

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券
投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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	11
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内容的真实、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	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	41
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	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	69

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	69
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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§ 8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末上市基金前十名持有人	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
8.4 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	71
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
10.8 其他重大事件	74
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 1000
场内简称	中证 1000 (扩位证券简称: 中证 1000ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	516300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,012,592.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 24 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内, 年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	1、股票的投资策略; 2、存托凭证的投资策略; 3、债券投资策略; 4、股指期货的投资策略; 5、资产支持证券的投资策略; 6、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 采用完全复制的被动式投资策略, 具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征: 一方面, 相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高; 另一方面, 相对于采用抽样复制的指数型基金而言, 其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	韩鑫普
	联系电话	021-38601777	0755-82943666
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95565
传真		021-38601799	0755-82960794
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

邮政编码	200135	518000
法定代表人	贾波	霍达

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,140,368.71
本期利润	10,460,397.33
加权平均基金份额本期利润	0.2048
本期加权平均净值利润率	8.26%
本期基金份额净值增长率	8.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,784,558.29
期末可供分配基金份额利润	0.2510
期末基金资产净值	81,329,703.62
期末基金份额净值	2.6225
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.58%

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

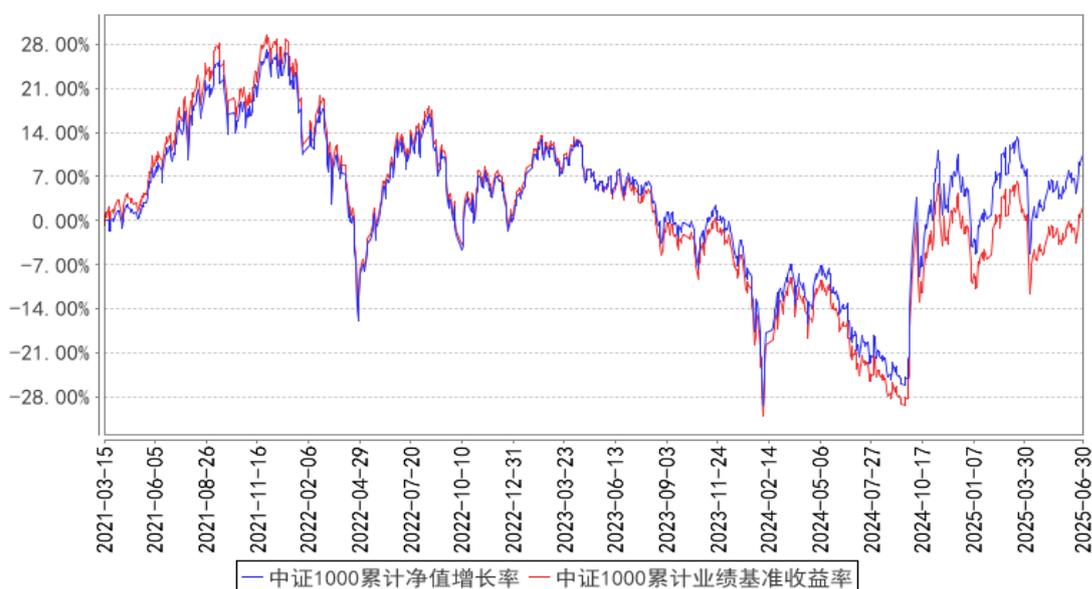
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	5.96%	0.93%	5.47%	0.94%	0.49%	-0.01%
过去三个月	3.22%	1.80%	2.08%	1.82%	1.14%	-0.02%
过去六个月	8.82%	1.62%	6.69%	1.64%	2.13%	-0.02%
过去一年	35.37%	1.94%	29.82%	1.97%	5.55%	-0.03%
过去三年	-0.78%	1.56%	-9.14%	1.58%	8.36%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.58%	1.51%	2.18%	1.54%	8.40%	-0.03%

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

中证1000累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2021 年 3 月 15 日至 2025 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、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）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 2025 年 6 月 30 日，公司旗下管理 179 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024年4月22日	2025年1月23日	6年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018年12月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
李茜	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2021年3月15日	2025年1月23日	10年	伦敦政治经济学院金融数学硕士。曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015年3月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员，现任指数投资部总监助理兼基金经理。2019年11月至2022年12月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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11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。2020年12月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年1月至2025年6月任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年2月至2024年5月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、华泰柏瑞中证动漫游戏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3月至2025年1月任华泰柏瑞中证1000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。2021年9月至2024年9月任华泰柏瑞中证港股通50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。2021年11月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年1月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年4月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022年12月起任华泰柏瑞中证香港300金融服务交

					<p>易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资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。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算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。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利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 3 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月起任华泰柏瑞中证 A50 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 9 月起任华泰柏瑞恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞恒生创新药交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
胡亦清	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2025 年 1 月 23 日	-	11 年	<p>硕士毕业于美国东北大学应用数学专业。2014 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任风险分析员、高级风险分析师、指数投资部高级研究员、总监助理兼投资经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞北证 50 成份指数型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
胡亦清	公募基金	8	3,007,484,075.70	2025年1月23日
	私募资产管理计划	6	937,248,424.08	2019年7月25日
	其他组合	-	-	-
	合计	14	3,944,732,499.78	-

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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，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 2 次，都为指数投资组合因跟踪指数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

本基金以完全复制中证 1000 指数为投资策略，产品回报主要取决于标的指数收益。2025 年上半年 A 股市场经历了波动收敛、回归常规状态的过程。一季度市场主要影响变量是 DeepSeek 带来的国内投资者对于 AI 理解的颠覆性变化，二季度在短暂的关税冲击后，指数便逐步回升，同

时波动率稳定在低位，6月下旬起核心宽基指数走出了一定的缓慢上行态势，上证指数于7月创下年内收盘新高。最终上半年沪深300微涨0.03%，中证500涨3.31%，中证1000涨6.69%，中小盘表现整体略强。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为0.04%，期间日跟踪误差为0.06%，较好地实现了本基金的投资目标。

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2.6225元，本报告期基金份额净值增长率为8.82%，业绩比较基准收益率为6.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近两月地缘冲击边际弱化，基本面继续缓慢修复，在相对成功的预期引导下，投资者对于经济的信心已基本夯实，叠加技术周期带来的推动力，底层逻辑依然维持正向。

当前市场状态与半年前比也发生了显著的变化，受宏观事件性的影响大幅缩减，市场更多以我为主，投资者相对更关注上市公司业绩相关的信息与预期变化，成交也较为活跃。本轮上涨前期市场仍呈现一定的犹豫，体现在涨速相对较慢，主因还是难觅与短期大涨匹配的逻辑，但雅江水电站项目的公布和“反内卷”的持续展开给上行提供了抓手，指数趋势逐步走好，朝右侧区间迈进。从市场位置来看，尽管价值水平较之前有所下降，但仍处于合理区间，结合业绩改善的预期和上行的趋势，市场可能具备拔估值的空间。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配4次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。截止本报告

期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 7,784,558.29 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,826,466.50	6,214,132.20
结算备付金		4,098,165.70	3,255,276.66
存出保证金		1,047,676.18	1,273,176.42
交易性金融资产	6.4.7.2	73,878,213.74	165,627,047.65
其中：股票投资		73,867,013.35	165,627,047.65
基金投资		-	-
债券投资		11,200.39	-
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		8,323.41	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		81,858,845.53	176,369,632.93
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	7,905.90
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		-	-
应付管理人报酬		34,878.35	73,152.60
应付托管费		6,975.68	14,630.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	52,829.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	487,287.88	259,478.54
负债合计		529,141.91	407,997.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	73,545,145.33	173,146,497.75
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,784,558.29	2,815,138.00
净资产合计		81,329,703.62	175,961,635.75
负债和净资产总计		81,858,845.53	176,369,632.93

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.6225 元，基金份额总额 31,012,592.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,006,010.85	-9,774,774.38
1. 利息收入		61,049.88	63,348.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	61,049.88	63,348.25
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）		9,711,269.31	-9,199,939.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,773,407.51	-10,521,720.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	13,029.69	12,953.26
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	293,692.16	269,279.84
股利收益	6.4.7.19	631,139.95	1,039,548.51
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	1,320,028.62	-1,457,247.32
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	-86,336.96	819,063.80
减：二、营业总支出		545,613.52	558,301.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	317,230.09	326,971.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	63,446.03	65,394.28
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		1, 293. 49	1, 358. 12
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	163, 643. 91	164, 577. 57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10, 460, 397. 33	-10, 333, 075. 81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10, 460, 397. 33	-10, 333, 075. 81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10, 460, 397. 33	-10, 333, 075. 81

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	173, 146, 497. 75	-	2, 815, 138. 00	175, 961, 635. 75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	173, 146, 497. 75	-	2, 815, 138. 00	175, 961, 635. 75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-99, 601, 352. 42	-	4, 969, 420. 29	-94, 631, 932. 13
（一）、综合收益总额	-	-	10, 460, 397. 33	10, 460, 397. 33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-99, 601, 352. 42	-	-5, 490, 977. 04	-105, 092, 329. 46
其中：1. 基金申购款	113, 830, 116. 98	-	5, 656, 862. 11	119, 486, 979. 09
2. 基金赎回	-213, 431, 469. 4	-	-11, 147, 839. 15	-224, 579, 308. 55

回款	0			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	73,545,145.33	-	7,784,558.29	81,329,703.62
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,500,000.00	-	-22,310,183.53	-19,810,183.53
(一)、综合收益总额	-	-	-10,333,075.81	-10,333,075.81
(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)	2,500,000.00	-	-11,977,107.72	-9,477,107.72
其中：1. 基金申购款	220,000,000.00	-	-41,256,923.83	178,743,076.17
2. 基金赎回款	-217,500,000.00	-	29,279,816.11	-188,220,183.89
(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	146,602,182.00	-	-26,845,624.31	119,756,557.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]第 235 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 222,600,550.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0294 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,602,182.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,632.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]118 号核准,本基金 222,602,182.00 份基金份额于 2021 年 3 月 24 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法

规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。本基金的业绩比较基准为中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2025 年 8 月 29 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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行为，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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	2,826,466.50
等于：本金	2,825,119.61
加：应计利息	1,346.89
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,826,466.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	69,596,235.29	-	73,867,013.35	4,270,778.06	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	11,200.00	0.39	11,200.39	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,200.00	0.39	11,200.39	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	69,607,435.29	0.39	73,878,213.74	4,270,778.06	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	6,962,600.00	-	-	
其中： 股指期货投资	6,962,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	6,962,600.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2509	中证1000股指期货 2509	4.00	4,924,480.00	256,120.00
IM2512	中证1000股指期货 2512	2.00	2,391,920.00	97,680.00
合计				353,800.00
减：可抵销期货暂收款				353,800.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

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 2025 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	22,629.75
其中：交易所市场	22,629.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	183,643.91
应退退补款	281,014.22

合计	487,287.88
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,012,592.00	173,146,497.75
本期申购	48,000,000.00	113,830,116.98
本期赎回（以“-”号填列）	-90,000,000.00	-213,431,469.40
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	31,012,592.00	73,545,145.33

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	11,899,817.32	-9,084,679.32	2,815,138.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,899,817.32	-9,084,679.32	2,815,138.00
本期利润	9,140,368.71	1,320,028.62	10,460,397.33
本期基金份额交易产生的变动数	-10,091,912.88	4,600,935.84	-5,490,977.04
其中：基金申购款	13,349,557.42	-7,692,695.31	5,656,862.11
基金赎回款	-23,441,470.30	12,293,631.15	-11,147,839.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,948,273.15	-3,163,714.86	7,784,558.29

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	活期存款利息收入	39,273.02
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	

结算备付金利息收入	21,304.30
其他	472.56
合计	61,049.88

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,117,947.08
股票投资收益——赎回差价收入	1,655,460.43
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	8,773,407.51

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	139,736,569.95
减：卖出股票成本总额	132,488,017.92
减：交易费用	130,604.95
买卖股票差价收入	7,117,947.08

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 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	224,579,308.55
减：现金支付赎回款总额	131,108,815.55
减：赎回股票成本总额	91,815,032.57
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,655,460.43

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	4.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,024.76
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	13,029.69

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	65,031.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,000.00
减：应计利息总额	4.54
减：交易费用	2.60
买卖债券差价收入	13,024.76

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	293,692.16

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	631,139.95
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	631,139.95

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	717,960.62
股票投资	717,960.62
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	601,320.00
权证投资	-
期货投资	601,320.00
3. 其他	748.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,320,028.62

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-86,336.96
合计	-86,336.96

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	74,383.76
IOPV 计算发布费	9,916.99
合计	163,643.91

6.4.7.24 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，不需要进行分部报告的披露。

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 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
招商证券	229,903,392.00	100.00	267,827,223.78	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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)

招商证券	65,031.90	100.00	107,060.87	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 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	45,984.77	100.00	22,629.75	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	228,109.24	100.00	45,069.53	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》，自2024年7月1日起，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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	317,230.09	326,971.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,436.65	6,509.82
应支付基金管理人的净管理费	310,793.44	320,461.64

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年6月30日	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	63,446.03	65,394.28

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
华泰证券股份 有限公司	944,315.00	3.0449	944,656.00	1.2938

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	301458	钧威电子	网下申购	4,833	50,263.20
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,274	47,887.92
上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	603312	西典新能	网下申购	479	13,900.58
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	1,559	33,877.07

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（2025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
001335	信凯科技	2025年4月2日	6个月	新股锁定期内	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股锁定期内	5.30	14.44	445	2,358.50	6,425.80	-
001382	新亚	2025年3月	6个月	新股锁定	7.40	20.21	288	2,131.20	5,820.48	-

	电缆	13 日		期内						
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定期内	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股 锁定期内	28.33	44.98	144	4,079.52	6,477.12	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 锁定期内	27.50	56.19	135	3,712.50	7,585.65	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 锁定期内	10.40	34.11	484	5,033.60	16,509.24	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股 锁定期内	41.90	77.87	116	3,477.70	9,032.92	含证 券送 配
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股 锁定期内	39.92	45.22	120	3,313.36	5,426.40	含证 券送 配
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁定期内	4.92	18.99	675	3,321.00	12,818.25	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股 锁定期内	16.50	27.45	141	2,326.50	3,870.45	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定期内	17.05	29.10	125	2,131.25	3,637.50	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股 锁定期内	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研	2025 年 1 月	6 个月	新股 锁定	6.70	24.80	655	4,388.50	16,244.00	-

	股份	15 日		期内						
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	33.06	47.46	68	2,248.08	3,227.28	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	11.80	22.98	295	3,481.00	6,779.10	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	26.60	82.50	112	2,979.20	9,240.00	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	10.27	22.39	317	3,255.59	7,097.63	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月以上	新股锁定期内	12.30	54.45	132	1,623.60	7,187.40	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	20.60	35.08	66	1,359.60	2,315.28	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	24.18	33.32	58	1,402.44	1,932.56	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	19.38	83.49	310	6,007.80	25,881.90	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	11.68	26.95	510	5,956.80	13,744.50	-
688583	思看	2025 年 1 月	6 个月	新股锁定	33.46	79.68	195	5,019.00	15,537.60	含证 券送

	科技	8 日		期内							配
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	9.08	25.94	528	4,794.24	13,696.32		-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69		-

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
118057	甬矽转债	2025 年 6 月 26 日	1 个月	配债未上市	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.18	-
127109	电化转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月	配债未上市	100.00	100.01	32	3,200.00	3,200.21	-

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中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，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	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
------	---	----	----	----	----	----	----	----	----	----

码	票名称	日期	原因	估值单价	日期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	
000627	*ST 天茂	2025 年 5 月 6 日	重大事项停牌	2.74	2025 年 7 月 8 日	2.60	29,000	106,725.75	79,460.00	-

注：本基金截至 2025 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，将风险控制可在可承受的范围内。

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 2025 年 6 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 0.01% (2024 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 2025 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 6.4.12。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 2025 年 06 月 30 日，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 2025年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,826,466.50	-	-	-	-	-	-2,826,466.50
结算备付金	4,098,165.70	-	-	-	-	-	-4,098,165.70
存出保证金	169,708.18	-	-	-	-	-877,968.00	1,047,676.18
交易性金融资	-	-	-	-	11,200.39	73,867,013	73,878,213.7

产							.35	4
应收清算款	-	-	-	-	-	-	8,323.41	8,323.41
资产总计	7,094,340.38	-	-	-	11,200.39	74,753,304.76	81,858,845.53	
负债								
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	34,878.35	34,878.35
应付托管费	-	-	-	-	-	-	6,975.68	6,975.68
其他负债	-	-	-	-	-	-	487,287.88	487,287.88
负债总计	-	-	-	-	-	-	529,141.91	529,141.91
利率敏感度缺口	7,094,340.38	-	-	-	11,200.39	74,224,162.85	81,329,703.62	
上年度末 2024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	6,214,132.20	-	-	-	-	-	6,214,132.20	
结算备付金	3,255,276.66	-	-	-	-	-	3,255,276.66	
存出保证金	285,101.22	-	-	-	-	-	988,075.20	
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	165,627,047.65	
资产总计	9,754,510.08	-	-	-	-	-	166,615,122.85	
负债								
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	7,905.90	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	73,152.60	
应付托管费	-	-	-	-	-	-	14,630.50	
应交税费	-	-	-	-	-	-	52,829.64	
其他负债	-	-	-	-	-	-	259,478.54	
负债总计	-	-	-	-	-	-	407,997.18	
利率敏感度缺口	9,754,510.08	-	-	-	-	-	166,207,125.67	

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 2025 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 0.01% (2024 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 (2024 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 2025年6月30日		上年度末 2024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	73,867,013.35	90.82	165,627,047.65	94.13
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	-	-	-7,905.90	-0.00
合计	73,867,013.35	90.82	165,619,141.75	94.12

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月）

			31 日)
	业绩比较基准上升 5%	3,987,247.68	8,579,533.75
	业绩比较基准下降 5%	-3,987,247.68	-8,579,533.75

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	73,552,204.30	165,113,248.69
第二层次	90,660.39	180,114.90
第三层次	235,349.05	333,684.06
合计	73,878,213.74	165,627,047.65

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 2025 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(2024 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 119,486,979.09 元(2024 年度:487,709,484.73 元)，其中包括以股票支付的申购款 40,823,685.10 元和以现金支付的申购款 78,663,293.99 元(2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 160,255,277.99 元和以现金支付的申购款 327,454,206.74 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	73,867,013.35	90.24
	其中：股票	73,867,013.35	90.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,200.39	0.01
	其中：债券	11,200.39	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,924,632.20	8.46
8	其他各项资产	1,055,999.59	1.29
9	合计	81,858,845.53	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	455,205.40	0.56
B	采矿业	1,677,053.72	2.06
C	制造业	47,510,877.62	58.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,866,917.60	2.30
E	建筑业	1,066,110.20	1.31
F	批发和零售业	2,531,107.45	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,772,544.00	2.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,861,942.95	12.13
J	金融业	2,123,380.02	2.61
K	房地产业	976,442.00	1.20
L	租赁和商务服务业	1,232,436.89	1.52
M	科学研究和技术服务业	829,818.54	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	607,422.55	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	240,546.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	769,086.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	73,520,890.94	90.40

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	-	-
C	制造业	239,145.39	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	79,460.00	0.10
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	25,273.02	0.03
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	346,122.41	0.43

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	002456	欧菲光	35,800	424,230.00	0.52
2	688019	安集科技	1,793	272,177.40	0.33
3	000766	通化金马	10,400	263,848.00	0.32
4	300779	惠城环保	1,400	249,886.00	0.31
5	688347	华虹公司	4,330	237,760.30	0.29
6	300468	四方精创	4,500	227,205.00	0.28
7	002402	和而泰	9,800	227,066.00	0.28
8	002126	银轮股份	9,000	218,520.00	0.27
9	002405	四维图新	25,500	217,770.00	0.27
10	300459	汤姆猫	37,800	211,680.00	0.26
11	300085	银之杰	4,600	202,676.00	0.25
12	300773	拉卡拉	6,000	200,700.00	0.25
13	300253	卫宁健康	18,800	199,280.00	0.25
14	603005	晶方科技	6,956	197,480.84	0.24
15	688266	泽璟制药	1,818	195,453.18	0.24
16	002389	航天彩虹	7,600	194,560.00	0.24
17	603236	移远通信	2,254	193,393.20	0.24
18	603300	华铁应急	17,120	190,888.00	0.23

19	002139	拓邦股份	13,400	185,054.00	0.23
20	300674	宇信科技	6,100	184,769.00	0.23
21	300568	星源材质	14,400	182,592.00	0.22
22	600100	同方股份	25,200	182,448.00	0.22
23	300170	汉得信息	10,500	180,705.00	0.22
24	300738	奥飞数据	8,472	177,318.96	0.22
25	300315	掌趣科技	29,200	177,244.00	0.22
26	688166	博瑞医药	3,297	177,081.87	0.22
27	300570	太辰光	1,800	173,484.00	0.21
28	600967	内蒙一机	8,900	172,215.00	0.21
29	300666	江丰电子	2,300	170,430.00	0.21
30	688018	乐鑫科技	1,166	170,352.60	0.21
31	300100	双林股份	3,600	169,488.00	0.21
32	603063	禾望电气	5,000	169,300.00	0.21
33	603766	隆鑫通用	13,200	168,432.00	0.21
34	600601	XR*ST 方	31,300	167,142.00	0.21
35	601677	明泰铝业	13,360	165,931.20	0.20
36	601777	力帆科技	19,400	164,706.00	0.20
37	688037	芯源微	1,536	164,659.20	0.20
38	300077	国民技术	6,400	163,840.00	0.20
39	300972	万辰集团	900	162,216.00	0.20
40	002335	科华数据	3,800	162,184.00	0.20
41	300088	长信科技	26,800	159,728.00	0.20
42	002245	蔚蓝锂芯	12,300	157,809.00	0.19
43	300182	捷成股份	28,600	157,586.00	0.19
44	300068	南都电源	9,600	152,832.00	0.19
45	300762	上海瀚讯	6,720	152,073.60	0.19
46	300348	长亮科技	8,700	151,293.00	0.19
47	688498	源杰科技	775	151,125.00	0.19
48	688208	道通科技	4,882	149,389.20	0.18
49	300130	新国都	4,200	149,226.00	0.18
50	300083	创世纪	17,900	147,138.00	0.18
51	002015	协鑫能科	10,500	146,265.00	0.18
52	688116	天奈科技	3,190	146,006.30	0.18
53	300672	国科微	1,700	144,364.00	0.18
54	002583	海能达	11,700	144,027.00	0.18
55	300432	富临精工	10,980	143,508.60	0.18
56	002400	省广集团	18,700	142,868.00	0.18
57	300409	道氏技术	8,400	142,296.00	0.17
58	300296	利亚德	23,300	142,130.00	0.17
59	300638	广和通	4,960	142,004.80	0.17
60	603920	世运电路	4,600	140,346.00	0.17
61	002497	雅化集团	12,300	140,220.00	0.17

62	300548	长芯博创	2,100	140,217.00	0.17
63	688200	华峰测控	968	139,585.60	0.17
64	688279	峰岹科技	752	139,496.00	0.17
65	600602	云赛智联	6,900	139,173.00	0.17
66	002222	福晶科技	4,010	137,142.00	0.17
67	600577	精达股份	18,400	136,896.00	0.17
68	300682	朗新集团	5,800	136,300.00	0.17
69	002487	大金重工	4,100	134,890.00	0.17
70	002151	北斗星通	4,700	134,843.00	0.17
71	600446	金证股份	7,100	134,687.00	0.17
72	600416	湘电股份	10,000	134,400.00	0.17
73	002506	协鑫集成	50,300	134,301.00	0.17
74	600114	东睦股份	6,600	134,244.00	0.17
75	300777	中简科技	3,700	134,125.00	0.16
76	600120	浙江东方	22,000	133,100.00	0.16
77	002176	江特电机	18,300	132,858.00	0.16
78	600259	广晟有色	2,500	132,800.00	0.16
79	603083	剑桥科技	2,800	132,440.00	0.16
80	600331	宏达股份	15,100	131,823.00	0.16
81	688333	铂力特	2,208	131,508.48	0.16
82	600388	ST 龙净	10,900	130,800.00	0.16
83	600559	老白干酒	7,800	130,650.00	0.16
84	603881	数据港	5,106	130,458.30	0.16
85	300181	佐力药业	7,500	129,975.00	0.16
86	600986	浙文互联	15,900	129,903.00	0.16
87	688536	思瑞浦	929	128,870.88	0.16
88	688343	云天励飞	2,604	128,689.68	0.16
89	002123	梦网科技	8,600	128,570.00	0.16
90	603613	国联股份	5,400	127,926.00	0.16
91	300180	华峰超纤	13,300	126,749.00	0.16
92	600323	瀚蓝环境	5,200	126,620.00	0.16
93	601020	华钰矿业	7,000	126,560.00	0.16
94	000099	中信海直	5,800	126,324.00	0.16
95	600072	中船科技	9,700	125,712.00	0.15
96	002276	万马股份	8,700	125,628.00	0.15
97	002171	楚江新材	12,900	125,517.00	0.15
98	002807	江阴银行	26,400	125,400.00	0.15
99	600728	佳都科技	22,800	124,260.00	0.15
100	002617	露笑科技	16,500	124,245.00	0.15
101	688484	南芯科技	3,126	123,633.30	0.15
102	000970	中科三环	10,500	123,585.00	0.15
103	300035	中科电气	7,300	123,224.00	0.15
104	601375	中原证券	29,600	123,136.00	0.15

105	301078	孩子王	9,400	122,858.00	0.15
106	688327	云从科技	8,867	122,275.93	0.15
107	002036	联创电子	11,300	122,153.00	0.15
108	601528	瑞丰银行	21,070	121,995.30	0.15
109	603306	华懋科技	2,800	121,800.00	0.15
110	300184	力源信息	12,400	121,768.00	0.15
111	601975	招商南油	41,700	121,764.00	0.15
112	603323	苏农银行	21,620	121,288.20	0.15
113	688088	虹软科技	2,512	121,204.00	0.15
114	300475	香农芯创	3,400	121,142.00	0.15
115	603444	吉比特	400	120,780.00	0.15
116	002249	大洋电机	18,300	120,414.00	0.15
117	600206	有研新材	6,300	120,393.00	0.15
118	300229	拓尔思	6,500	119,860.00	0.15
119	000581	威孚高科	6,300	119,322.00	0.15
120	688322	奥比中光	2,020	119,200.20	0.15
121	002174	游族网络	9,800	118,874.00	0.15
122	600761	安徽合力	6,700	118,858.00	0.15
123	002145	中核钛白	28,590	118,648.50	0.15
124	000875	吉电股份	23,400	118,404.00	0.15
125	603308	应流股份	5,100	117,708.00	0.14
126	300657	弘信电子	4,200	117,138.00	0.14
127	688005	容百科技	5,227	116,666.64	0.14
128	002268	电科网安	6,300	115,227.00	0.14
129	000686	东北证券	15,100	115,213.00	0.14
130	600186	莲花控股	19,200	115,200.00	0.14
131	000657	中钨高新	9,710	115,160.60	0.14
132	000917	电广传媒	15,200	114,912.00	0.14
133	688567	孚能科技	7,915	114,767.50	0.14
134	002701	奥瑞金	19,200	114,240.00	0.14
135	603678	火炬电子	3,000	114,090.00	0.14
136	600595	中孚实业	25,900	113,442.00	0.14
137	600285	羚锐制药	5,000	113,350.00	0.14
138	300101	振芯科技	5,000	113,150.00	0.14
139	002948	青岛银行	22,700	113,046.00	0.14
140	002484	江海股份	5,500	112,695.00	0.14
141	002354	天娱数科	17,700	112,395.00	0.14
142	002396	星网锐捷	5,000	112,250.00	0.14
143	600633	浙数文化	8,100	112,104.00	0.14
144	301316	慧博云通	2,600	112,008.00	0.14
145	002537	海联金汇	10,100	111,908.00	0.14
146	300953	震裕科技	1,100	111,485.00	0.14
147	002428	云南锗业	5,600	111,440.00	0.14

148	002747	埃斯顿	5,500	111,320.00	0.14
149	601718	际华集团	28,300	110,936.00	0.14
150	000422	湖北宜化	9,300	110,856.00	0.14
151	000737	北方铜业	10,200	110,772.00	0.14
152	601606	长城军工	3,800	110,390.00	0.14
153	300775	三角防务	4,100	110,126.00	0.14
154	300008	天海防务	14,900	110,111.00	0.14
155	002611	东方精工	9,100	109,746.00	0.13
156	002936	郑州银行	53,200	109,592.00	0.13
157	002317	众生药业	7,300	109,573.00	0.13
158	002075	沙钢股份	18,800	109,416.00	0.13
159	688331	荣昌生物	1,803	109,081.50	0.13
160	601519	大智慧	10,700	109,033.00	0.13
161	605111	新洁能	3,546	109,004.04	0.13
162	300045	华力创通	5,700	108,813.00	0.13
163	600338	西藏珠峰	9,800	108,682.00	0.13
164	003021	兆威机电	1,000	108,150.00	0.13
165	300624	万兴科技	1,737	107,780.85	0.13
166	002368	太极股份	4,600	107,732.00	0.13
167	001227	兰州银行	43,000	107,500.00	0.13
168	300133	华策影视	14,300	107,393.00	0.13
169	688123	聚辰股份	1,325	107,311.75	0.13
170	600850	电科数字	4,420	106,919.80	0.13
171	600216	浙江医药	7,200	106,488.00	0.13
172	000690	宝新能源	23,400	106,470.00	0.13
173	600759	ST 洲际	45,200	106,220.00	0.13
174	603699	纽威股份	3,400	105,978.00	0.13
175	300166	东方国信	9,700	105,730.00	0.13
176	603997	继峰股份	8,100	105,624.00	0.13
177	300009	安科生物	12,600	105,462.00	0.13
178	688629	华丰科技	1,843	105,419.60	0.13
179	002891	中宠股份	1,700	105,179.00	0.13
180	002488	金固股份	7,600	104,880.00	0.13
181	600771	广誉远	5,200	104,832.00	0.13
182	000681	视觉中国	5,200	104,728.00	0.13
183	688110	东芯股份	3,415	104,703.90	0.13
184	002681	奋达科技	15,400	104,258.00	0.13
185	603009	北特科技	2,500	104,250.00	0.13
186	600908	无锡银行	16,500	104,115.00	0.13
187	600667	太极实业	15,800	103,964.00	0.13
188	002265	建设工业	3,400	103,870.00	0.13
189	301050	雷电微力	1,940	103,402.00	0.13
190	000801	四川九洲	6,600	103,092.00	0.13

191	300723	一品红	2,050	102,746.00	0.13
192	600133	东湖高新	11,400	102,372.00	0.13
193	300438	鹏辉能源	3,700	102,157.00	0.13
194	000969	安泰科技	7,900	101,752.00	0.13
195	002019	亿帆医药	7,800	101,322.00	0.12
196	002698	博实股份	6,500	101,010.00	0.12
197	002544	普天科技	4,300	100,835.00	0.12
198	300113	顺网科技	5,100	100,776.00	0.12
199	002675	东诚药业	7,000	100,730.00	0.12
200	600718	东软集团	10,300	100,425.00	0.12
201	600064	南京高科	13,000	100,230.00	0.12
202	300276	三丰智能	9,100	100,100.00	0.12
203	300663	科蓝软件	5,100	100,062.00	0.12
204	603127	昭衍新药	4,700	98,841.00	0.12
205	000676	智度股份	10,800	98,496.00	0.12
206	600877	电科芯片	7,700	97,636.00	0.12
207	002221	东华能源	10,100	97,566.00	0.12
208	600456	宝钛股份	3,100	97,433.00	0.12
209	600641	万业企业	7,000	97,160.00	0.12
210	002212	天融信	12,600	97,020.00	0.12
211	002073	软控股份	10,900	96,901.00	0.12
212	600201	生物股份	12,000	96,240.00	0.12
213	002315	焦点科技	2,100	95,949.00	0.12
214	603662	柯力传感	1,500	95,895.00	0.12
215	300398	飞凯材料	4,800	95,856.00	0.12
216	300185	通裕重工	33,500	95,810.00	0.12
217	600480	凌云股份	7,870	95,777.90	0.12
218	601187	厦门银行	14,100	95,739.00	0.12
219	300303	聚飞光电	15,100	95,734.00	0.12
220	002270	华明装备	5,700	95,418.00	0.12
221	600330	天通股份	13,248	94,988.16	0.12
222	002416	爱施德	7,900	94,958.00	0.12
223	001309	德明利	800	94,672.00	0.12
224	300456	赛微电子	5,500	94,545.00	0.12
225	002839	张家港行	21,000	94,500.00	0.12
225	601860	紫金银行	31,500	94,500.00	0.12
226	300075	数字政通	5,300	94,446.00	0.12
227	300457	赢合科技	4,100	94,300.00	0.12
228	002847	盐津铺子	1,170	94,068.00	0.12
229	002048	宁波华翔	5,100	93,891.00	0.12
230	300493	润欣科技	4,400	93,588.00	0.12
231	300910	瑞丰新材	1,620	93,555.00	0.12
231	301171	易点天下	3,500	93,555.00	0.12

232	600320	振华重工	21,400	93,518.00	0.11
233	600993	马应龙	3,300	93,324.00	0.11
234	002649	博彦科技	6,400	92,992.00	0.11
235	605090	九丰能源	3,600	92,916.00	0.11
236	600645	中源协和	4,000	92,800.00	0.11
237	000902	新洋丰	6,700	92,661.00	0.11
238	601137	博威合金	5,200	92,508.00	0.11
239	002292	奥飞娱乐	9,500	92,340.00	0.11
240	688789	宏华数科	1,262	92,176.48	0.11
241	002182	宝武镁业	7,500	91,800.00	0.11
242	600552	凯盛科技	8,100	91,530.00	0.11
243	601678	滨化股份	22,100	91,494.00	0.11
244	601778	晶科科技	30,700	91,179.00	0.11
245	002906	华阳集团	2,800	91,028.00	0.11
246	000555	神州信息	6,400	91,008.00	0.11
247	600452	涪陵电力	9,886	90,951.20	0.11
248	300049	福瑞股份	2,800	90,804.00	0.11
249	603267	鸿远电子	1,800	90,486.00	0.11
250	603667	五洲新春	2,700	90,477.00	0.11
251	300655	晶瑞电材	9,020	90,290.20	0.11
252	300031	宝通科技	3,600	90,108.00	0.11
253	603108	润达医疗	5,100	90,066.00	0.11
254	688141	杰华特	2,763	90,018.54	0.11
255	002183	怡亚通	19,500	89,895.00	0.11
256	000829	天音控股	8,800	89,848.00	0.11
257	002654	万润科技	7,200	89,784.00	0.11
258	300079	数码视讯	15,300	89,505.00	0.11
259	300236	上海新阳	2,300	89,240.00	0.11
260	688050	爱博医疗	1,294	89,091.90	0.11
261	600366	宁波韵升	8,200	89,052.00	0.11
262	300687	赛意信息	3,200	88,896.00	0.11
263	600273	嘉化能源	10,500	88,830.00	0.11
264	002326	永太科技	6,900	88,803.00	0.11
265	600478	科力远	14,207	88,793.75	0.11
266	600210	紫江企业	13,000	88,790.00	0.11
267	000503	国新健康	8,400	88,788.00	0.11
268	600459	贵研铂业	5,700	88,407.00	0.11
269	601222	林洋能源	15,500	88,350.00	0.11
270	600399	抚顺特钢	16,900	88,218.00	0.11
270	603456	九洲药业	5,800	88,218.00	0.11
271	000682	东方电子	8,600	88,064.00	0.11
272	601963	重庆银行	8,100	87,966.00	0.11
273	603119	浙江荣泰	1,900	87,856.00	0.11

274	688029	南微医学	1,300	87,815.00	0.11
275	600179	安通控股	31,800	87,768.00	0.11
276	688192	迪哲医药	1,466	87,666.80	0.11
277	002745	木林森	11,100	87,468.00	0.11
278	600129	太极集团	4,100	87,371.00	0.11
279	600750	江中药业	4,000	87,320.00	0.11
280	600621	华鑫股份	5,700	87,267.00	0.11
281	688076	诺泰生物	2,343	87,206.46	0.11
282	300327	中颖电子	3,600	87,192.00	0.11
283	000762	西藏矿业	4,500	86,310.00	0.11
284	002539	云图控股	9,200	86,296.00	0.11
285	601126	四方股份	5,300	86,231.00	0.11
286	000680	山推股份	9,600	86,112.00	0.11
287	300850	新强联	2,400	85,968.00	0.11
288	300294	博雅生物	3,300	85,767.00	0.11
289	300352	北信源	15,500	85,715.00	0.11
290	002063	远光软件	14,400	85,680.00	0.11
291	002706	良信股份	9,600	85,536.00	0.11
292	000860	顺鑫农业	5,500	85,525.00	0.11
293	688548	广钢气体	8,514	85,310.28	0.10
294	600550	保变电气	9,900	85,140.00	0.10
295	000628	高新发展	2,000	85,060.00	0.10
296	600572	康恩贝	19,400	84,972.00	0.10
297	002597	金禾实业	3,600	84,780.00	0.10
298	300034	钢研高纳	5,080	84,480.40	0.10
299	300525	博思软件	5,800	84,448.00	0.10
300	600057	厦门象屿	12,000	84,360.00	0.10
301	600267	海正药业	9,100	84,175.00	0.10
302	002979	雷赛智能	1,900	84,132.00	0.10
303	300747	锐科激光	3,550	84,064.00	0.10
304	603883	老百姓	4,000	84,040.00	0.10
305	002020	京新药业	6,400	83,520.00	0.10
306	300026	红日药业	22,600	83,394.00	0.10
307	300718	长盛轴承	1,200	83,388.00	0.10
308	600933	爱柯迪	5,200	83,252.00	0.10
309	002010	传化智联	14,900	83,142.00	0.10
310	603360	百傲化学	3,700	83,139.00	0.10
311	002003	伟星股份	7,600	82,916.00	0.10
312	002716	湖南白银	21,200	82,680.00	0.10
313	600882	妙可蓝多	2,700	82,431.00	0.10
314	002239	奥特佳	28,400	82,360.00	0.10
315	000420	吉林化纤	21,100	82,290.00	0.10
316	300660	江苏雷利	1,860	82,286.40	0.10

317	600596	新安股份	10,157	82,271.70	0.10
318	301293	三博脑科	1,600	82,256.00	0.10
319	300618	寒锐钴业	2,300	82,156.00	0.10
320	300598	诚迈科技	1,930	82,121.50	0.10
321	688502	茂莱光学	285	81,983.10	0.10
322	688409	富创精密	1,489	81,909.89	0.10
323	688596	正帆科技	2,412	81,815.04	0.10
324	600821	金开新能	15,000	81,450.00	0.10
325	300298	三诺生物	3,600	81,324.00	0.10
326	600635	大众公用	20,800	81,120.00	0.10
327	300036	超图软件	5,300	80,878.00	0.10
328	300925	法本信息	3,200	80,576.00	0.10
329	300319	麦捷科技	7,500	80,550.00	0.10
330	603583	捷昌驱动	2,200	80,344.00	0.10
331	000035	中国天楹	18,700	80,223.00	0.10
332	600037	歌华有线	10,500	80,220.00	0.10
333	600422	昆药集团	5,600	80,136.00	0.10
334	600864	哈投股份	13,400	79,998.00	0.10
335	688083	中望软件	1,241	79,932.81	0.10
336	300027	华谊兄弟	29,800	79,864.00	0.10
337	300102	乾照光电	6,900	79,833.00	0.10
338	000612	焦作万方	10,300	79,722.00	0.10
339	000795	英洛华	7,300	79,278.00	0.10
340	600461	洪城环境	8,200	79,048.00	0.10
341	603220	中贝通信	3,680	79,009.60	0.10
342	300244	迪安诊断	5,300	78,970.00	0.10
343	603337	杰克股份	2,200	78,936.00	0.10
344	002987	京北方	3,785	78,917.25	0.10
345	002011	盾安环境	6,800	78,880.00	0.10
346	000156	华数传媒	9,900	78,606.00	0.10
347	600827	百联股份	8,600	78,604.00	0.10
348	300634	彩讯股份	2,900	78,590.00	0.10
349	301297	富乐德	1,900	78,527.00	0.10
350	002215	诺普信	7,600	78,508.00	0.10
351	600587	新华医疗	5,170	78,273.80	0.10
352	603619	中曼石油	3,900	78,273.00	0.10
353	603393	新天然气	2,700	78,165.00	0.10
354	000837	秦川机床	6,500	78,130.00	0.10
355	001301	尚太科技	1,600	78,016.00	0.10
356	600151	航天机电	10,700	78,003.00	0.10
357	603039	ST 泛微	1,400	77,980.00	0.10
358	002332	仙琚制药	8,500	77,945.00	0.10
359	300693	盛弘股份	2,600	77,896.00	0.10

360	688336	三生国健	1,435	77,834.40	0.10
361	600055	万东医疗	4,500	77,760.00	0.10
362	603871	嘉友国际	7,200	77,400.00	0.10
363	600789	鲁抗医药	7,700	77,077.00	0.09
364	002091	江苏国泰	10,600	77,062.00	0.09
365	688016	心脉医疗	869	76,836.98	0.09
366	600420	国药现代	7,200	76,680.00	0.09
367	002045	国光电器	4,800	76,608.00	0.09
368	600835	上海机电	3,600	76,500.00	0.09
369	300224	正海磁材	5,400	76,410.00	0.09
370	688543	国科军工	1,264	76,080.16	0.09
371	300678	中科信息	2,200	76,076.00	0.09
372	688700	东威科技	1,925	75,941.25	0.09
373	002421	达实智能	22,600	75,936.00	0.09
374	000089	深圳机场	11,000	75,900.00	0.09
374	300188	国投智能	5,500	75,900.00	0.09
375	688063	派能科技	1,683	75,869.64	0.09
376	600315	上海家化	3,600	75,852.00	0.09
377	000901	航天科技	6,100	75,823.00	0.09
378	002324	普利特	7,100	75,473.00	0.09
379	002541	鸿路钢构	4,500	75,330.00	0.09
380	688321	微芯生物	3,161	75,168.58	0.09
381	600246	万通发展	12,300	75,153.00	0.09
382	300451	创业慧康	13,300	75,145.00	0.09
383	300576	容大感光	2,020	75,043.00	0.09
384	000758	中色股份	14,900	74,947.00	0.09
385	000712	锦龙股份	5,700	74,841.00	0.09
386	688390	固德威	1,716	74,560.20	0.09
387	300776	帝尔激光	1,400	74,494.00	0.09
388	600916	中国黄金	9,100	74,347.00	0.09
389	002237	恒邦股份	6,300	74,340.00	0.09
390	000915	华特达因	2,100	74,235.00	0.09
391	600059	古越龙山	6,800	74,188.00	0.09
392	688289	圣湘生物	3,622	74,178.56	0.09
393	300811	铂科新材	1,592	73,884.72	0.09
394	300284	苏交科	8,100	73,710.00	0.09
395	688362	甬矽电子	2,474	73,675.72	0.09
396	603588	高能环境	13,040	73,545.60	0.09
397	002127	南极电商	18,500	73,445.00	0.09
398	601890	亚星锚链	7,200	73,368.00	0.09
399	002567	唐人神	15,400	73,304.00	0.09
400	600428	中远海特	11,700	73,125.00	0.09
401	688372	伟测科技	1,210	73,084.00	0.09

402	000810	创维数字	6,200	73,036.00	0.09
403	688131	皓元医药	1,509	72,960.15	0.09
404	600490	鹏欣资源	16,600	72,874.00	0.09
405	688522	纳睿雷达	1,422	72,834.84	0.09
406	600458	时代新材	5,300	72,716.00	0.09
407	688630	芯碁微装	916	72,702.92	0.09
408	603505	金石资源	3,336	72,457.92	0.09
409	301511	德福科技	3,500	72,450.00	0.09
410	002100	天康生物	11,700	72,423.00	0.09
411	600328	中盐化工	9,460	72,369.00	0.09
412	000811	冰轮环境	7,380	72,324.00	0.09
413	300357	我武生物	3,500	72,240.00	0.09
414	600063	皖维高新	15,700	71,906.00	0.09
415	600252	中恒集团	28,300	71,599.00	0.09
416	002149	西部材料	3,600	71,460.00	0.09
417	002557	洽洽食品	3,300	71,346.00	0.09
418	301035	润丰股份	1,200	71,208.00	0.09
419	600782	新钢股份	20,100	71,154.00	0.09
420	688062	迈威生物	2,513	71,067.64	0.09
421	600185	格力地产	12,100	71,027.00	0.09
422	603690	至纯科技	2,840	70,971.60	0.09
423	000727	冠捷科技	29,200	70,956.00	0.09
424	002338	奥普光电	1,500	70,950.00	0.09
425	002929	润建股份	1,500	70,890.00	0.09
426	688048	长光华芯	1,225	70,731.50	0.09
427	600717	天津港	15,500	70,680.00	0.09
428	300415	伊之密	3,500	70,525.00	0.09
429	002004	华邦健康	16,900	70,473.00	0.09
430	002643	万润股份	6,100	70,211.00	0.09
431	688439	振华风光	1,205	70,191.25	0.09
432	600116	三峡水利	10,200	69,870.00	0.09
433	300470	中密控股	1,900	69,863.00	0.09
434	603218	日月股份	5,500	69,795.00	0.09
435	688559	海目星	2,121	69,780.90	0.09
436	300725	药石科技	1,800	69,660.00	0.09
437	002626	金达威	3,400	69,564.00	0.09
438	603358	华达科技	2,100	69,531.00	0.09
439	002468	申通快递	6,500	69,485.00	0.09
440	000685	中山公用	7,900	69,362.00	0.09
441	600556	天下秀	13,600	69,360.00	0.09
442	000923	河钢资源	5,000	69,200.00	0.09
443	600158	中体产业	8,200	69,126.00	0.08
444	300260	新莱应材	2,100	69,048.00	0.08

445	300827	上能电气	2,259	69,012.45	0.08
446	605376	博迁新材	1,800	68,994.00	0.08
447	002254	泰和新材	6,400	68,992.00	0.08
448	688326	经纬恒润	773	68,982.52	0.08
449	688091	上海谊众	1,474	68,953.72	0.08
450	002550	千红制药	8,200	68,880.00	0.08
451	688503	聚和材料	1,659	68,666.01	0.08
452	601311	骆驼股份	7,600	68,628.00	0.08
453	600729	重庆百货	2,300	68,609.00	0.08
454	002408	齐翔腾达	15,300	68,544.00	0.08
454	002531	天顺风能	9,600	68,544.00	0.08
455	688696	极米科技	599	68,501.64	0.08
456	688612	威迈斯	2,559	68,427.66	0.08
457	300633	开立医疗	2,300	68,356.00	0.08
458	300482	万孚生物	3,200	68,320.00	0.08
459	002023	海特高新	6,300	68,166.00	0.08
460	002928	华夏航空	8,200	68,142.00	0.08
461	603612	索通发展	3,700	68,006.00	0.08
462	300602	飞荣达	3,200	67,872.00	0.08
463	300783	三只松鼠	2,500	67,775.00	0.08
464	002779	中坚科技	900	67,743.00	0.08
465	002192	融捷股份	2,200	67,408.00	0.08
466	300232	洲明科技	9,300	67,332.00	0.08
467	002079	苏州固锟	6,900	67,275.00	0.08
468	000065	北方国际	5,700	67,260.00	0.08
469	600211	西藏药业	1,820	67,012.40	0.08
470	688766	普冉股份	1,060	66,992.00	0.08
471	688779	长远锂科	12,308	66,955.52	0.08
472	300761	立华股份	3,560	66,892.40	0.08
473	600996	贵广网络	8,000	66,720.00	0.08
474	000927	中国铁物	25,900	66,563.00	0.08
475	300323	华灿光电	8,700	66,555.00	0.08
475	603305	旭升集团	5,100	66,555.00	0.08
476	002099	海翔药业	12,100	66,550.00	0.08
477	600509	天富能源	10,300	66,435.00	0.08
478	688403	汇成股份	6,383	66,319.37	0.08
479	301291	明阳电气	1,611	66,292.65	0.08
480	002097	山河智能	8,000	66,160.00	0.08
481	688270	臻镭科技	1,420	66,115.20	0.08
482	300841	康华生物	1,000	65,970.00	0.08
483	002096	易普力	5,300	65,773.00	0.08
484	002815	崇达技术	5,800	65,714.00	0.08
485	002226	江南化工	11,300	65,540.00	0.08

486	000603	盛达资源	4,400	65,516.00	0.08
487	301091	深城交	2,240	65,497.60	0.08
488	002895	川恒股份	2,900	65,424.00	0.08
489	688400	凌云光	2,373	65,423.61	0.08
490	688262	国芯科技	2,449	65,314.83	0.08
491	000650	仁和药业	12,000	65,040.00	0.08
492	002881	美格智能	1,400	64,960.00	0.08
493	601369	陕鼓动力	7,400	64,898.00	0.08
494	301155	海力风电	900	64,710.00	0.08
495	600507	方大特钢	14,900	64,666.00	0.08
496	600409	三友化工	13,300	64,638.00	0.08
497	300685	艾德生物	3,000	64,590.00	0.08
498	300772	运达股份	5,000	64,400.00	0.08
499	300726	宏达电子	1,800	64,350.00	0.08
500	002351	漫步者	4,900	64,288.00	0.08
501	301219	腾远钴业	1,210	64,275.20	0.08
502	603027	千禾味业	5,520	64,087.20	0.08
503	002006	精工科技	3,900	64,077.00	0.08
504	300593	新雷能	4,780	64,052.00	0.08
505	688709	成都华微	1,956	64,039.44	0.08
506	002093	国脉科技	5,400	63,882.00	0.08
506	300580	贝斯特	2,600	63,882.00	0.08
507	300641	正丹股份	2,800	63,812.00	0.08
508	600269	赣粤高速	12,600	63,756.00	0.08
509	600961	株冶集团	5,700	63,726.00	0.08
510	002194	武汉凡谷	4,400	63,624.00	0.08
511	601208	东材科技	6,700	63,516.00	0.08
512	600531	豫光金铅	8,200	63,468.00	0.08
513	301039	中集车辆	7,800	63,414.00	0.08
514	300870	欧陆通	500	63,250.00	0.08
515	301510	固高科技	2,100	63,105.00	0.08
516	600643	爱建集团	8,500	63,070.00	0.08
517	002947	恒铭达	1,900	63,061.00	0.08
518	300087	荃银高科	7,040	63,008.00	0.08
519	600012	皖通高速	3,700	62,826.00	0.08
520	603599	广信股份	5,860	62,526.20	0.08
521	603197	保隆科技	1,600	62,512.00	0.08
522	603533	掌阅科技	2,800	62,468.00	0.08
523	002690	美亚光电	3,700	62,419.00	0.08
524	300446	航天智造	3,600	62,352.00	0.08
525	600597	光明乳业	7,400	62,234.00	0.08
526	600138	中青旅	6,300	62,055.00	0.08
527	301061	匠心家居	800	62,032.00	0.08

528	002867	周大生	4,700	61,946.00	0.08
529	600123	兰花科创	9,490	61,874.80	0.08
530	603496	恒为科技	2,400	61,776.00	0.08
531	301029	怡合达	2,700	61,722.00	0.08
532	300226	上海钢联	2,700	61,668.00	0.08
533	600866	星湖科技	8,900	61,499.00	0.08
534	002204	大连重工	10,300	61,491.00	0.08
535	600006	东风汽车	8,500	61,455.00	0.08
536	000821	京山轻机	5,300	61,427.00	0.08
537	002605	姚记科技	2,200	61,380.00	0.08
537	600888	新疆众和	9,000	61,380.00	0.08
538	600773	西藏城投	6,100	61,366.00	0.08
539	600623	华谊集团	8,100	61,317.00	0.08
540	688408	中信博	1,313	61,290.84	0.08
541	300620	光库科技	1,300	61,243.00	0.08
542	002761	浙江建投	6,900	61,203.00	0.08
543	000848	承德露露	6,700	61,171.00	0.08
544	002925	盈趣科技	3,400	61,132.00	0.08
545	002163	海南发展	6,400	61,056.00	0.08
546	688556	高测股份	8,493	60,979.74	0.07
547	600248	陕建股份	16,000	60,960.00	0.07
547	600869	远东股份	12,000	60,960.00	0.07
548	300401	花园生物	4,000	60,840.00	0.07
549	000589	贵州轮胎	13,300	60,781.00	0.07
550	600017	日照港	19,600	60,760.00	0.07
551	000735	罗牛山	9,800	60,466.00	0.07
552	002727	一心堂	3,700	60,458.00	0.07
553	603283	赛腾股份	1,780	60,413.20	0.07
554	600266	城建发展	13,300	60,382.00	0.07
555	600757	长江传媒	6,500	60,320.00	0.07
556	600502	安徽建工	12,800	60,160.00	0.07
557	300770	新媒股份	1,500	59,985.00	0.07
558	300360	炬华科技	3,800	59,850.00	0.07
559	300363	博腾股份	3,500	59,780.00	0.07
560	603026	胜华新材	1,600	59,664.00	0.07
561	601900	南方传媒	3,800	59,432.00	0.07
562	688332	中科蓝讯	576	59,374.08	0.07
563	605507	国邦医药	3,000	59,310.00	0.07
564	601595	上海电影	2,000	59,280.00	0.07
565	600664	哈药股份	16,100	59,248.00	0.07
566	601069	西部黄金	2,900	59,015.00	0.07
567	688139	海尔生物	1,904	58,814.56	0.07
568	000012	南玻 A	12,700	58,674.00	0.07

568	002545	东方铁塔	6,600	58,674.00	0.07
569	002081	金螳螂	17,100	58,653.00	0.07
570	001287	中电港	3,200	58,592.00	0.07
571	600389	江山股份	3,150	58,590.00	0.07
572	300492	华图山鼎	860	58,376.80	0.07
573	600649	城投控股	13,600	58,344.00	0.07
574	000935	四川双马	3,200	58,304.00	0.07
575	300337	银邦股份	5,300	58,300.00	0.07
576	300119	瑞普生物	3,000	58,260.00	0.07
577	601952	苏垦农发	5,900	58,233.00	0.07
578	301589	诺瓦星云	400	58,132.00	0.07
579	002125	湘潭电化	4,000	58,120.00	0.07
580	688106	金宏气体	3,247	58,088.83	0.07
581	002993	奥海科技	1,400	58,058.00	0.07
582	688776	国光电气	550	58,014.00	0.07
583	002458	益生股份	7,100	58,007.00	0.07
584	603227	雪峰科技	6,900	57,822.00	0.07
585	002832	比音勒芬	3,600	57,780.00	0.07
586	000928	中钢国际	9,200	57,776.00	0.07
587	600575	淮河能源	16,500	57,585.00	0.07
588	301205	联特科技	600	57,516.00	0.07
589	603368	柳药集团	3,400	57,494.00	0.07
590	601200	上海环境	7,220	57,326.80	0.07
591	300613	富瀚微	1,170	57,189.60	0.07
592	002061	浙江交科	14,420	57,103.20	0.07
593	002233	塔牌集团	7,700	56,980.00	0.07
594	600776	东方通信	5,100	56,814.00	0.07
595	603100	川仪股份	2,750	56,732.50	0.07
596	688631	莱斯信息	636	56,731.20	0.07
597	002668	TCL 智家	5,800	56,666.00	0.07
598	002777	久远银海	3,100	56,606.00	0.07
599	002518	科士达	2,500	56,475.00	0.07
600	603118	共进股份	5,000	56,350.00	0.07
601	000552	甘肃能化	22,800	56,316.00	0.07
602	002258	利尔化学	5,100	56,304.00	0.07
603	002967	广电计量	3,200	56,288.00	0.07
604	301095	广立微	1,000	56,240.00	0.07
605	600812	华北制药	9,100	56,238.00	0.07
606	600675	中华企业	19,500	56,160.00	0.07
607	688190	云路股份	603	55,813.68	0.07
608	603171	税友股份	1,300	55,783.00	0.07
609	688739	成大生物	2,111	55,730.40	0.07
610	001914	招商积余	4,500	55,665.00	0.07

611	605599	莱百股份	3,400	55,590.00	0.07
612	603477	巨星农牧	2,700	55,566.00	0.07
613	600217	中再资环	12,400	55,552.00	0.07
614	688352	颀中科技	4,946	55,543.58	0.07
615	002588	史丹利	6,300	55,503.00	0.07
616	002892	科力尔	3,980	55,441.40	0.07
617	002038	双鹭药业	7,800	55,302.00	0.07
618	000930	中粮科技	9,900	55,242.00	0.07
619	603279	景津装备	3,700	55,241.00	0.07
620	603169	兰石重装	7,000	55,160.00	0.07
621	688165	埃夫特	2,156	55,021.12	0.07
622	688206	概伦电子	1,891	54,990.28	0.07
623	000059	华锦股份	10,200	54,978.00	0.07
624	688690	纳微科技	2,408	54,974.64	0.07
625	600125	铁龙物流	9,700	54,902.00	0.07
626	600305	恒顺醋业	7,100	54,883.00	0.07
627	300463	迈克生物	4,600	54,740.00	0.07
628	300455	航天智装	3,800	54,720.00	0.07
629	605123	派克新材	700	54,530.00	0.07
630	600787	中储股份	9,300	54,498.00	0.07
631	300171	东富龙	4,100	54,489.00	0.07
632	300416	苏试试验	3,800	54,454.00	0.07
633	600775	南京熊猫	5,000	54,450.00	0.07
634	600751	海航科技	16,600	54,448.00	0.07
635	000049	德赛电池	2,390	54,396.40	0.07
636	002705	新宝股份	3,700	54,390.00	0.07
637	603383	顶点软件	1,280	54,272.00	0.07
638	300443	金雷股份	2,400	54,240.00	0.07
639	301031	中熔电气	680	54,162.00	0.07
640	603876	鼎胜新材	5,940	53,994.60	0.07
641	600395	盘江股份	11,400	53,922.00	0.07
642	600301	华锡有色	2,700	53,919.00	0.07
643	603516	淳中科技	1,500	53,850.00	0.07
644	600710	苏美达	5,600	53,816.00	0.07
645	300393	中来股份	9,300	53,568.00	0.07
646	688150	莱特光电	2,164	53,494.08	0.07
647	300913	兆龙互连	1,140	53,374.80	0.07
648	000028	国药一致	2,140	53,350.20	0.07
649	603713	密尔克卫	1,000	53,320.00	0.07
650	600557	康缘药业	3,600	53,208.00	0.07
651	000600	建投能源	7,700	53,207.00	0.07
652	002077	大港股份	3,700	53,058.00	0.07
653	002243	力合科创	6,500	53,040.00	0.07

654	603508	思维列控	2,000	52,960.00	0.07
655	601869	长飞光纤	1,300	52,936.00	0.07
656	000029	深深房 A	2,800	52,696.00	0.06
657	603888	新华网	2,200	52,668.00	0.06
658	688516	奥特维	1,581	52,552.44	0.06
659	603056	德邦股份	3,300	52,536.00	0.06
660	000913	钱江摩托	3,500	52,500.00	0.06
661	601702	华峰铝业	3,300	52,437.00	0.06
662	301487	盟固利	2,400	52,392.00	0.06
663	000881	中广核技	6,100	52,338.00	0.06
664	688127	蓝特光学	2,029	52,165.59	0.06
665	688300	联瑞新材	1,119	52,089.45	0.06
666	603128	华贸物流	8,400	52,080.00	0.06
667	600033	福建高速	14,700	52,038.00	0.06
668	003006	百亚股份	1,900	52,022.00	0.06
669	603328	依顿电子	5,300	51,993.00	0.06
670	002043	兔宝宝	5,300	51,940.00	0.06
671	688575	亚辉龙	3,551	51,809.09	0.06
672	300596	利安隆	1,800	51,786.00	0.06
673	600586	金晶科技	10,700	51,681.00	0.06
674	600073	上海梅林	7,000	51,660.00	0.06
675	601908	京运通	15,400	51,590.00	0.06
676	688007	光峰科技	3,566	51,564.36	0.06
677	300261	雅本化学	7,200	51,480.00	0.06
678	600094	大名城	16,600	51,460.00	0.06
679	002985	北摩高科	1,700	51,425.00	0.06
680	300705	九典制药	3,300	51,381.00	0.06
681	002434	万里扬	7,000	51,310.00	0.06
682	301071	力量钻石	1,720	51,273.20	0.06
683	600976	健民集团	1,300	50,973.00	0.06
684	600740	山西焦化	13,700	50,827.00	0.06
685	600313	农发种业	8,100	50,706.00	0.06
686	002378	章源钨业	6,410	50,703.10	0.06
687	688306	均普智能	5,126	50,439.84	0.06
688	688366	昊海生科	984	50,420.16	0.06
689	600894	广日股份	4,800	50,352.00	0.06
690	002737	葵花药业	3,200	50,304.00	0.06
690	300821	东岳硅材	6,400	50,304.00	0.06
691	300134	大富科技	4,100	50,143.00	0.06
692	000966	长源电力	11,100	49,950.00	0.06
693	300129	泰胜风能	7,000	49,770.00	0.06
694	600963	岳阳林纸	11,200	49,616.00	0.06
695	601326	秦港股份	15,300	49,419.00	0.06

696	603033	三维股份	4,393	49,245.53	0.06
697	000756	新华制药	3,300	49,236.00	0.06
698	000090	天健集团	13,900	49,206.00	0.06
699	300428	立中集团	2,700	49,194.00	0.06
700	601163	三角轮胎	3,500	49,175.00	0.06
701	000990	诚志股份	6,500	49,140.00	0.06
702	002068	黑猫股份	4,800	49,008.00	0.06
703	600975	新五丰	8,100	49,005.00	0.06
704	688006	杭可科技	2,513	49,003.50	0.06
705	603919	金徽酒	2,700	48,870.00	0.06
706	300855	图南股份	2,040	48,511.20	0.06
707	300527	中船应急	5,300	48,389.00	0.06
708	600682	南京新百	7,200	48,384.00	0.06
708	605020	永和股份	2,100	48,384.00	0.06
709	300579	数字认证	1,400	48,314.00	0.06
710	600651	飞乐音响	10,700	48,150.00	0.06
711	688652	京仪装备	840	48,148.80	0.06
712	688549	中巨芯	6,200	47,988.00	0.06
713	002219	新里程	21,800	47,960.00	0.06
714	000557	西部创业	9,400	47,940.00	0.06
715	000688	国城矿业	3,600	47,916.00	0.06
716	002498	汉缆股份	14,100	47,658.00	0.06
717	002399	海普瑞	4,000	47,640.00	0.06
718	002635	安洁科技	3,500	47,390.00	0.06
719	601619	嘉泽新能	13,200	47,256.00	0.06
720	601096	宏盛华源	11,400	47,196.00	0.06
720	603008	喜临门	2,700	47,196.00	0.06
721	000767	晋控电力	16,500	47,190.00	0.06
722	000828	东莞控股	4,400	47,036.00	0.06
723	601500	通用股份	10,200	47,022.00	0.06
724	603093	南华期货	2,100	46,893.00	0.06
725	603636	南威软件	3,700	46,768.00	0.06
726	688107	安路科技	1,652	46,652.48	0.06
727	600477	杭萧钢构	17,600	46,640.00	0.06
728	002154	报喜鸟	12,400	46,624.00	0.06
729	002897	意华股份	1,200	46,548.00	0.06
730	600075	新疆天业	11,000	46,530.00	0.06
731	002320	海峡股份	7,100	46,434.00	0.06
732	601969	海南矿业	6,400	46,400.00	0.06
733	002511	中顺洁柔	6,900	46,368.00	0.06
734	002755	奥赛康	2,900	46,342.00	0.06
735	600861	北京人力	2,400	46,320.00	0.06
736	600197	伊力特	3,100	46,252.00	0.06

737	301325	曼恩斯特	740	46,102.00	0.06
738	001337	四川黄金	1,900	46,037.00	0.06
739	000061	农产品	7,200	46,008.00	0.06
740	000950	重药控股	9,200	45,908.00	0.06
741	603866	桃李面包	8,500	45,900.00	0.06
742	600020	中原高速	9,600	45,888.00	0.06
743	002859	洁美科技	2,300	45,793.00	0.06
744	601515	东峰集团	11,980	45,763.60	0.06
745	002051	中工国际	5,300	45,739.00	0.06
746	603733	仙鹤股份	2,200	45,628.00	0.06
747	601101	昊华能源	6,300	45,612.00	0.06
748	603072	天和磁材	832	45,596.40	0.06
749	603638	艾迪精密	2,600	45,474.00	0.06
750	601033	永兴股份	2,875	45,453.75	0.06
751	001203	大中矿业	4,800	45,360.00	0.06
752	300406	九强生物	3,200	45,280.00	0.06
753	002274	华昌化工	6,200	45,136.00	0.06
754	002960	青鸟消防	4,616	45,098.32	0.06
755	688639	华恒生物	1,422	45,077.40	0.06
756	688185	康希诺	755	45,020.65	0.06
757	601609	金田股份	6,400	44,864.00	0.06
758	000550	江铃汽车	2,200	44,726.00	0.05
758	300861	美畅股份	2,200	44,726.00	0.05
759	000048	京基智农	2,800	44,520.00	0.05
759	601827	三峰环境	5,300	44,520.00	0.05
760	688003	天准科技	968	44,431.20	0.05
761	601801	皖新传媒	6,500	44,395.00	0.05
762	600223	福瑞达	5,400	44,388.00	0.05
763	688146	中船特气	1,533	44,319.03	0.05
764	301238	瑞泰新材	2,300	44,206.00	0.05
765	688658	悦康药业	2,315	44,077.60	0.05
766	000791	甘肃能源	6,900	44,022.00	0.05
767	301526	国际复材	12,085	43,989.40	0.05
768	600169	太原重工	18,100	43,802.00	0.05
769	002101	广东鸿图	3,500	43,785.00	0.05
770	002390	信邦制药	12,500	43,500.00	0.05
771	688432	有研硅	3,927	43,354.08	0.05
772	300151	昌红科技	3,500	43,085.00	0.05
773	600475	华光环能	4,100	42,722.00	0.05
774	600640	国脉文化	3,500	42,420.00	0.05
775	300257	开山股份	4,200	42,294.00	0.05
776	688686	奥普特	442	42,264.04	0.05
777	600971	恒源煤电	6,400	42,240.00	0.05

778	688515	裕太微	461	42,227.60	0.05
779	000719	中原传媒	3,400	42,194.00	0.05
780	600449	宁夏建材	3,200	42,112.00	0.05
781	002060	广东建工	12,100	42,108.00	0.05
782	002489	浙江永强	11,500	42,090.00	0.05
783	603099	长白山	1,100	41,866.00	0.05
784	603348	文灿股份	2,000	41,760.00	0.05
785	601107	四川成渝	6,900	41,538.00	0.05
786	600163	中闽能源	8,100	41,472.00	0.05
787	600335	国机汽车	6,400	41,280.00	0.05
788	300820	英杰电气	900	41,265.00	0.05
789	600783	鲁信创投	3,300	41,250.00	0.05
790	601949	中国出版	6,200	41,168.00	0.05
791	000672	上峰水泥	5,200	41,080.00	0.05
792	000620	盈新发展	25,300	40,986.00	0.05
793	002216	三全食品	3,700	40,959.00	0.05
794	002651	利君股份	3,400	40,868.00	0.05
795	301047	义翘神州	600	40,860.00	0.05
796	301175	中科环保	7,900	40,843.00	0.05
797	000597	东北制药	7,900	40,764.00	0.05
798	002726	龙大美食	7,000	40,740.00	0.05
799	603915	国茂股份	2,800	40,712.00	0.05
800	002516	旷达科技	7,900	40,685.00	0.05
801	300039	上海凯宝	6,700	40,602.00	0.05
802	603609	禾丰股份	4,900	40,474.00	0.05
803	003009	中天火箭	800	40,472.00	0.05
804	600648	外高桥	3,700	40,441.00	0.05
805	688232	新点软件	1,345	40,403.80	0.05
806	300183	东软载波	2,400	40,344.00	0.05
807	600810	神马股份	4,300	40,291.00	0.05
808	688147	微导纳米	1,334	40,260.12	0.05
809	002941	新疆交建	3,600	40,104.00	0.05
810	002158	汉钟精机	2,300	39,974.00	0.05
811	688698	伟创电气	846	39,931.20	0.05
812	688443	智翔金泰	1,435	39,806.90	0.05
813	600548	深高速	3,800	39,786.00	0.05
814	002697	红旗连锁	7,400	39,590.00	0.05
815	600195	中牧股份	5,400	39,582.00	0.05
816	688380	中微半导	1,460	39,566.00	0.05
817	600997	开滦股份	6,700	39,463.00	0.05
818	600874	创业环保	6,600	39,402.00	0.05
819	000498	山东路桥	6,700	39,396.00	0.05
820	301153	中科江南	1,500	39,300.00	0.05

821	600604	市北高新	7,600	39,216.00	0.05
822	688586	江航装备	3,475	39,093.75	0.05
823	603317	天味食品	3,500	38,920.00	0.05
824	603229	奥翔药业	4,444	38,751.68	0.05
825	002612	朗姿股份	2,300	38,732.00	0.05
826	001339	智微智能	800	38,664.00	0.05
827	002034	旺能环境	2,300	38,617.00	0.05
828	605333	沪光股份	1,400	38,430.00	0.05
829	688433	华曙高科	1,040	38,220.00	0.05
830	600987	航民股份	5,400	38,178.00	0.05
831	600639	浦东金桥	3,600	38,124.00	0.05
832	688105	诺唯赞	1,673	37,859.99	0.05
833	300768	迪普科技	2,200	37,730.00	0.05
834	000088	盐田港	8,300	37,599.00	0.05
835	600966	博汇纸业	8,500	37,570.00	0.05
836	002840	华统股份	3,600	37,476.00	0.05
837	600508	上海能源	3,200	37,440.00	0.05
838	603043	广州酒家	2,400	37,392.00	0.05
838	605368	蓝天燃气	3,800	37,392.00	0.05
839	000813	德展健康	11,600	37,352.00	0.05
840	600662	外服控股	7,300	37,303.00	0.05
841	000567	海德股份	6,281	37,183.52	0.05
842	002959	小熊电器	800	37,152.00	0.05
843	002267	陕天然气	4,900	37,093.00	0.05
844	300926	博俊科技	1,400	37,058.00	0.05
845	000968	蓝焰控股	5,100	36,975.00	0.05
846	600780	通宝能源	6,200	36,766.00	0.05
847	001236	弘业期货	2,300	36,754.00	0.05
848	688584	上海合晶	2,053	36,707.64	0.05
849	301087	可孚医疗	1,100	36,520.00	0.04
850	688177	百奥泰	1,455	36,462.30	0.04
851	603567	珍宝岛	3,100	36,425.00	0.04
852	002041	登海种业	3,700	36,223.00	0.04
853	000025	特力A	2,100	36,120.00	0.04
854	301015	百洋医药	1,800	36,108.00	0.04
855	002833	弘亚数控	2,200	35,992.00	0.04
856	688097	博众精工	1,285	35,864.35	0.04
857	605009	豪悦护理	900	35,802.00	0.04
858	301004	嘉益股份	540	35,764.20	0.04
859	002946	新乳业	1,900	35,663.00	0.04
860	600058	五矿发展	4,600	35,558.00	0.04
861	003012	东鹏控股	6,200	35,464.00	0.04
862	600929	雪天盐业	7,000	35,420.00	0.04

863	688337	普源精电	984	35,099.28	0.04
864	600657	信达地产	9,000	35,010.00	0.04
865	688276	百克生物	1,667	35,007.00	0.04
866	603297	永新光学	400	34,940.00	0.04
867	000718	苏宁环球	16,100	34,937.00	0.04
868	688389	普门科技	2,689	34,741.88	0.04
869	600903	贵州燃气	5,000	34,600.00	0.04
870	605555	德昌股份	2,080	34,465.60	0.04
871	688717	艾罗能源	640	34,451.20	0.04
872	601882	海天精工	1,800	34,380.00	0.04
873	301327	华宝新能	660	33,897.60	0.04
874	301207	华兰疫苗	2,000	33,720.00	0.04
875	603983	丸美股份	800	33,704.00	0.04
876	300702	天宇股份	1,440	33,494.40	0.04
877	300080	易成新能	8,000	33,440.00	0.04
878	002327	富安娜	4,500	33,390.00	0.04
878	301268	铭利达	1,800	33,390.00	0.04
879	605168	三人行	1,123	33,049.89	0.04
880	301611	珂玛科技	600	33,006.00	0.04
881	688348	昱能科技	764	32,829.08	0.04
882	603025	大豪科技	2,320	32,526.40	0.04
883	301217	铜冠铜箔	2,600	32,526.00	0.04
884	002242	九阳股份	3,400	32,300.00	0.04
885	603299	苏盐井神	3,400	32,198.00	0.04
886	002791	坚朗五金	1,500	32,100.00	0.04
887	002053	云南能投	2,900	31,929.00	0.04
888	000030	富奥股份	5,400	31,806.00	0.04
889	301239	普瑞眼科	800	31,360.00	0.04
890	002581	ST 未名	3,500	31,290.00	0.04
891	002991	甘源食品	500	31,235.00	0.04
892	301571	国科天成	600	31,134.00	0.04
893	301363	美好医疗	1,760	31,046.40	0.04
894	300856	科思股份	2,040	30,906.00	0.04
895	301376	致欧科技	1,693	30,897.25	0.04
896	301339	通行宝	1,800	30,834.00	0.04
897	002302	西部建设	5,300	30,740.00	0.04
898	688209	英集芯	1,662	30,697.14	0.04
899	002314	南山控股	11,500	30,245.00	0.04
900	601038	一拖股份	2,300	30,061.00	0.04
901	601083	锦江航运	2,700	29,997.00	0.04
902	603698	航天工程	1,700	29,954.00	0.04
903	688252	天德钰	1,228	29,938.64	0.04
904	301592	六九一二	200	29,626.00	0.04

905	603327	福蓉科技	3,193	29,535.25	0.04
906	002913	奥士康	1,000	29,410.00	0.04
907	301600	慧翰股份	300	29,388.00	0.04
908	001376	百通能源	2,400	29,376.00	0.04
908	603013	亚普股份	1,700	29,376.00	0.04
909	000885	城发环境	2,200	29,304.00	0.04
910	301069	凯盛新材	1,800	28,998.00	0.04
911	002901	大博医疗	800	28,992.00	0.04
912	600746	江苏索普	3,700	28,897.00	0.04
913	301377	鼎泰高科	800	28,768.00	0.04
914	002275	桂林三金	2,000	28,620.00	0.04
915	601015	陕西黑猫	8,700	28,536.00	0.04
916	000761	本钢板材	7,900	28,440.00	0.03
917	601022	宁波远洋	2,800	27,636.00	0.03
918	000899	赣能股份	3,200	27,616.00	0.03
919	603693	江苏新能	2,020	27,229.60	0.03
920	605116	奥锐特	1,300	27,170.00	0.03
921	603395	红四方	800	26,984.00	0.03
922	603355	莱克电气	1,200	26,904.00	0.03
923	301458	钧崴电子	784	26,838.24	0.03
924	001356	富岭股份	1,845	26,795.80	0.03
925	000058	深赛格	3,200	26,592.00	0.03
926	688351	微电生理	1,338	26,358.60	0.03
927	301622	英思特	300	26,172.00	0.03
928	688001	华兴源创	1,031	26,053.37	0.03
929	301215	中汽股份	4,200	26,040.00	0.03
930	603730	岱美股份	4,559	25,940.71	0.03
931	002534	西子洁能	2,300	25,852.00	0.03
932	301606	绿联科技	500	25,715.00	0.03
933	301500	飞南资源	1,200	25,704.00	0.03
934	603055	台华新材	2,800	25,564.00	0.03
935	000544	中原环保	3,100	25,203.00	0.03
936	603193	润本股份	800	25,128.00	0.03
937	300755	华致酒行	1,300	25,090.00	0.03
938	601089	福元医药	1,500	25,020.00	0.03
939	301109	军信股份	1,680	24,998.40	0.03
940	301522	上大股份	700	24,927.00	0.03
941	603162	海通发展	2,920	24,382.00	0.03
942	001323	慕思股份	800	24,128.00	0.03
943	301381	赛维时代	1,200	23,940.00	0.03
944	301508	中机认检	700	23,660.00	0.03
945	688128	中国电研	959	23,495.50	0.03
946	301090	华润材料	3,100	23,343.00	0.03

947	603530	神马电力	900	23,328.00	0.03
948	000019	深粮控股	3,500	23,310.00	0.03
949	600618	氯碱化工	2,400	23,112.00	0.03
950	603194	中力股份	500	22,695.00	0.03
951	301558	三态股份	2,500	22,525.00	0.03
952	002978	安宁股份	700	22,106.00	0.03
953	301565	中仑新材	800	22,080.00	0.03
954	001258	立新能源	3,000	22,050.00	0.03
955	603877	太平鸟	1,500	21,750.00	0.03
956	605296	神农集团	700	21,518.00	0.03
957	002911	佛燃能源	2,080	21,340.80	0.03
958	301626	苏州天脉	200	21,080.00	0.03
959	001308	康冠科技	930	21,036.60	0.03
960	688523	航天环宇	968	20,821.68	0.03
961	301371	敷尔佳	820	20,803.40	0.03
962	001311	多利科技	959	19,822.53	0.02
963	605222	起帆电缆	1,300	19,682.00	0.02
964	301551	无线传媒	400	19,496.00	0.02
965	600403	大有能源	5,000	18,950.00	0.02
966	000517	荣安地产	10,100	18,281.00	0.02
967	605577	龙版传媒	1,400	18,004.00	0.02
968	605011	杭州热电	800	17,872.00	0.02
969	301177	迪阿股份	600	17,760.00	0.02
970	003039	顺控发展	1,300	17,628.00	0.02
971	603057	紫燕食品	800	17,488.00	0.02
972	601811	新华文轩	1,200	17,484.00	0.02
973	603219	富佳股份	1,200	17,412.00	0.02
974	301556	托普云农	200	17,274.00	0.02
975	301602	超研股份	655	16,244.00	0.02
976	301262	海看股份	600	15,816.00	0.02
977	601068	中铝国际	3,400	15,538.00	0.02
978	603132	金徽股份	1,100	14,597.00	0.02
979	601279	英利汽车	3,400	13,566.00	0.02
980	603103	横店影视	800	12,840.00	0.02
981	301631	壹连科技	100	8,260.00	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	000627	*ST 天茂	29,000	79,460.00	0.10
2	688798	艾为电子	1,139	77,679.80	0.10
3	688411	海博思创	310	25,881.90	0.03

4	688583	思看科技	195	15,537.60	0.02
5	688545	兴福电子	510	13,744.50	0.02
6	688757	胜科纳米	528	13,696.32	0.02
7	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.02
8	301535	浙江华远	675	12,818.25	0.02
9	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
10	301662	宏工科技	112	9,240.00	0.01
11	301479	弘景光电	116	9,032.92	0.01
12	301275	汉朔科技	135	7,585.65	0.01
13	301665	泰禾股份	317	7,097.63	0.01
14	301658	首航新能	295	6,779.10	0.01
15	301173	毓恬冠佳	144	6,477.12	0.01
16	001382	新亚电缆	288	5,820.48	0.01
17	301501	恒鑫生活	120	5,426.40	0.01
18	603124	江南新材	88	4,075.28	0.01
19	301560	众捷汽车	141	3,870.45	0.00
20	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
21	301595	太力科技	125	3,637.50	0.00
22	301636	泽润新能	68	3,227.28	0.00
23	603271	永杰新材	66	2,315.28	0.00
24	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
25	603409	汇通控股	58	1,932.56	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	002456	欧菲光	786,585.00	0.45
2	002851	麦格米特	444,798.00	0.25
3	300757	罗博特科	410,337.00	0.23
4	003021	兆威机电	401,211.00	0.23
5	001309	德明利	399,379.00	0.23
6	002130	沃尔核材	395,232.00	0.22
7	002405	四维图新	386,456.00	0.22
8	002126	银轮股份	376,113.00	0.21
9	300458	全志科技	351,446.00	0.20
10	300459	汤姆猫	343,705.00	0.20
11	300346	南大光电	342,637.44	0.19
12	002402	和而泰	333,322.00	0.19
13	300253	卫宁健康	329,217.00	0.19
14	300738	奥飞数据	325,643.00	0.19
15	300115	长盈精密	321,552.00	0.18

16	300779	惠城环保	321,108.00	0.18
17	002139	拓邦股份	318,792.00	0.18
18	000528	柳工	313,024.00	0.18
19	300170	汉得信息	307,302.00	0.17
20	002245	蔚蓝锂芯	303,103.00	0.17

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	002456	欧菲光	1,442,766.00	0.82
2	002130	沃尔核材	983,286.00	0.56
3	002851	麦格米特	949,635.00	0.54
4	300458	全志科技	929,258.60	0.53
5	300346	南大光电	900,737.20	0.51
6	300757	罗博特科	850,477.00	0.48
7	300115	长盈精密	788,306.00	0.45
8	000528	柳工	738,956.00	0.42
9	002405	四维图新	719,171.00	0.41
10	002126	银轮股份	704,774.00	0.40
11	002837	英维克	691,035.48	0.39
12	300623	捷捷微电	686,403.56	0.39
13	300857	协创数据	686,348.40	0.39
14	688235	百济神州	663,191.23	0.38
15	001696	宗申动力	652,227.00	0.37
16	688608	恒玄科技	630,639.93	0.36
17	002402	和而泰	620,840.00	0.35
18	002312	川发龙蟒	613,175.00	0.35
19	000415	渤海租赁	608,384.00	0.35
20	300253	卫宁健康	605,221.00	0.34

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	91,001,370.47
卖出股票收入（成交）总额	139,736,569.95

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）	11,200.39	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,200.39	0.01

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118057	甬矽转债	80	8,000.18	0.01
2	127109	电化转债	32	3,200.21	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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规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	1,047,676.18
2	应收清算款	8,323.41
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	-
8	其他	-
9	合计	1,055,999.59

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	000627	*ST 天茂	79,460.00	0.10	重大事项停牌
2	688411	海博思创	25,881.90	0.03	新股锁定期内
3	688583	思看科技	15,537.60	0.02	新股锁定期内
4	688545	兴福电子	13,744.50	0.02	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

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,857	16,700.37	8,826,844.00	28.46	22,185,748.00	71.54

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	方正证券股份有限公司	2,820,284.00	9.09
2	张岳旋	1,750,800.00	5.65
3	申万宏源证券有限公司	1,443,864.00	4.66
4	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司-柏泰华盈常青藤套利2号私募证券投资基金	1,069,842.00	3.45
5	华泰证券股份有限公司	944,315.00	3.04
6	张易	871,098.00	2.81
7	BARCLAYS BANK PLC	767,547.00	2.47
8	中国国际金融股份有限公司	666,983.00	2.15
9	李连华	562,252.00	1.81
10	师伟	525,895.00	1.70

8.3 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	0.00	0.0000

8.4 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 3 月 15 日) 基金份额总额	222,602,182.00
本报告期期初基金份额总额	73,012,592.00
本报告期基金总申购份额	48,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	90,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,012,592.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

经公司董事会审议通过，田汉卿女士于 2025 年 4 月 30 日起，不再担任公司副总经理。

经公司董事会审议通过，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司总经理，董事长贾波先生代为履行总经理职责。

经公司股东会书面决定，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司董事。

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重大人事变动：

2025 年 2 月 20 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去蒋伟担任的托管部副总经理职务，另有任用。

2025 年 5 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘王鑫担任托管部副总经理。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	6	229,903,392.00	100.00	45,984.77	100.00	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

(1) 具有相应的业务经营资格；

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

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

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

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

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 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
招商证券	65,031.90	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下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	2025年06月04日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)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	2025年05月24日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2025年05月14日
4	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	2025年05月10日
5	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	2025年05月01日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024年度)	证监会规定报刊和网站	2025年3月31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	2025年03月19日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2025年02月06日

	部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告		
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 01 月 24 日
10	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	2025 年 01 月 03 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

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日