,979,640	41,857,480.00	0.13
183	600988	赤峰黄金	1,579,000	41,559,280.00	0.13
184	600875	东方电气	1,442,100	41,489,217.00	0.13
185	002001	新 和 成	1,457,500	41,422,150.00	0.13
186	688099	晶晨股份	403,984	41,410,953.60	0.13
187	002422	科伦药业	1,058,981	40,791,948.12	0.13
188	605589	圣泉集团	639,354	40,643,733.78	0.13
189	601390	中国中铁	9,710,427	40,492,480.59	0.13
190	600667	太极实业	1,385,887	40,440,182.66	0.13
191	600885	宏发股份	1,169,620	40,340,193.80	0.13
192	002738	中矿资源	683,520	40,320,844.80	0.13
193	000538	云南白药	847,600	40,150,812.00	0.13
194	000960	锡业股份	938,400	40,060,296.00	0.13
195	002126	银轮股份	804,100	40,044,180.00	0.13
196	600547	山东黄金	1,716,956	39,644,514.04	0.13
197	600392	盛和资源	1,327,590	39,522,354.30	0.13
198	600795	国电电力	8,462,121	39,518,105.07	0.13
199	000831	中国稀土	704,200	39,076,058.00	0.12
200	600418	江淮汽车	1,496,812	38,662,653.96	0.12
201	600585	海螺水泥	2,276,070	38,579,386.50	0.12
202	601669	中国电建	8,150,310	38,306,457.00	0.12
203	002648	卫星化学	1,599,500	37,572,255.00	0.12
204	600141	兴发集团	797,816	37,473,417.52	0.12
205	300316	晶盛机电	619,400	37,411,760.00	0.12
206	002812	恩捷股份	556,400	37,228,724.00	0.12
207	002129	TCL 中环	3,069,825	36,899,296.50	0.12
208	600096	云天化	1,206,600	36,680,640.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	4,423,100	36,534,806.00	0.12
210	601179	中国西电	2,433,233	36,303,836.36	0.12
211	301358	湖南裕能	476,100	36,121,707.00	0.11
212	300782	卓胜微	329,316	36,086,447.28	0.11
213	600346	恒力石化	2,000,000	35,420,000.00	0.11
214	600482	中国动力	1,078,603	35,378,178.40	0.11
215	601868	中国能建	13,211,020	35,273,423.40	0.11
216	002195	岩山科技	5,381,900	35,197,626.00	0.11
217	000066	中国长城	1,834,600	34,949,130.00	0.11
218	002558	巨人网络	1,258,900	34,695,284.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	2,863,098	34,672,116.78	0.11
220	300418	昆仑万维	854,700	34,495,692.00	0.11

221	600580	卧龙电驱	1,039,690	34,413,739.00	0.11
222	000625	长安汽车	4,711,300	33,780,021.00	0.11
223	600066	宇通客车	1,256,899	33,697,462.19	0.11
224	600426	华鲁恒升	1,403,314	33,567,270.88	0.11
225	600157	永泰能源	20,667,327	33,274,396.47	0.11
226	002532	天山铝业	3,074,800	32,992,604.00	0.10
227	600895	张江高科	883,024	32,892,644.00	0.10
228	000157	中联重科	4,715,600	32,867,732.00	0.10
229	600221	海航控股	24,212,800	32,687,280.00	0.10
230	600711	盛屯矿业	2,924,400	32,080,668.00	0.10
231	002340	格林美	4,835,500	31,962,655.00	0.10
232	605499	东鹏饮料	258,153	31,863,824.79	0.10
233	300803	指南针	349,200	31,715,664.00	0.10
234	000933	神火股份	1,493,600	31,664,320.00	0.10
235	600011	华能国际	4,169,209	31,644,296.31	0.10
236	600048	保利发展	6,815,114	31,553,977.82	0.10
237	600436	片仔癀	287,952	31,467,394.56	0.10
238	688036	传音控股	532,002	31,361,517.90	0.10
239	600143	金发科技	2,025,326	31,291,286.70	0.10
240	600438	通威股份	2,566,482	31,080,097.02	0.10
241	002821	凯莱英	190,700	30,893,400.00	0.10
242	300017	网宿科技	2,369,300	30,824,593.00	0.10
243	600115	中国东航	8,074,119	30,762,393.39	0.10
244	002236	大华股份	1,855,600	30,598,844.00	0.10
245	002493	荣盛石化	2,841,300	30,543,975.00	0.10
246	002131	利欧股份	6,420,700	30,498,325.00	0.10
247	600570	恒生电子	1,436,455	30,438,481.45	0.10
248	600886	国投电力	2,278,278	30,323,880.18	0.10
249	002456	欧菲光	3,188,400	30,162,264.00	0.10
250	600352	浙江龙盛	2,471,462	29,929,404.82	0.09
251	688047	龙芯中科	191,342	29,594,867.14	0.09
252	603659	璞泰来	1,015,350	29,374,075.50	0.09
253	601233	桐昆股份	1,351,616	29,262,486.40	0.09
254	003816	中国广核	7,463,900	29,183,849.00	0.09
255	300339	润和软件	755,700	29,102,007.00	0.09
256	601360	三六零	3,315,138	28,808,549.22	0.09
257	601058	赛轮轮胎	2,496,857	28,788,761.21	0.09
258	688213	思特威	268,752	28,775,276.64	0.09
259	000301	东方盛虹	2,512,300	28,765,835.00	0.09
260	300759	康龙化成	983,150	28,442,529.50	0.09
261	600026	中远海能	1,583,161	28,401,908.34	0.09
262	002074	国轩高科	1,030,000	28,335,300.00	0.09
263	688578	艾力斯	257,667	28,137,236.40	0.09

264	688235	百济神州	109,800	27,956,178.00	0.09
265	300438	鹏辉能源	336,300	27,862,455.00	0.09
266	002555	三七互娱	1,468,900	27,718,143.00	0.09
267	688122	西部超导	433,993	27,259,100.33	0.09
268	600009	上海机场	1,175,832	27,161,719.20	0.09
269	000768	中航西飞	1,316,575	26,963,456.00	0.09
270	600196	复星医药	1,199,542	26,953,708.74	0.09
271	000975	山金国际	1,579,300	26,848,100.00	0.09
272	601111	中国国航	4,419,778	26,739,656.90	0.08
273	002472	双环传动	643,400	26,707,534.00	0.08
274	300207	欣旺达	1,400,900	26,603,091.00	0.08
275	300001	特锐德	700,400	26,496,132.00	0.08
276	600029	南方航空	5,110,736	26,473,612.48	0.08
277	002517	恺英网络	1,623,100	26,375,375.00	0.08
278	600415	小商品城	2,595,576	26,371,052.16	0.08
279	600674	川投能源	1,854,311	26,275,586.87	0.08
280	603129	春风动力	102,600	26,245,080.00	0.08
281	002601	龙佰集团	1,584,600	26,114,208.00	0.08
282	600219	南山铝业	6,524,115	26,031,218.85	0.08
283	300458	全志科技	658,586	25,987,803.56	0.08
284	601186	中国铁建	4,351,831	25,893,394.45	0.08
285	002128	电投能源	1,115,500	25,790,360.00	0.08
286	601877	正泰电器	1,021,374	25,605,846.18	0.08
287	600233	圆通速递	1,623,511	25,570,298.25	0.08
288	601117	中国化学	3,471,128	25,512,790.80	0.08
289	002595	豪迈科技	547,445	25,510,937.00	0.08
290	300115	长盈精密	902,129	25,205,484.26	0.08
291	301236	软通动力	586,988	24,917,640.60	0.08
292	600372	中航机载	2,296,001	24,911,610.85	0.08
293	002155	湖南黄金	1,040,171	24,828,881.77	0.08
294	600839	四川长虹	3,499,201	24,424,422.98	0.08
295	002465	海格通信	1,878,600	23,989,722.00	0.08
296	300568	星源材质	1,273,700	23,843,664.00	0.08
297	300454	深信服	247,200	23,780,640.00	0.08
298	000963	华东医药	833,000	23,423,960.00	0.07
299	300347	泰格医药	486,400	23,347,200.00	0.07
300	002920	德赛西威	284,786	23,210,059.00	0.07
301	600741	华域汽车	1,495,485	23,209,927.20	0.07
302	688506	百利天恒	78,803	23,170,446.09	0.07
303	000547	航天发展	1,209,238	23,156,907.70	0.07
304	603650	彤程新材	235,200	23,044,896.00	0.07
305	300024	机器人	1,183,900	22,884,787.00	0.07
306	002130	沃尔核材	1,191,100	22,583,256.00	0.07

307	002497	雅化集团	1,096,200	22,329,594.00	0.07
308	688676	金盘科技	263,270	22,283,172.80	0.07
309	300012	华测检测	1,597,900	22,146,894.00	0.07
310	688331	荣昌生物	169,820	22,120,753.20	0.07
311	002432	九安医疗	311,300	22,002,684.00	0.07
312	001979	招商蛇口	3,417,200	21,972,596.00	0.07
313	000878	云南铜业	1,379,000	21,898,520.00	0.07
314	300496	中科创达	352,600	21,787,154.00	0.07
315	002271	东方雨虹	1,816,100	21,557,107.00	0.07
316	300083	创世纪	1,580,600	21,527,772.00	0.07
317	002414	高德红外	1,622,300	21,511,698.00	0.07
318	000034	神州数码	772,083	21,425,303.25	0.07
319	300866	安克创新	204,750	21,396,375.00	0.07
320	300474	景嘉微	349,204	21,119,857.92	0.07
321	002444	巨星科技	679,000	21,116,900.00	0.07
322	603979	金诚信	357,200	21,085,516.00	0.07
323	000733	振华科技	370,200	20,968,128.00	0.07
324	601021	春秋航空	460,025	20,967,939.50	0.07
325	000661	长春高新	311,497	20,745,700.20	0.07
326	688266	泽璟制药	176,832	20,629,221.12	0.07
327	300763	锦浪科技	228,000	20,599,800.00	0.07
328	601319	中国人保	3,030,250	20,484,490.00	0.06
329	002756	永兴材料	360,230	20,403,427.20	0.06
330	600699	均胜电子	928,378	20,062,248.58	0.06
331	300748	金力永磁	648,053	19,992,435.05	0.06
332	002078	太阳纸业	1,592,000	19,884,080.00	0.06
333	601615	明阳智能	1,718,378	19,881,633.46	0.06
334	002025	航天电器	260,800	19,878,176.00	0.06
335	300142	沃森生物	1,517,700	19,714,923.00	0.06
336	300073	当升科技	408,300	19,614,732.00	0.06
337	300432	富临精工	974,500	19,577,705.00	0.06
338	688188	柏楚电子	182,775	19,502,092.50	0.06
339	601677	明泰铝业	1,173,528	19,480,564.80	0.06
340	603087	甘李药业	342,065	19,415,609.40	0.06
341	600039	四川路桥	2,477,800	19,376,396.00	0.06
342	300919	中伟新材	440,665	19,279,093.75	0.06
343	603606	东方电缆	463,537	19,241,420.87	0.06
344	601800	中国交建	3,364,403	19,210,741.13	0.06
345	000423	东阿阿胶	423,000	19,187,280.00	0.06
346	000002	万科 A	6,454,600	19,105,616.00	0.06
347	002252	上海莱士	4,377,100	18,996,614.00	0.06
348	688608	恒玄科技	112,692	18,840,975.48	0.06
349	688169	石头科技	197,935	18,797,886.95	0.06

350	600226	亨通股份	1,959,665	18,793,187.35	0.06
351	688599	天合光能	1,330,726	18,695,351.12	0.06
352	300724	捷佳伟创	266,000	18,653,600.00	0.06
353	688223	晶科能源	3,898,103	18,515,989.25	0.06
354	002064	华峰化学	1,878,200	17,824,118.00	0.06
355	600588	用友网络	1,940,192	17,810,962.56	0.06
356	601633	长城汽车	1,179,276	17,795,274.84	0.06
357	001965	招商公路	1,929,700	17,676,052.00	0.06
358	688390	固德威	162,372	17,618,985.72	0.06
359	000786	北新建材	970,900	17,563,581.00	0.06
360	002831	裕同科技	484,200	17,218,152.00	0.05
361	300677	英科医疗	429,400	16,819,598.00	0.05
362	002294	信立泰	525,700	16,764,573.00	0.05
363	000519	中兵红箭	793,300	16,714,831.00	0.05
364	688180	君实生物	492,584	16,659,190.88	0.05
365	603806	福斯特	991,820	16,652,657.80	0.05
366	601618	中国中冶	6,758,913	16,491,747.72	0.05
367	688065	凯赛生物	344,172	16,468,630.20	0.05
368	600516	方大炭素	2,667,951	16,461,257.67	0.05
369	600177	雅戈尔	2,185,952	16,460,218.56	0.05
370	302132	中航成飞	280,600	16,364,592.00	0.05
371	300972	万辰集团	94,209	16,336,782.69	0.05
372	603260	合盛硅业	338,484	16,335,237.84	0.05
373	601607	上海医药	1,060,079	16,325,216.60	0.05
374	002176	江特电机	1,620,400	16,220,204.00	0.05
375	000623	吉林敖东	909,267	16,121,303.91	0.05
376	000617	中油资本	2,400,800	15,821,272.00	0.05
377	300699	光威复材	549,360	15,739,164.00	0.05
378	300558	贝达药业	240,912	15,676,143.84	0.05
379	002085	万丰奥威	1,409,017	15,625,998.53	0.05
380	002318	久立特材	647,600	15,477,640.00	0.05
381	300832	新产业	367,396	15,430,632.00	0.05
382	300251	光线传媒	1,390,200	15,417,318.00	0.05
383	300342	天银机电	324,517	15,252,299.00	0.05
384	002459	晶澳科技	1,879,000	15,219,900.00	0.05
385	002065	东华软件	2,127,300	15,188,922.00	0.05
386	600499	科达制造	1,094,234	15,100,429.20	0.05
387	002266	浙富控股	2,970,100	15,028,706.00	0.05
388	600085	同仁堂	648,600	14,989,146.00	0.05
389	002044	美年健康	2,970,800	14,943,124.00	0.05
390	688472	阿特斯	1,379,835	14,929,814.70	0.05
391	600515	海南机场	5,417,812	14,844,804.88	0.05
392	300409	道氏技术	740,600	14,760,158.00	0.05

393	603596	伯特利	593,818	14,750,439.12	0.05
394	605090	九丰能源	396,400	14,734,188.00	0.05
395	688617	惠泰医疗	81,038	14,713,259.28	0.05
396	000400	许继电气	675,500	14,658,350.00	0.05
397	301550	斯菱智驱	160,105	14,638,400.15	0.05
398	002223	鱼跃医疗	568,200	14,580,012.00	0.05
399	002405	四维图新	2,249,300	14,552,971.00	0.05
400	300003	乐普医疗	1,220,400	14,461,740.00	0.05
401	600521	华海药业	996,100	14,343,840.00	0.05
402	000032	深桑达 A	574,024	14,321,898.80	0.05
403	000415	渤海租赁	3,517,600	14,316,632.00	0.05
404	600862	中航高科	793,300	14,303,199.00	0.05
405	601216	君正集团	3,193,924	14,244,901.04	0.05
406	000683	博源化工	2,471,300	14,234,688.00	0.05
407	000039	中集集团	1,750,500	14,196,555.00	0.05
408	000999	华润三九	629,910	14,166,675.90	0.04
409	688005	容百科技	459,099	14,048,429.40	0.04
410	600803	新奥股份	879,700	13,899,260.00	0.04
411	603766	隆鑫通用	1,163,700	13,882,941.00	0.04
412	600704	物产中大	2,940,495	13,879,136.40	0.04
413	600312	平高电气	772,532	13,642,915.12	0.04
414	603605	珀莱雅	226,824	13,591,294.08	0.04
415	600018	上港集团	2,865,486	13,525,093.92	0.04
416	000887	中鼎股份	749,500	13,408,555.00	0.04
417	000967	盈峰环境	1,271,500	13,388,895.00	0.04
418	688116	天奈科技	349,790	13,361,978.00	0.04
419	600765	中航重机	1,033,200	13,348,944.00	0.04
420	600332	白云山	664,973	13,326,058.92	0.04
421	300122	智飞生物	1,130,400	13,214,376.00	0.04
422	600166	福田汽车	4,505,358	13,110,591.78	0.04
423	600153	建发股份	1,648,053	13,069,060.29	0.04
424	000830	鲁西化工	1,086,700	13,040,400.00	0.04
425	002410	广联达	1,568,200	12,796,512.00	0.04
426	002007	华兰生物	1,041,600	12,697,104.00	0.04
427	600323	瀚蓝环境	459,900	12,628,854.00	0.04
428	300896	爱美客	144,460	12,596,912.00	0.04
429	601799	星宇股份	136,400	12,360,568.00	0.04
430	688114	华大智造	238,495	12,182,324.60	0.04
431	603568	伟明环保	778,522	11,973,668.36	0.04
432	600398	海澜之家	2,275,100	11,898,773.00	0.04
433	002603	以岭药业	793,100	11,896,500.00	0.04
434	600486	扬农化工	231,410	11,732,487.00	0.04
435	688009	中国通号	2,447,307	11,649,181.32	0.04

436	601000	唐山港	2,801,727	11,627,167.05	0.04
437	601018	宁波港	3,685,700	11,609,955.00	0.04
438	002389	航天彩虹	652,800	11,600,256.00	0.04
439	600529	山东药玻	627,550	11,578,297.50	0.04
440	600208	衢州发展	4,036,488	11,423,261.04	0.04
441	000738	航发控制	622,200	11,380,038.00	0.04
442	600008	首创环保	4,167,576	11,335,806.72	0.04
443	000932	华菱钢铁	3,254,000	11,291,380.00	0.04
444	600316	洪都航空	403,100	11,262,614.00	0.04
445	600170	上海建工	5,054,178	11,220,275.16	0.04
446	600998	九州通	2,391,591	11,216,561.79	0.04
447	603486	科沃斯	221,000	11,215,750.00	0.04
448	600161	天坛生物	939,317	10,877,290.86	0.03
449	600820	隧道股份	2,085,227	10,864,032.67	0.03
450	300118	东方日升	866,600	10,789,170.00	0.03
451	603885	吉祥航空	1,038,040	10,681,431.60	0.03
452	601238	广汽集团	2,095,946	10,647,405.68	0.03
453	002607	中公教育	5,847,800	10,526,040.00	0.03
454	688303	大全能源	597,377	10,412,281.11	0.03
455	603816	顾家家居	463,300	10,359,388.00	0.03
456	603939	益丰药房	572,270	10,289,414.60	0.03
457	688166	博瑞医药	291,123	10,192,216.23	0.03
458	600763	通策医疗	298,878	10,125,986.64	0.03
459	601567	三星电气	665,100	9,936,594.00	0.03
460	300676	华大基因	279,500	9,799,270.00	0.03
461	300049	福瑞医科	252,000	9,797,760.00	0.03
462	603392	万泰生物	362,020	9,763,679.40	0.03
463	300573	兴齐眼药	238,754	9,731,613.04	0.03
464	600038	中直股份	383,734	9,704,632.86	0.03
465	601880	辽港股份	6,981,344	9,634,254.72	0.03
466	600511	国药股份	360,100	9,377,004.00	0.03
467	600535	天士力	707,300	9,357,579.00	0.03
468	600816	建元信托	3,733,373	9,109,430.12	0.03
469	300100	双林股份	327,600	9,100,728.00	0.03
470	002244	滨江集团	1,176,400	8,940,640.00	0.03
471	601155	新城控股	858,918	8,812,498.68	0.03
472	000833	粤桂股份	375,200	8,787,184.00	0.03
473	002120	韵达股份	1,373,600	8,736,096.00	0.03
474	688063	派能科技	163,906	8,731,272.62	0.03
475	300144	宋城演艺	1,494,100	8,680,721.00	0.03
476	000998	隆平高科	1,117,000	8,422,180.00	0.03
477	601866	中远海发	3,694,821	8,165,554.41	0.03
478	002544	普天科技	447,700	8,157,094.00	0.03

479	600064	南京高科	1,136,404	8,102,560.52	0.03
480	600635	大众公用	1,840,200	7,876,056.00	0.02
481	300457	赢合科技	369,500	7,789,060.00	0.02
482	600754	锦江酒店	427,039	7,682,431.61	0.02
483	000035	中国天楹	1,587,100	7,665,693.00	0.02
484	600655	豫园股份	1,842,500	7,572,675.00	0.02
485	603899	晨光股份	349,600	7,212,248.00	0.02
486	300601	康泰生物	634,200	7,191,828.00	0.02
487	600004	白云机场	979,881	7,113,936.06	0.02
488	600663	陆家嘴	1,106,300	6,947,564.00	0.02
489	600258	首旅酒店	633,800	6,921,096.00	0.02
490	600859	王府井	746,258	6,850,648.44	0.02
491	002091	江苏国泰	928,300	6,711,609.00	0.02
492	300070	碧水源	2,060,700	6,573,633.00	0.02
493	000069	华侨城 A	3,814,000	6,254,960.00	0.02
494	600864	哈投股份	1,178,301	6,115,382.19	0.02
495	301078	孩子王	841,100	5,685,836.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	842,900	5,529,424.00	0.02
497	603833	欧派家居	174,400	5,251,184.00	0.02
498	002891	中宠股份	184,365	4,926,232.80	0.02
499	600325	华发股份	2,086,600	4,820,046.00	0.02
500	002572	索菲亚	545,400	3,981,420.00	0.01

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.01
2	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
4	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
5	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
7	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
8	301680	固德电材	1,168	140,283.21	0.00
9	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
10	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
11	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
12	001393	维通利	1,287	63,383.13	0.00
13	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
14	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
15	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00

16	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
17	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
18	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
19	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
20	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
21	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
22	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
23	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
24	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
25	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
26	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
27	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
28	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
29	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
30	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
31	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
32	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
33	301449	天溯计量	156	6,037.20	0.00
34	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
35	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
36	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
37	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
38	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
39	920166	海圣医疗	100	2,145.00	0.00
40	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
41	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	688,693,331.45	1.39
2	300308	中际旭创	486,136,473.76	0.98
3	002371	北方华创	447,471,253.79	0.90
4	300502	新易盛	329,744,448.23	0.67
5	000333	美的集团	297,322,412.55	0.60
6	300394	天孚通信	246,868,026.91	0.50
7	002475	立讯精密	244,908,536.86	0.50
8	002594	比亚迪	236,250,046.05	0.48
9	300476	胜宏科技	208,375,215.41	0.42
10	300059	东方财富	207,496,874.05	0.42

11	600519	贵州茅台	190,738,721.16	0.39
12	000858	五 粮 液	187,469,162.39	0.38
13	300274	阳光电源	185,772,267.96	0.38
14	002384	东山精密	185,180,378.39	0.37
15	688041	海光信息	143,102,580.68	0.29
16	688498	源杰科技	140,958,346.86	0.29
17	300604	长川科技	136,192,337.39	0.28
18	000651	格力电器	134,549,483.67	0.27
19	002028	思源电气	132,866,193.62	0.27
20	000725	京东方 A	131,766,348.00	0.27

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,488,701,220.32	3.01
2	300308	中际旭创	1,103,973,773.36	2.23
3	300502	新易盛	701,596,753.30	1.42
4	002371	北方华创	626,425,016.76	1.27
5	000333	美的集团	599,353,128.19	1.21
6	002475	立讯精密	481,018,938.42	0.97
7	002594	比亚迪	440,517,154.72	0.89
8	300059	东方财富	414,883,891.36	0.84
9	300394	天孚通信	363,843,109.90	0.74
10	300274	阳光电源	354,087,811.31	0.72
11	300476	胜宏科技	353,920,214.03	0.72
12	000858	五 粮 液	337,657,602.20	0.68
13	002384	东山精密	322,926,926.04	0.65
14	000651	格力电器	269,036,706.32	0.54
15	000725	京东方 A	259,231,519.31	0.52
16	688256	寒武纪	252,340,681.18	0.51
17	002028	思源电气	229,962,751.13	0.47
18	000338	潍柴动力	219,364,211.55	0.44
19	002463	沪电股份	214,692,427.02	0.43
20	002714	牧原股份	204,407,238.72	0.41

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	14,954,594,154.84
卖出股票收入（成交）总额	24,913,834,013.74

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额

（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,542,070.97	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,542,070.97	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113704	春风转债	15,420	1,542,070.97	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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，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。

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	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.01	新股锁定期内
2	001248	华润新能源	595,206.03	0.00	新股锁定期内
2	001248	华润新能源	255,085.41	0.00	新股未上市

3	301666	大普微	565,262.60	0.00	新股锁定期内
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.00	新股锁定期内
5	688781	视涯科技	267,083.60	0.00	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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		华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
43,563	510,203.32	18,748,135,230.00	84.35	2,056,829,896.00	9.25	1,421,022,300.00	6.39

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	100.00	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2024 年 9 月 25 日) 基金份额总额	1,999,987,426.00
本报告期期初基金份额总额	39,229,987,426.00
本报告期基金总申购份额	16,950,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	33,954,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	22, 225, 987, 426. 00
--------------	-----------------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

经公司股东书面决定，谢仕荣先生于 2026 年 1 月 16 日起担任公司董事，陈健先生担任公司监事，Kirk Chester SWEENEY 先生不再担任公司董事，卢龙威先生不再担任公司监事。

经公司股东书面决定，刘晓冰先生于 2026 年 3 月 21 日起担任公司董事，徐珊女士担任公司监事，陆春光先生不再担任公司董事，刘晓冰先生不再担任公司监事。

经公司董事会审议通过，董辰先生于 2026 年 3 月 25 日起担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人重大人事变动：

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：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员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 (%)	
华泰证券	6	39,824,379.91 3.18	100.00	7,964,748.01	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、本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例(%)	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比例(%)

华泰证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配拓荆科技（688072）非公开发行 A 股的公告	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
3	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
4	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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 13 日
5	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
6	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
7	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 05 月 21 日
8	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 23 日
9	关于长江证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 22 日
10	关于国投证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 21 日
11	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
12	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 09 日
13	关于西部证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 08 日
14	关于财通证券股份有限公司为华泰	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 03 日

	柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告		
15	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 01 日
16	关于东莞证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 01 日
17	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
18	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 03 月 19 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金变更基金简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 日
20	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
21	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
22	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 02 月 04 日
23	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
24	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
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

机构	1	20260211- 20260630;	6,665,692 ,464.00	2,038,7 05,793. 00	2,883,800 ,487.00	5,820,597,770 .00	26.19
产品特有风险							
本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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