

华泰柏瑞中证 A500 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：国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 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	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	A500 基金
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	22,087,987,426.00 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	刘万方	帅芳
	联系电话	021-38601777	021-38031815
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		400-888-0001	021-38917599-5
传真		021-38601799	021-38677819
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	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 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	-213,847,194.52
本期利润	115,533,301.13
加权平均基金份额本期利润	0.0085
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	1.55%
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	-246,767,522.50
期末可供分配基金份额利润	-0.0112
期末基金资产净值	22,640,926,562.25
期末基金份额净值	1.0250
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	2.50%

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

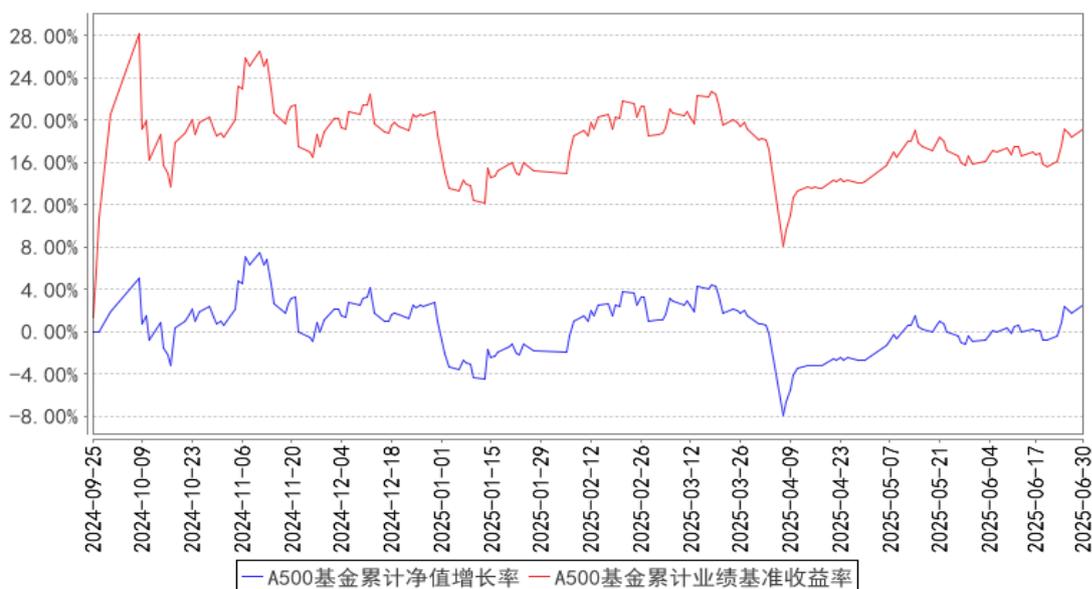
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	3.50%	0.59%	2.82%	0.60%	0.68%	-0.01%

过去三个月	1.81%	1.19%	0.84%	1.20%	0.97%	-0.01%
过去六个月	1.55%	1.10%	0.47%	1.10%	1.08%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.50%	1.21%	19.18%	1.58%	-16.68%	-0.37%

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

A500基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2024 年 9 月 25 日至 2025 年 6 月 30 日。

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

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 9 月 25 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。
谭弘翔	指数投资部副总监、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，现任指数投资部副总监。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 月起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 月起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 月起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 月起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 月起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 月起担任华泰柏瑞中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 2 月起担任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理。2025 年 5 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联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 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

2025 年上半年，中证 A500 指数上涨 0.47%，略优于沪深 300 指数，但弱于中证 500、中证 1000 和中证 2000 指数，主要原因在于上半年在流动性相对宽松的环境中，中小市值风格占据主导，市场情绪总体较为积极，大盘价值风格则一定程度上更加受到宏观经济基本面影响，缺少趋势性上行动力，导致较为充裕的资金反复交易业绩相对较弱的中小盘股票，从而使大盘宽基指数整体跑输中小盘宽基指数。

尽管市场在 4 月份经历了美国“对等关税”来回拉扯造成的波动，但从中期维度来看内部因素依然占据主导地位，外部不确定性并未对市场产生实质性冲击和影响。5 月中旬开始的窄幅震荡成为常态，主要博弈点聚焦在对经济周期和政策力度的预期上。

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 0.01%，期间日跟踪误差为 0.02%，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 1.0250 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.55%，业绩比较基准收益率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我们看到的有利因素比较多：

(1) 中美贸易冲突第一阶段的结果证明了近年来中国推动的一些工作的正确性，包括全方位加强科技自主创新和扩大内需，降低对海外尤其是美国的技术供给与市场需求的依赖度，大幅增加了中国在与美国谈判时的筹码。因此未来中国为科技发展和促进消费而实施的政策力度大概率不会减弱。

(2) 特朗普上任之后采取的孤立主义政策，使中国的外部地缘外交风险大幅度下降，与欧洲、日韩和印度的关系都有明显改善。在平稳的地缘环境中，更多资源有望转移到经济发展。

(3) 中国的货币和财政政策都有更大的空间。货币政策方面，4 月以来人民币相对美元汇率

大幅升值，人民银行所面临的汇率压力显著减小，即使美联储推迟到 9 月甚至 12 月降息，人民银行也可以根据国内经济的实际需要，在美联储之前开展新一轮的降息。财政政策方面，在地方政府隐性债务化解有序推进，债务透明度改善的情况下，在今年财政赤字率突破一定数值之后，如果下半年内需恢复不及预期，中国的货币和财政政策都可能有比较大的空间进一步加码。

(4) A 股市场今年在整体经济政策中的重要性很高，一方面如果 A 股市场上涨，可以提高居民的财产性收入，以增加居民可用于消费的现金，另一方面需要比较高的估值来消化下半年可能密集上市的“新质生产力”企业，以打通整个股权投资市场的退出堵点。

综合来看，大盘价值风格股票今年下行空间或有限，同时下半年经过一系列刺激政策效应的积累，经济周期存在进入进一步复苏阶段的较大可能，有望为大盘价值风格股票提供一定的上涨空间和潜能，或可关注大盘价值风格指数。

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

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，完全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合规守信、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、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，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、收益分配情况（如有）、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：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	378,050,591.33	180,085,017.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	22,417,363,912.38	17,340,476,673.71
其中：股票投资		22,417,193,601.18	17,340,476,673.71
基金投资		-	-
债券投资		170,311.20	-
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		138,298,075.06	15,529,504.42
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		22,933,712,578.77	17,536,091,196.03
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		4,848,515.68	795,975.99
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		1,297,294.44	1,796,995.30
应付托管费		432,431.48	598,998.44
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	286,207,774.58	85,914,784.56
负债合计		292,786,016.52	89,106,754.29
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	22,087,987,426.00	17,284,987,426.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	552,939,136.25	161,997,015.74
净资产合计		22,640,926,562.25	17,446,984,441.74
负债和净资产总计		22,933,712,578.77	17,536,091,196.03

注：1、报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0250 元，基金份额总额 22,087,987,426.00 份。

2、本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 9 月 25 日至 2024 年 12 月 31 日。

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：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
一、营业总收入		129,371,690.53
1. 利息收入		190,014.00

其中：存款利息收入	6.4.7.13	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）		-191,236,119.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-336,894,441.27
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	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	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	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	-8,962,700.10
减：二、营业总支出		13,838,389.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,233,743.93
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	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		0.77
8. 其他费用	6.4.7.23	193,396.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		115,533,301.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		115,533,301.13
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		115,533,301.13

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 A500 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	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

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期

的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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 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 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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	378,050,591.33
等于：本金	378,030,910.21
加：应计利息	19,681.12
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	378,050,591.33

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	22,300,154,810.47	-	22,417,193,601.18	117,038,790.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	170,300.00	11.20	170,311.20	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	170,300.00	11.20	170,311.20	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	22,300,325,110.47	11.20	22,417,363,912.38	117,038,790.71	

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	198,396.69
其他应付款	622,922.55
应退退补款	285,386,455.34
合计	286,207,774.58

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	17,284,987,426.00	17,284,987,426.00
本期申购	17,511,000,000.00	17,511,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,708,000,000.00	-12,708,000,000.00
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	22,087,987,426.00	22,087,987,426.00

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	92,445,468.44	69,551,547.30	161,997,015.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	92,445,468.44	69,551,547.30	161,997,015.74
本期利润	-213,847,194.52	329,380,495.65	115,533,301.13
本期基金份额交易产生的变动数	-125,365,796.42	400,774,615.80	275,408,819.38
其中：基金申购款	-162,128,632.37	355,942,313.55	193,813,681.18
基金赎回款	36,762,835.95	44,832,302.25	81,595,138.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-246,767,522.50	799,706,658.75	552,939,136.25

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	190,014.00	
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	190,014.00	

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	-219,427,574.29	
股票投资收益——赎回差价收入	-117,466,866.98	
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	-336,894,441.27	

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	7,048,856,763.62	
减：卖出股票成本总额	7,260,403,802.24	
减：交易费用	7,880,535.67	
买卖股票差价收入	-219,427,574.29	

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 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	12,626,404,861.80
减：现金支付赎回款总额	5,692,776,297.80
减：赎回股票成本总额	7,051,095,430.98
减：交易费用	-
赎回差价收入	-117,466,866.98

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	217.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	479,001.53
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	479,218.84

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	2,931,631.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,452,300.00
减：应计利息总额	212.54
减：交易费用	117.26
买卖债券差价收入	479,001.53

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	145,179,103.41
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	145,179,103.41

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	329,128,526.35
股票投资	329,128,526.35
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	251,969.30
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	329,380,495.65

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	-8,962,700.10
合计	-8,962,700.10

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	49,588.57
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	193,396.69

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

根据国泰海通证券股份有限公司发布的《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，本基金基金托管人中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。根据上述变更，基金管理人及基金托管人对《基金合同》《托管协议》等法律文件进行了相应修订，修订后的法律文件自 2025 年 4 月 7 日起生效。具体信息请参见《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》。

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	本基金的基金管理人管理的其他基金

A500ETF 联接基金”)	
-----------------	--

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 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 (%)
华泰证券	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 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 (%)
华泰证券	2,931,631.33	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 (%)
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》，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
当期发生的基金应支付的管理费	10,233,743.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,250,054.73
应支付基金管理人的净管理费	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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	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：本基金本报告期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	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	0.00
报告期间申购/买入总份额	13,200,000.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	13,200,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0598%

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 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 (%)
国泰海通证 券股份有限 公司	1,308,745,234.00	5.9251	2,007,274,178.00	11.6128
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	1,722,588,900.00	7.7988	2,005,309,200.00	11.6015
华泰证券股 份有限公司	3,508,906,455.00	15.8860	2,003,983,026.00	11.5938

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券-券商保证金	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 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	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚	2025 年 3 月	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-

	电 缆	月 13 日		期 内							
001388	信 通 电 子	2025 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新 股 未 上 市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-	
001388	信 通 电 子	2025 年 6 月 24 日	6 个月 以上	新 股 锁 定 期 内	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-	
001390	古 麒 绒 材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-	
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	173	4,901.09	7,781.54	-	
301275	汉 朔 科 技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-	
301458	钧 崑 电 子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-	
301479	弘 景 光 电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	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	349	9,620.72	15,781.78	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	734	3,611.28	13,938.66	-	
301560	众 捷	2025 年 4	6 个月	新 股 锁 定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-	

	汽车	月 17 日		期内							
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-	
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-	
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	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-	
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-	
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-	
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-	
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-	
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-	
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-	
603072	天和	2024 年 12 月	6 个月以上	新股锁定	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-	

	磁材	月 24 日		期内						
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
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	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股锁定期内	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福	2025 年 1	6 个月	新股锁定	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-

	电子	月 15 日		期内						
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	含证券送配
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
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	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

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
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月	配债未上市	100.00	100.01	1,703	170,300.00	170,311.20	-

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

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 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 0.0008% (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	378,050,591.33	-	-	-	-	-	378,050,591.33
交易性金融资产	-	-	-	-	170,311.20	22,417,193,601.18	22,417,363,912.38
应收清算款	-	-	-	-	-	138,298,075.06	138,298,075.06
资产总计	378,050,591.33	-	-	-	170,311.20	22,555,491,676.24	22,933,712,578.77
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	4,848,515.68	4,848,515.68

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,297,294.44	1,297,294.44
应付托管费	-	-	-	-	-	-432,431.48	432,431.48
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	-	286,207,774.58	286,207,774.58
负债总计	-	-	-	-	-	292,786,016.52	292,786,016.52
利率敏感度缺口	378,050,591.33	-	-	-	170,311.20	22,262,705,659.72	22,640,926,562.25
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	180,085,017.90	-	-	-	-	-	180,085,017.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	17,340,476,673.71	17,340,476,673.71
应收清算款	-	-	-	-	-	15,529,504.42	15,529,504.42
资产总计	180,085,017.90	-	-	-	-	17,356,006,178.13	17,536,091,196.03
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-795,975.99	795,975.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,796,995.30	1,796,995.30
应付托管费	-	-	-	-	-	-598,998.44	598,998.44
其他负债	-	-	-	-	-	85,914,784.56	85,914,784.56
负债总计	-	-	-	-	-	89,106,754.29	89,106,754.29
利率敏感度缺口	180,085,017.90	-	-	-	-	17,266,899,423.84	17,446,984,441.74

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 0.0008% (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	22,417,193,601.18	99.01	17,340,476,673.71	99.39
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	-4,848,515.68	-0.02	-795,975.99	-0.00
合计	22,412,345,085.50	98.99	17,339,680,697.72	99.38

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	1,115,828,868.74	321,945,079.06

	5%		
	业绩比较基准下降	-1,115,828,868.74	-321,945,079.06
	5%		

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	22,416,692,576.70	17,319,557,526.58
第二层次	185,696.74	20,879,096.50
第三层次	485,638.94	40,050.63
合计	22,417,363,912.38	17,340,476,673.71

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 17,704,813,681.18 元(2024 年度：17,499,632,622.44 元)，其中包括以股票支付的申购款 9,612,424,571.41 元和以现金支付的申购款 8,092,389,109.77 元(2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 9,423,342,846.55 元和以现金支付的申购款 8,076,289,775.89 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	22,417,193,601.18	97.75
	其中：股票	22,417,193,601.18	97.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	170,311.20	0.00
	其中：债券	170,311.20	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	378,050,591.33	1.65
8	其他各项资产	138,298,075.06	0.60
9	合计	22,933,712,578.77	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	123,501,995.00	0.55
B	采矿业	1,132,416,299.28	5.00
C	制造业	13,020,685,214.10	57.51
D	电力、热力、燃气	691,292,377.68	3.05

	及水生产和供应业		
E	建筑业	428,954,146.60	1.89
F	批发和零售业	159,351,028.58	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	783,386,714.89	3.46
H	住宿和餐饮业	20,115,375.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,475,645,384.54	6.52
J	金融业	3,630,441,465.36	16.03
K	房地产业	236,195,776.00	1.04
L	租赁和商务服务业	246,023,078.40	1.09
M	科学研究和技术服务业	247,580,762.55	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	49,788,921.40	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,953,608.00	0.07
Q	卫生和社会工作	84,771,682.32	0.37
R	文化、体育和娱乐业	71,588,747.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	22,416,692,576.70	99.01

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	470,377.28	0.00
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	-	-
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	28,403.20	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	501,024.48	0.00

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	600519	贵州茅台	628,355	885,678,939.60	3.91
2	300750	宁德时代	2,635,226	664,656,701.72	2.94
3	601318	中国平安	10,528,200	584,104,536.00	2.58
4	600036	招商银行	12,155,900	558,563,605.00	2.47
5	601166	兴业银行	16,312,400	380,731,416.00	1.68
6	600900	长江电力	11,976,850	360,982,259.00	1.59
7	000333	美的集团	4,873,100	351,837,820.00	1.55
8	601899	紫金矿业	16,189,400	315,693,300.00	1.39
9	300059	东方财富	12,454,100	288,063,333.00	1.27
10	002594	比亚迪	862,400	286,239,184.00	1.26
11	601398	工商银行	34,406,686	261,146,746.74	1.15
12	600030	中信证券	9,108,700	251,582,294.00	1.11
13	000858	五粮液	1,940,300	230,701,670.00	1.02
14	600276	恒瑞医药	4,394,232	228,060,640.80	1.01
15	601328	交通银行	26,264,600	210,116,800.00	0.93
16	000651	格力电器	4,411,160	198,149,307.20	0.88
17	601288	农业银行	31,345,800	184,313,304.00	0.81
18	688981	中芯国际	1,979,693	174,549,531.81	0.77
19	002475	立讯精密	5,010,400	173,810,776.00	0.77
20	600887	伊利股份	6,151,600	171,506,608.00	0.76
21	600919	江苏银行	14,269,200	170,374,248.00	0.75

22	603259	药明康德	2,411,721	167,735,195.55	0.74
23	601816	京沪高铁	28,677,900	164,897,925.00	0.73
24	600000	浦发银行	11,569,734	160,587,907.92	0.71
25	000725	京东方 A	36,126,600	144,145,134.00	0.64
26	300760	迈瑞医疗	610,690	137,252,577.50	0.61
27	002371	北方华创	302,500	133,768,525.00	0.59
28	601088	中国神华	3,188,100	129,245,574.00	0.57
29	601601	中国太保	3,398,070	127,461,605.70	0.56
30	300308	中际旭创	849,000	123,835,140.00	0.55
31	300124	汇川技术	1,892,300	122,185,811.00	0.54
32	688256	寒武纪	197,074	118,540,011.00	0.52
33	601728	中国电信	15,278,862	118,411,180.50	0.52
34	300502	新易盛	931,860	118,364,857.20	0.52
35	601668	中国建筑	20,282,300	117,028,871.00	0.52
36	000001	平安银行	9,552,600	115,299,882.00	0.51
37	002352	顺丰控股	2,340,600	114,127,656.00	0.50
38	002714	牧原股份	2,714,500	114,036,145.00	0.50
39	002230	科大讯飞	2,262,600	108,333,288.00	0.48
40	601127	赛力斯	789,400	106,032,208.00	0.47
41	688041	海光信息	744,900	105,246,921.00	0.46
42	600031	三一重工	5,835,003	104,738,303.85	0.46
43	603501	豪威集团	818,605	104,494,928.25	0.46
44	600309	万华化学	1,887,503	102,415,912.78	0.45
45	000063	中兴通讯	3,129,100	101,664,459.00	0.45
46	603019	中科曙光	1,442,700	101,566,080.00	0.45
47	002415	海康威视	3,640,500	100,951,065.00	0.45
48	300274	阳光电源	1,433,100	97,121,187.00	0.43
49	600941	中国移动	859,500	96,736,725.00	0.43
50	688008	澜起科技	1,158,532	94,999,624.00	0.42
51	601857	中国石油	11,094,800	94,860,540.00	0.42
52	601919	中远海控	6,123,217	92,093,183.68	0.41
53	600690	海尔智家	3,684,900	91,311,822.00	0.40
54	601012	隆基绿能	5,946,100	89,310,422.00	0.39
55	600660	福耀玻璃	1,553,700	88,576,437.00	0.39
56	600406	国电南瑞	3,899,285	87,382,976.85	0.39
57	601766	中国中车	11,879,808	83,633,848.32	0.37
58	603986	兆易创新	660,700	83,598,371.00	0.37
59	000568	泸州老窖	725,800	82,305,720.00	0.36
60	600050	中国联通	15,325,300	81,837,102.00	0.36
61	300476	胜宏科技	608,600	81,783,668.00	0.36
62	000338	潍柴动力	5,298,700	81,494,006.00	0.36
63	600028	中国石化	14,301,190	80,658,711.60	0.36
64	000100	TCL 科技	18,466,200	79,958,646.00	0.35

65	601988	中国银行	14,029,500	78,845,790.00	0.35
66	601006	大秦铁路	11,831,000	78,084,600.00	0.34
67	601985	中国核电	8,055,500	75,077,260.00	0.33
68	002027	分众传媒	9,988,000	72,912,400.00	0.32
69	601225	陕西煤业	3,786,900	72,859,956.00	0.32
70	600104	上汽集团	4,518,300	72,518,715.00	0.32
71	600150	中国船舶	2,199,000	71,555,460.00	0.32
72	600418	江淮汽车	1,673,100	67,074,579.00	0.30
73	601628	中国人寿	1,607,500	66,212,925.00	0.29
74	688012	中微公司	350,591	63,912,739.30	0.28
75	000425	徐工机械	8,096,900	62,912,913.00	0.28
76	000625	长安汽车	4,913,100	62,691,156.00	0.28
77	603288	海天味业	1,608,793	62,598,135.63	0.28
78	000792	盐湖股份	3,650,100	62,343,708.00	0.28
79	605499	东鹏饮料	196,310	61,651,155.50	0.27
80	688111	金山办公	218,637	61,229,291.85	0.27
81	600938	中国海油	2,324,400	60,690,084.00	0.27
82	600111	北方稀土	2,432,600	60,571,740.00	0.27
83	600760	中航沈飞	1,019,264	59,749,255.68	0.26
84	600905	三峡能源	13,944,300	59,402,718.00	0.26
85	600089	特变电工	4,972,820	59,325,742.60	0.26
86	601658	邮储银行	10,844,700	59,320,509.00	0.26
87	002625	光启技术	1,482,032	59,251,639.36	0.26
88	002050	三花智控	2,204,700	58,159,986.00	0.26
89	603993	洛阳钼业	6,851,900	57,692,998.00	0.25
90	600048	保利发展	7,079,000	57,339,900.00	0.25
91	002463	沪电股份	1,340,110	57,061,883.80	0.25
92	600436	片仔癀	284,800	56,962,848.00	0.25
93	300015	爱尔眼科	4,556,600	56,866,368.00	0.25
94	600019	宝钢股份	8,609,800	56,738,582.00	0.25
95	300014	亿纬锂能	1,234,600	56,557,026.00	0.25
96	601390	中国中铁	10,071,800	56,502,798.00	0.25
97	601888	中国中免	917,400	55,933,878.00	0.25
98	300033	同花顺	203,000	55,421,030.00	0.24
99	002241	歌尔股份	2,368,650	55,236,918.00	0.24
100	601600	中国铝业	7,821,330	55,062,163.20	0.24
101	600547	山东黄金	1,721,056	54,953,318.08	0.24
102	600415	小商品城	2,594,500	53,654,260.00	0.24
103	601989	中国重工	11,141,200	51,695,168.00	0.23
104	002179	中航光电	1,273,200	51,386,352.00	0.23
105	002384	东山精密	1,356,400	51,231,228.00	0.23
106	600893	航发动力	1,326,695	51,130,825.30	0.23
107	688271	联影医疗	396,274	50,620,040.76	0.22

108	603799	华友钴业	1,352,880	50,083,617.60	0.22
109	600585	海螺水泥	2,329,200	50,007,924.00	0.22
110	600570	恒生电子	1,484,200	49,780,068.00	0.22
111	000977	浪潮信息	962,448	48,969,354.24	0.22
112	000938	紫光股份	1,994,600	47,850,454.00	0.21
113	600584	长电科技	1,413,431	47,618,490.39	0.21
114	000538	云南白药	851,600	47,510,764.00	0.21
115	002028	思源电气	625,200	45,583,332.00	0.20
116	601727	上海电气	6,139,500	45,370,905.00	0.20
117	600438	通威股份	2,684,900	44,972,075.00	0.20
118	300408	三环集团	1,335,800	44,615,720.00	0.20
119	002049	紫光国微	675,900	44,514,774.00	0.20
120	300433	蓝思科技	1,986,700	44,303,410.00	0.20
121	000988	华工科技	942,400	44,302,224.00	0.20
122	000002	万 科 A	6,685,100	42,918,342.00	0.19
123	600795	国电电力	8,739,702	42,300,157.68	0.19
124	600489	中金黄金	2,869,000	41,973,470.00	0.19
125	601669	中国电建	8,451,200	41,157,344.00	0.18
126	002422	科伦药业	1,138,156	40,882,563.52	0.18
127	600988	赤峰黄金	1,606,400	39,967,232.00	0.18
128	600009	上海机场	1,248,100	39,652,137.00	0.18
129	600010	包钢股份	22,151,400	39,651,006.00	0.18
130	601100	恒立液压	548,300	39,477,600.00	0.17
131	300339	润和软件	774,900	39,388,167.00	0.17
132	601689	拓普集团	832,600	39,340,350.00	0.17
133	300394	天孚通信	486,752	38,862,279.68	0.17
134	002460	赣锋锂业	1,147,800	38,761,206.00	0.17
135	600160	巨化股份	1,341,800	38,482,824.00	0.17
136	002456	欧菲光	3,215,200	38,100,120.00	0.17
137	000768	中航西飞	1,379,300	37,710,062.00	0.17
138	600183	生益科技	1,220,479	36,797,441.85	0.16
139	601186	中国铁建	4,494,900	36,004,149.00	0.16
140	002252	上海莱士	5,212,400	35,809,188.00	0.16
141	000157	中联重科	4,916,400	35,545,572.00	0.16
142	601360	三六零	3,457,001	35,261,410.20	0.16
143	600839	四川长虹	3,607,900	35,068,788.00	0.15
144	600989	宝丰能源	2,167,000	34,975,380.00	0.15
145	601058	赛轮轮胎	2,621,400	34,392,768.00	0.15
146	600886	国投电力	2,320,200	34,199,748.00	0.15
147	000963	华东医药	839,500	33,882,220.00	0.15
148	300442	润泽科技	683,700	33,863,661.00	0.15
149	600115	中国东航	8,330,400	33,571,512.00	0.15
150	000807	云铝股份	2,064,400	32,989,112.00	0.15

151	600066	宇通客车	1,322,299	32,872,353.14	0.15
152	000408	藏格矿业	765,900	32,680,953.00	0.14
153	002074	国轩高科	1,004,000	32,589,840.00	0.14
154	002340	格林美	5,057,400	32,114,490.00	0.14
155	002001	新和成	1,504,800	32,007,096.00	0.14
156	600196	复星医药	1,270,400	31,874,336.00	0.14
157	600426	华鲁恒升	1,463,720	31,718,812.40	0.14
158	301236	软通动力	580,100	31,696,664.00	0.14
159	002195	岩山科技	5,622,900	31,656,927.00	0.14
160	001979	招商蛇口	3,579,400	31,391,338.00	0.14
161	002236	大华股份	1,974,600	31,356,648.00	0.14
162	002156	通富微电	1,222,800	31,328,136.00	0.14
163	600674	川投能源	1,942,625	31,159,705.00	0.14
164	601800	中国交建	3,502,700	31,139,003.00	0.14
165	600029	南方航空	5,258,700	31,026,330.00	0.14
166	002466	天齐锂业	965,300	30,928,212.00	0.14
167	600011	华能国际	4,323,500	30,869,790.00	0.14
168	002558	巨人网络	1,304,200	30,713,910.00	0.14
169	688169	石头科技	195,488	30,603,646.40	0.14
170	000661	长春高新	308,097	30,557,060.46	0.13
171	000975	山金国际	1,608,400	30,463,096.00	0.13
172	600487	亨通光电	1,965,300	30,069,090.00	0.13
173	600346	恒力石化	2,089,800	29,800,548.00	0.13
174	688126	沪硅产业	1,590,885	29,781,367.20	0.13
175	300251	光线传媒	1,446,900	29,328,663.00	0.13
176	600460	士兰微	1,177,700	29,230,514.00	0.13
177	300207	欣旺达	1,455,700	29,201,342.00	0.13
178	688036	传音控股	365,488	29,129,393.60	0.13
179	601111	中国国航	3,675,900	29,002,851.00	0.13
180	002517	恺英网络	1,500,500	28,974,655.00	0.13
181	300782	卓胜微	405,133	28,914,342.21	0.13
182	000066	中国长城	1,935,600	28,646,880.00	0.13
183	003816	中国广核	7,780,100	28,319,564.00	0.13
184	300347	泰格医药	531,100	28,318,252.00	0.13
185	300418	昆仑万维	840,900	28,279,467.00	0.12
186	600372	中航机载	2,344,329	28,272,607.74	0.12
187	601021	春秋航空	506,198	28,169,918.70	0.12
188	002648	卫星化学	1,623,100	28,128,323.00	0.12
189	601868	中国能建	12,613,400	28,127,882.00	0.12
190	600096	云天化	1,276,200	28,038,114.00	0.12
191	600745	闻泰科技	834,800	27,990,844.00	0.12
192	688608	恒玄科技	79,394	27,627,524.12	0.12
193	601117	中国化学	3,601,700	27,625,039.00	0.12

194	002465	海格通信	1,979,900	27,599,806.00	0.12
195	600879	航天电子	2,631,500	27,551,805.00	0.12
196	002273	水晶光电	1,379,400	27,546,618.00	0.12
197	600588	用友网络	2,034,060	27,195,382.20	0.12
198	688213	思特威	265,614	27,151,063.08	0.12
199	002916	深南电路	251,730	27,139,011.30	0.12
200	600741	华域汽车	1,533,022	27,057,838.30	0.12
201	601319	中国人保	3,104,800	27,042,808.00	0.12
202	601633	长城汽车	1,250,528	26,861,341.44	0.12
203	002294	信立泰	567,400	26,855,042.00	0.12
204	601168	西部矿业	1,609,600	26,767,648.00	0.12
205	600256	广汇能源	4,446,000	26,764,920.00	0.12
206	002920	德赛西威	261,906	26,748,459.78	0.12
207	600176	中国巨石	2,329,501	26,556,311.40	0.12
208	000831	中国稀土	731,900	26,436,228.00	0.12
209	688120	华海清科	156,446	26,392,440.20	0.12
210	600482	中国动力	1,143,401	26,378,261.07	0.12
211	600885	宏发股份	1,180,900	26,345,879.00	0.12
212	002555	三七互娱	1,514,300	26,182,247.00	0.12
213	002601	龙佰集团	1,612,000	26,130,520.00	0.12
214	600352	浙江龙盛	2,565,700	26,067,512.00	0.12
215	600219	南山铝业	6,800,100	26,044,383.00	0.12
216	600039	四川路桥	2,602,700	25,766,730.00	0.11
217	000933	神火股份	1,535,200	25,545,728.00	0.11
218	300017	网宿科技	2,370,000	25,406,400.00	0.11
219	688235	百济神州	108,618	25,377,509.52	0.11
220	002595	豪迈科技	427,800	25,334,316.00	0.11
221	300450	先导智能	1,015,200	25,227,720.00	0.11
222	300661	圣邦股份	346,540	25,217,715.80	0.11
223	000786	北新建材	949,000	25,129,520.00	0.11
224	000630	铜陵有色	7,518,600	25,112,124.00	0.11
225	300896	爱美客	142,828	24,967,762.68	0.11
226	603392	万泰生物	408,787	24,936,007.00	0.11
227	002185	华天科技	2,464,400	24,890,440.00	0.11
228	002281	光迅科技	502,400	24,778,368.00	0.11
229	000423	东阿阿胶	472,800	24,727,440.00	0.11
230	002493	荣盛石化	2,981,100	24,683,508.00	0.11
231	600085	同仁堂	680,500	24,538,830.00	0.11
232	302132	中航成飞	278,000	24,447,320.00	0.11
233	001965	招商公路	2,033,700	24,404,400.00	0.11
234	002709	天赐材料	1,334,500	24,181,140.00	0.11
235	002129	TCL 中环	3,138,725	24,105,408.00	0.11
236	688002	睿创微纳	344,331	24,006,757.32	0.11

237	300832	新产业	421,496	23,907,253.12	0.11
238	688617	惠泰医疗	79,973	23,751,981.00	0.10
239	603596	伯特利	449,400	23,678,886.00	0.10
240	300122	智飞生物	1,207,500	23,654,925.00	0.10
241	002131	利欧股份	6,656,900	23,299,150.00	0.10
242	002085	万丰奥威	1,464,217	23,266,408.13	0.10
243	300002	神州泰岳	1,959,600	23,123,280.00	0.10
244	002532	天山铝业	2,767,400	22,997,094.00	0.10
245	300058	蓝色光标	3,502,440	22,976,006.40	0.10
246	002738	中矿资源	712,920	22,927,507.20	0.10
247	600161	天坛生物	1,193,300	22,899,427.00	0.10
248	300866	安克创新	200,750	22,805,200.00	0.10
249	688777	中控技术	506,803	22,760,522.73	0.10
250	300395	菲利华	443,600	22,667,960.00	0.10
251	603606	东方电缆	438,300	22,664,493.00	0.10
252	600362	江西铜业	965,700	22,626,351.00	0.10
253	002472	双环传动	674,500	22,589,005.00	0.10
254	688099	晶晨股份	318,064	22,585,724.64	0.10
255	601877	正泰电器	996,200	22,583,854.00	0.10
256	002128	电投能源	1,140,100	22,551,178.00	0.10
257	300454	深信服	238,950	22,504,311.00	0.10
258	002130	沃尔核材	944,400	22,495,608.00	0.10
259	688506	百利天恒	75,794	22,444,119.28	0.10
260	002938	鹏鼎控股	689,800	22,094,294.00	0.10
261	300223	北京君正	318,800	22,060,960.00	0.10
262	002138	顺络电子	782,900	22,015,148.00	0.10
263	000301	东方盛虹	2,637,400	21,969,542.00	0.10
264	603129	春风动力	100,900	21,844,850.00	0.10
265	002078	太阳纸业	1,617,000	21,764,820.00	0.10
266	000034	神州数码	577,700	21,744,628.00	0.10
267	300346	南大光电	686,012	21,705,419.68	0.10
268	002353	杰瑞股份	617,900	21,626,500.00	0.10
269	300474	景嘉微	296,100	21,615,300.00	0.10
270	300024	机器人	1,256,900	21,593,542.00	0.10
271	002223	鱼跃医疗	606,500	21,591,400.00	0.10
272	002436	兴森科技	1,627,400	21,546,776.00	0.10
273	600143	金发科技	2,083,989	21,485,926.59	0.09
274	002180	纳思达	934,900	21,446,606.00	0.09
275	002410	广联达	1,597,200	21,418,452.00	0.09
276	600233	圆通速递	1,650,459	21,274,416.51	0.09
277	002065	东华软件	2,208,200	21,198,720.00	0.09
278	300054	鼎龙股份	738,200	21,171,576.00	0.09
279	002202	金风科技	2,055,700	21,070,925.00	0.09

280	600862	中航高科	805,800	21,015,264.00	0.09
281	000733	振华科技	417,100	20,875,855.00	0.09
282	300604	长川科技	464,500	20,860,695.00	0.09
283	688047	龙芯中科	156,302	20,849,123.78	0.09
284	601618	中国中冶	6,985,400	20,816,492.00	0.09
285	000999	华润三九	665,310	20,810,896.80	0.09
286	300759	康龙化成	846,650	20,776,791.00	0.09
287	600188	兖矿能源	1,701,125	20,702,691.25	0.09
288	002271	东方雨虹	1,913,800	20,535,074.00	0.09
289	002624	完美世界	1,350,400	20,485,568.00	0.09
290	300136	信维通信	912,100	20,431,040.00	0.09
291	300383	光环新网	1,421,400	20,326,020.00	0.09
292	688072	拓荆科技	132,011	20,291,410.81	0.09
293	688223	晶科能源	3,876,674	20,119,938.06	0.09
294	688396	华润微	425,561	20,069,456.76	0.09
295	600515	海南机场	5,621,800	19,901,172.00	0.09
296	300496	中科创达	347,400	19,878,228.00	0.09
297	601615	明阳智能	1,729,200	19,868,508.00	0.09
298	688578	艾力斯	212,517	19,772,581.68	0.09
299	002008	大族激光	811,200	19,768,944.00	0.09
300	002459	晶澳科技	1,980,200	19,762,396.00	0.09
301	002405	四维图新	2,310,800	19,734,232.00	0.09
302	000426	兴业银锡	1,248,400	19,724,720.00	0.09
303	600845	宝信软件	828,400	19,566,808.00	0.09
304	300627	华测导航	558,260	19,539,100.00	0.09
305	601872	招商轮船	3,116,300	19,508,038.00	0.09
306	300459	汤姆猫	3,483,100	19,505,360.00	0.09
307	600895	张江高科	757,000	19,454,900.00	0.09
308	300073	当升科技	432,400	18,969,388.00	0.08
309	300012	华测检测	1,621,900	18,960,011.00	0.08
310	688599	天合光能	1,303,100	18,934,043.00	0.08
311	300037	新宙邦	537,300	18,912,960.00	0.08
312	688122	西部超导	364,448	18,907,562.24	0.08
313	600549	厦门钨业	899,800	18,823,816.00	0.08
314	688266	泽璟制药	174,909	18,804,466.59	0.08
315	603979	金诚信	404,000	18,761,760.00	0.08
316	605589	圣泉集团	673,200	18,681,300.00	0.08
317	300699	光威复材	589,200	18,659,964.00	0.08
318	603087	甘李药业	340,500	18,652,590.00	0.08
319	603659	璞泰来	992,170	18,632,952.60	0.08
320	603605	珀莱雅	224,524	18,588,341.96	0.08
321	601216	君正集团	3,346,000	18,469,920.00	0.08
322	600332	白云山	693,500	18,280,660.00	0.08

323	600392	盛和资源	1,387,900	18,278,643.00	0.08
324	300628	亿联网络	521,400	18,123,864.00	0.08
325	000932	华菱钢铁	4,114,300	18,102,920.00	0.08
326	300003	乐普医疗	1,313,600	18,101,408.00	0.08
327	002155	湖南黄金	1,013,171	18,085,102.35	0.08
328	002444	巨星科技	708,700	18,078,937.00	0.08
329	605117	德业股份	341,520	17,984,443.20	0.08
330	300253	卫宁健康	1,691,900	17,934,140.00	0.08
331	000617	中油资本	2,436,200	17,784,260.00	0.08
332	300316	晶盛机电	653,700	17,747,955.00	0.08
333	000878	云南铜业	1,389,900	17,679,528.00	0.08
334	002389	航天彩虹	689,900	17,661,440.00	0.08
335	300001	特锐德	728,400	17,459,748.00	0.08
336	002812	恩捷股份	589,000	17,251,810.00	0.08
337	600153	建发股份	1,663,200	17,247,384.00	0.08
338	601233	桐昆股份	1,618,900	17,160,340.00	0.08
339	300142	沃森生物	1,555,000	17,105,000.00	0.08
340	600316	洪都航空	453,400	17,093,180.00	0.08
341	600118	中国卫星	597,200	17,062,004.00	0.08
342	300568	星源材质	1,337,000	16,953,160.00	0.07
343	600038	中直股份	436,050	16,923,100.50	0.07
344	601799	星宇股份	134,800	16,850,000.00	0.07
345	002414	高德红外	1,642,300	16,833,575.00	0.07
346	002152	广电运通	1,247,300	16,763,712.00	0.07
347	002821	凯莱英	188,700	16,652,775.00	0.07
348	600177	雅戈尔	2,251,500	16,435,950.00	0.07
349	300315	掌趣科技	2,704,500	16,416,315.00	0.07
350	601238	广汽集团	2,172,600	16,272,774.00	0.07
351	000519	中兵红箭	741,100	16,222,679.00	0.07
352	600398	海澜之家	2,328,300	16,204,968.00	0.07
353	600699	均胜电子	925,700	16,144,208.00	0.07
354	300413	芒果超媒	736,400	16,068,248.00	0.07
355	300919	中伟股份	488,560	16,063,852.80	0.07
356	600521	华海药业	861,600	16,051,608.00	0.07
357	600803	新奥股份	844,500	15,961,050.00	0.07
358	000738	航发控制	769,100	15,958,825.00	0.07
359	002007	华兰生物	1,015,300	15,909,751.00	0.07
360	002318	久立特材	679,700	15,898,183.00	0.07
361	600704	物产中大	3,012,000	15,873,240.00	0.07
362	603260	合盛硅业	334,800	15,869,520.00	0.07
363	600497	驰宏锌锗	2,984,500	15,788,005.00	0.07
364	002044	美年健康	3,056,100	15,708,354.00	0.07
365	600018	上港集团	2,748,800	15,695,648.00	0.07

366	601567	三星医疗	697,900	15,646,918.00	0.07
367	601677	明泰铝业	1,248,700	15,508,854.00	0.07
368	600141	兴发集团	755,300	15,506,309.00	0.07
369	000400	许继电气	705,500	15,358,735.00	0.07
370	002841	视源股份	443,400	15,341,640.00	0.07
371	000623	吉林敖东	903,317	15,311,223.15	0.07
372	000009	中国宝安	1,720,200	15,275,376.00	0.07
373	600765	中航重机	893,200	15,077,216.00	0.07
374	002245	蔚蓝锂芯	1,167,800	14,982,874.00	0.07
375	002607	中公教育	4,886,800	14,953,608.00	0.07
376	603939	益丰药房	610,506	14,939,081.82	0.07
377	600637	东方明珠	1,999,000	14,932,530.00	0.07
378	301358	湖南裕能	476,000	14,846,440.00	0.07
379	600498	烽火通信	702,700	14,777,781.00	0.07
380	002409	雅克科技	269,600	14,744,424.00	0.07
381	002407	多氟多	1,201,800	14,649,942.00	0.06
382	300182	捷成股份	2,654,500	14,626,295.00	0.06
383	600529	山东药玻	659,999	14,612,377.86	0.06
384	688180	君实生物	429,901	14,608,035.98	0.06
385	002739	万达电影	1,269,800	14,513,814.00	0.06
386	601607	上海医药	804,689	14,387,839.32	0.06
387	300088	长信科技	2,411,700	14,373,732.00	0.06
388	688188	柏楚电子	108,954	14,344,883.64	0.06
389	300724	捷佳伟创	262,600	14,259,180.00	0.06
390	300757	罗博特科	94,942	14,238,451.74	0.06
391	600026	中远海能	1,374,600	14,199,618.00	0.06
392	000960	锡业股份	928,000	14,198,400.00	0.06
393	600563	法拉电子	127,500	13,908,975.00	0.06
394	601018	宁波港	3,774,600	13,815,036.00	0.06
395	300558	贝达药业	238,300	13,809,485.00	0.06
396	000039	中集集团	1,749,600	13,751,856.00	0.06
397	300068	南都电源	856,300	13,632,296.00	0.06
398	000887	中鼎股份	769,700	13,539,023.00	0.06
399	300285	国瓷材料	775,900	13,461,865.00	0.06
400	600486	扬农化工	230,350	13,360,300.00	0.06
401	002497	雅化集团	1,168,200	13,317,480.00	0.06
402	002025	航天电器	258,700	13,299,767.00	0.06
403	002312	川发龙蟒	1,151,400	13,218,072.00	0.06
404	600820	隧道股份	2,162,586	13,191,774.60	0.06
405	300144	宋城演艺	1,534,500	13,119,975.00	0.06
406	002064	华峰化学	1,979,500	13,084,495.00	0.06
407	300296	利亚德	2,143,200	13,073,520.00	0.06
408	603816	顾家家居	510,200	13,020,304.00	0.06

409	600008	首创环保	4,311,300	13,020,126.00	0.06
410	300763	锦浪科技	226,100	12,975,879.00	0.06
411	603568	伟明环保	676,430	12,906,284.40	0.06
412	600516	方大炭素	2,779,100	12,895,024.00	0.06
413	605358	立昂微	549,200	12,796,360.00	0.06
414	688009	中国通号	2,477,226	12,732,941.64	0.06
415	603486	科沃斯	217,200	12,647,556.00	0.06
416	603806	福斯特	970,900	12,582,864.00	0.06
417	601179	中国西电	2,027,100	12,446,394.00	0.05
418	600166	福田汽车	4,588,600	12,435,106.00	0.05
419	600208	新湖中宝	4,200,400	12,433,184.00	0.05
420	600998	九州通	2,417,996	12,428,499.44	0.05
421	600170	上海建工	5,190,300	12,404,817.00	0.05
422	600323	瀚蓝环境	506,100	12,323,535.00	0.05
423	600763	通策医疗	295,469	12,196,960.32	0.05
424	002244	滨江集团	1,249,800	12,185,550.00	0.05
425	000818	航锦科技	541,300	12,179,250.00	0.05
426	600312	平高电气	788,000	12,127,320.00	0.05
427	000830	鲁西化工	1,162,500	11,973,750.00	0.05
428	000683	博源化工	2,496,100	11,956,319.00	0.05
429	002176	江特电机	1,640,800	11,912,208.00	0.05
430	600511	国药股份	407,400	11,879,784.00	0.05
431	300676	华大基因	236,900	11,790,513.00	0.05
432	601155	新城控股	861,100	11,779,848.00	0.05
433	601000	唐山港	2,897,900	11,765,474.00	0.05
434	000629	钒钛股份	4,544,500	11,633,920.00	0.05
435	600535	天士力	733,900	11,485,535.00	0.05
436	002439	启明星辰	717,700	11,476,023.00	0.05
437	002432	九安医疗	313,400	11,417,162.00	0.05
438	600499	科达制造	1,163,300	11,400,340.00	0.05
439	603000	人民网	563,300	11,384,293.00	0.05
440	002603	以岭药业	806,100	11,366,010.00	0.05
441	603885	吉祥航空	841,000	11,328,270.00	0.05
442	300390	天华新能	588,820	11,228,797.40	0.05
443	300567	精测电子	184,800	11,200,728.00	0.05
444	000708	中信特钢	945,600	11,120,256.00	0.05
445	603613	国联股份	467,655	11,078,746.95	0.05
446	002145	中核钛白	2,655,300	11,019,495.00	0.05
447	688303	大全能源	515,690	10,994,510.80	0.05
448	601880	辽港股份	7,290,900	10,936,350.00	0.05
449	600004	白云机场	1,190,600	10,834,460.00	0.05
450	000547	航天发展	1,280,200	10,753,680.00	0.05
451	600655	豫园股份	1,936,400	10,747,020.00	0.05

452	300529	健帆生物	498,000	10,741,860.00	0.05
453	000563	陕国投 A	3,005,600	10,729,992.00	0.05
454	600131	国网信通	604,347	10,696,941.90	0.05
455	600754	锦江酒店	476,600	10,694,904.00	0.05
456	600859	王府井	766,500	10,646,685.00	0.05
457	600325	华发股份	2,164,000	10,538,680.00	0.05
458	601966	玲珑轮胎	716,100	10,505,187.00	0.05
459	603077	和邦生物	6,001,900	10,503,325.00	0.05
460	002544	普天科技	435,200	10,205,440.00	0.05
461	300601	康泰生物	667,400	10,137,806.00	0.04
462	603899	晨光股份	347,800	10,082,722.00	0.04
463	603833	欧派家居	172,500	9,737,625.00	0.04
464	600867	通化东宝	1,184,100	9,709,620.00	0.04
465	002756	永兴材料	305,330	9,694,227.50	0.04
466	300070	碧水源	2,147,600	9,664,200.00	0.04
467	000032	深桑达 A	476,700	9,643,641.00	0.04
468	300457	赢合科技	418,500	9,625,500.00	0.04
469	002120	韵达股份	1,431,700	9,592,390.00	0.04
470	600667	太极实业	1,450,700	9,545,606.00	0.04
471	000998	隆平高科	961,000	9,465,850.00	0.04
472	600258	首旅酒店	666,700	9,420,471.00	0.04
473	601866	中远海发	3,808,300	9,406,501.00	0.04
474	002508	老板电器	492,100	9,354,821.00	0.04
475	300438	鹏辉能源	332,600	9,183,086.00	0.04
476	300751	迈为股份	131,840	9,170,790.40	0.04
477	688005	容百科技	400,963	8,949,494.16	0.04
478	600129	太极集团	417,300	8,892,663.00	0.04
479	000967	盈峰环境	1,269,500	8,823,025.00	0.04
480	000069	华侨城 A	3,904,000	8,784,000.00	0.04
481	300573	兴齐眼药	162,120	8,396,194.80	0.04
482	300118	东方日升	867,500	8,310,650.00	0.04
483	002292	奥飞娱乐	847,700	8,239,644.00	0.04
484	002572	索菲亚	585,500	8,202,855.00	0.04
485	601636	旗滨集团	1,556,500	7,798,065.00	0.03
486	002266	浙富控股	2,501,300	7,704,004.00	0.03
487	600864	哈投股份	1,250,100	7,463,097.00	0.03
488	688063	派能科技	162,259	7,314,635.72	0.03
489	603650	彤程新材	226,100	7,269,115.00	0.03
490	000035	中国天楹	1,676,200	7,190,898.00	0.03
491	002831	裕同科技	298,200	6,983,844.00	0.03
492	300769	德方纳米	211,500	6,983,730.00	0.03
493	688390	固德威	160,297	6,964,904.65	0.03
494	600315	上海家化	317,200	6,683,404.00	0.03

495	002091	江苏国泰	919,300	6,683,311.00	0.03
496	002372	伟星新材	637,800	6,607,608.00	0.03
497	001914	招商积余	449,200	5,556,604.00	0.02
498	600007	中国国贸	190,100	3,912,258.00	0.02
499	600335	国机汽车	601,300	3,878,385.00	0.02
500	301381	赛维时代	113,300	2,260,335.00	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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
3	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
4	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
5	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
6	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
7	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
8	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
9	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
10	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
11	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
12	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
13	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
14	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
15	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
16	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
17	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
18	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
19	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
20	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
21	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
22	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
23	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
24	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
25	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
26	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
27	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
28	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
29	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
30	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
31	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
32	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00

33	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
34	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
35	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
36	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
37	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
38	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
39	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
40	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	300750	宁德时代	619,651,388.72	3.55
2	000333	美的集团	308,024,901.73	1.77
3	000858	五粮液	228,967,134.84	1.31
4	300059	东方财富	227,916,017.28	1.31
5	002594	比亚迪	219,712,744.08	1.26
6	000651	格力电器	158,341,537.73	0.91
7	002475	立讯精密	148,833,443.51	0.85
8	300760	迈瑞医疗	146,948,408.52	0.84
9	000725	京东方 A	117,509,533.00	0.67
10	300124	汇川技术	114,306,060.89	0.66
11	002714	牧原股份	99,063,405.38	0.57
12	000001	平安银行	91,008,947.27	0.52
13	002230	科大讯飞	87,690,875.11	0.50
14	002352	顺丰控股	86,871,786.58	0.50
15	002371	北方华创	85,938,839.90	0.49
16	600519	贵州茅台	84,424,531.72	0.48
17	300308	中际旭创	83,615,525.47	0.48
18	000063	中兴通讯	82,345,342.59	0.47
19	002415	海康威视	82,336,873.10	0.47
20	300502	新易盛	80,994,586.61	0.46

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	469,714,398.70	2.69
2	000333	美的集团	229,042,056.93	1.31
3	000858	五粮液	186,838,121.77	1.07
4	002594	比亚迪	171,323,845.64	0.98

5	300059	东方财富	161,763,765.59	0.93
6	300760	迈瑞医疗	116,957,009.95	0.67
7	002475	立讯精密	114,986,452.00	0.66
8	000651	格力电器	114,092,360.63	0.65
9	300124	汇川技术	103,805,684.03	0.59
10	600519	贵州茅台	102,875,346.80	0.59
11	000725	京东方 A	88,072,537.00	0.50
12	002714	牧原股份	71,521,508.24	0.41
13	002415	海康威视	63,972,100.00	0.37
14	000063	中兴通讯	63,720,155.00	0.37
15	000001	平安银行	62,795,620.96	0.36
16	300274	阳光电源	56,907,178.56	0.33
17	002352	顺丰控股	56,656,928.25	0.32
18	688256	寒武纪	55,844,851.76	0.32
19	002371	北方华创	54,978,301.36	0.32
20	000568	泸州老窖	54,062,696.74	0.31

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	9,446,663,062.93
卖出股票收入（成交）总额	7,048,856,763.62

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	170,311.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	170,311.20	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（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	123257	安克转债	1,703	170,311.20	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	-
2	应收清算款	138,298,075.06
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	138,298,075.06

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	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定期内
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定期内
3	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股锁定期内
4	301458	钧崑电子	23,911.11	0.00	新股锁定期内
5	301275	汉朔科技	22,307.43	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 (%)
25,883	853,378.18	18,417,236,160.00	83.38	1,948,162,366.00	8.82	1,722,588,900.00	7.80

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	华泰证券股份有限公司	3,508,906,455.00	15.89
2	国泰海通证券股份有限公司	1,308,745,234.00	5.93
3	申万宏源证券有限公司	1,223,663,211.00	5.54
4	UBS AG	1,031,596,722.00	4.67
5	中国人寿保险股份有限公司	824,459,036.00	3.73
6	中国平安人寿保险股份有限公司—寿险传统低资本—自主（工行）	788,389,700.00	3.57
7	方正证券股份有限公司	555,201,992.00	2.51
8	中国银河证券股份有限公司	485,000,100.00	2.20
9	国信证券股份有限公司	440,831,459.00	2.00
10	中信证券股份有限公司	429,739,640.00	1.95
11	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	1,722,588,900.00	7.80

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

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（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	17,284,987,426.00
本报告期基金总申购份额	17,511,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	12,708,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,087,987,426.00

§ 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 (%)	
华泰证券	5	16,493,517,002.63	100.00	3,298,644.02	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，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(%)
华泰证券	2,931,631.33	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于同意兴业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	2025 年 06 月 23 日
2	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
3	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
4	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
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 14 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 10 日
7	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
8	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	证监会规定报刊和网站	2025 年 04 月 04 日
9	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

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 03 月 28 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	2025 年 03 月 19 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	2025 年 02 月 26 日
13	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 16 日
14	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