

华泰柏瑞中证 A 股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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
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	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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61

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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
10.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
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 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A 股 ETF
场内简称	A 股 ETF（扩位证券简称：A 股 ETF）
基金主代码	563330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 10 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,760,621.00 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	2023 年 11 月 7 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	<p>1、股票（含存托凭证）的投资策略</p> <p>本基金主要采用抽样复制法跟踪标的指数。抽样复制依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，以“跟踪误差最小化”为优化目标创建组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争做到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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金将根据投资目标，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；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。</p>
业绩比较基准	中证 A 股指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用抽样复制策略，跟踪中证 A 股指数，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。</p>

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	张姗
		400-61-95555

电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-0001	400-61-95555
传真	021-38601799	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

## 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	5,990,801.10
本期利润	2,620,507.96
加权平均基金份额本期利润	0.0898
本期加权平均净值利润率	2.73%
本期基金份额净值增长率	5.75%
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	6,717,807.84
期末可供分配基金份额利润	0.3782
期末基金资产净值	61,129,422.61
期末基金份额净值	3.4419
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	14.61%

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。

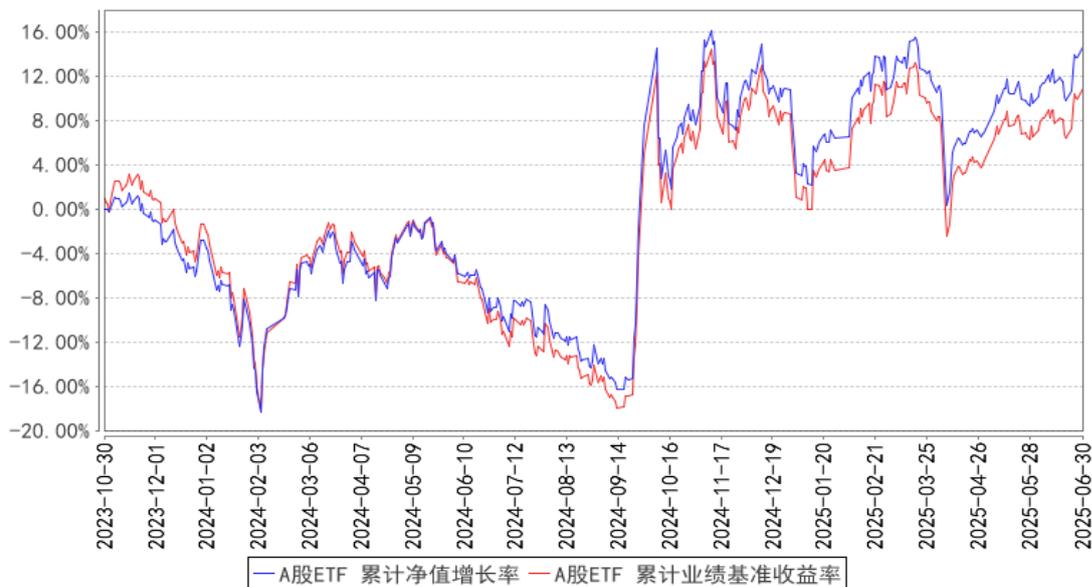
### 3.2 基金净值表现

#### 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	4.56%	0.71%	4.00%	0.74%	0.56%	-0.03%
过去三个月	3.65%	1.40%	2.71%	1.43%	0.94%	-0.03%
过去六个月	5.75%	1.25%	4.40%	1.29%	1.35%	-0.04%
过去一年	25.69%	1.58%	23.06%	1.61%	2.63%	-0.03%
自基金合同生效起至今	14.61%	1.42%	10.86%	1.45%	3.75%	-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

A股ETF 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2023年10月30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	-	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。
柳军	副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 10 月 30 日	-	24 年	副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数

					<p>证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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《证券投资基金管理人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

回顾 2025 上半年，受到内外部因素扰动，A 股市场呈现出震荡上行的态势。年初至今，Deepseek 行情引爆叠加关税政策的扰动，市场呈现较为明显的结构性行情，风险偏好显著提升，市场活跃度较高，板块轮动明显。基本面方面，中国经济在复杂多变的内外部环境下，展现出较强的韧性和稳健增长态势。从内需来看，消费市场持续回暖，政策驱动效果明显，特别是“以旧换新”政策推动了家电、通信设备、体育娱乐等耐用品消费的强劲增长。在外部需求方面，尽管国际贸易形势复杂多变，但出口仍保持一定韧性，特别是对新兴市场的出口表现亮眼。

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 0.09%，期间日跟踪误差为 0.11%，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 3.4419 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.75%，业绩比较基准收益率为 4.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国内经济修复或有波折，政策仍有发力空间，需更多关注中报业绩披露期预期的变化。海外方面，关税豁免期临近，美国政策或不断反复，美国和非美地区的经济动能有望进一步收敛，全球股市将延续区间波动。整体上，A 股结构性机会或仍将持续并进一步增多，宽基指数配置价值凸现。

#### 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 6,717,807.84 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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 A 股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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,857,539.58	8,447,589.65
结算备付金		2,832,843.16	3,829,535.60
存出保证金		601,037.56	1,418,992.40
交易性金融资产	6.4.7.2	56,058,978.30	112,831,716.41
其中：股票投资		56,058,978.30	112,831,716.41
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	127,092.59
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		61,350,398.60	126,654,926.65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		164.40	1,444.00

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	75,423.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,968.97	64,697.98
应付托管费		4,993.78	12,939.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	51,739.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	190,848.84	945,207.10
负债合计		220,975.99	1,151,451.10
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	53,338,748.92	115,805,369.78
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,790,673.69	9,698,105.77
净资产合计		61,129,422.61	125,503,475.55
负债和净资产总计		61,350,398.60	126,654,926.65

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.4419 元，基金份额总额 17,760,621.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股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
<b>一、营业总收入</b>		3,073,095.98	-12,742,851.08
1. 利息收入		32,926.95	35,722.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,926.95	35,722.34
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）		6,505,053.52	-12,177,388.18
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,851,959.65	-13,303,898.31
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	2,413.60	8,716.32
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	-44,657.43	-369,625.72
股利收益	6.4.7.19	695,337.70	1,487,419.53
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	-3,370,293.14	-831,260.80
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	-94,591.35	230,075.56
<b>减：二、营业总支出</b>		452,588.02	716,409.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	238,212.46	466,152.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,642.46	93,230.50
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		1,337.39	188.88
8. 其他费用	6.4.7.23	165,395.71	156,837.99
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		2,620,507.96	-13,459,260.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		2,620,507.96	-13,459,260.55
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,620,507.96	-13,459,260.55

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股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	115,805,369.78	-	9,698,105.77	125,503,475.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	115,805,369.78	-	9,698,105.77	125,503,475.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-62,466,620.86	-	-1,907,432.08	-64,374,052.94
(一)、综合收益总额	-	-	2,620,507.96	2,620,507.96
(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)	-62,466,620.86	-	-4,527,940.04	-66,994,560.90
其中：1. 基金申购款	39,041,638.01	-	4,129,663.25	43,171,301.26
2. 基金赎回款	-101,508,258.87	-	-8,657,603.29	-110,165,862.16
(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	53,338,748.92	-	7,790,673.69	61,129,422.61
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	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-168,000,000.00	-	-3,250,484.85	-171,250,484.85
(一)、综合收益总额	-	-	-13,459,260.55	-13,459,260.55
(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)	-168,000,000.00	-	10,208,775.70	-157,791,224.30
其中：1. 基金申购款	56,000,000.00	-	-5,660,732.76	50,339,267.24
2. 基金赎回款	-224,000,000.00	-	15,869,508.46	-208,130,491.54
(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	131,421,000.00	-	-11,589,161.51	119,831,838.49

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：

贾波

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 A 股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[2023]2267号《关于准予华泰柏瑞中证 A 股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 A 股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 635,421,000.00 元,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(2023)第 0531 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 10 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 635,421,000.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]244 号核准,本基金 635,421,000.00 份基金份额于 2023 年 11 月 7 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 A 股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、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。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 A 股指数收益率。

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	1,857,539.58
等于：本金	1,857,366.66
加：应计利息	172.92
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	1,857,539.58

#### 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	52,602,869.08	-	56,058,978.30	3,456,109.22
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,602,869.08	-	56,058,978.30	3,456,109.22

#### 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	4,591,360.00	-	-	
其中： 股指期货 投资	4,591,360.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	4,591,360.00	-	-	

##### 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
IC2509	中证500股指 期货2509	1.00	1,155,160.00	35,560.00

IF2509	沪深 300 股指期货 2509	2.00	2,332,200.00	44,280.00
IM2509	中证 1000 股指期货 2509	1.00	1,231,120.00	47,280.00
合计				127,120.00
减：可抵销期货暂收款				127,120.00
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	7,040.53
其中：交易所市场	7,040.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	183,643.91
应退退补款	164.40
合计	190,848.84

**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	38,560,621.00	115,805,369.78
本期申购	13,000,000.00	39,041,638.01
本期赎回（以“-”号填列）	-33,800,000.00	-101,508,258.87
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	17,760,621.00	53,338,748.92

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	6,503,088.43	3,195,017.34	9,698,105.77

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,503,088.43	3,195,017.34	9,698,105.77
本期利润	5,990,801.10	-3,370,293.14	2,620,507.96
本期基金份额交易产生的变动数	-5,776,081.69	1,248,141.65	-4,527,940.04
其中：基金申购款	3,346,019.64	783,643.61	4,129,663.25
基金赎回款	-9,122,101.33	464,498.04	-8,657,603.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,717,807.84	1,072,865.85	7,790,673.69

#### 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	7,305.87	
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	25,565.12	
其他	55.96	
合计	32,926.95	

#### 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	3,948,685.29	
股票投资收益——赎回差价收入	1,903,274.36	
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	5,851,959.65	

##### 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	68,077,797.19	
减：卖出股票成本总额	64,065,872.36	
减：交易费用	63,239.54	
买卖股票差价收入	3,948,685.29	

**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	110,165,862.16
减：现金支付赎回款总额	54,124,401.16
减：赎回股票成本总额	54,138,186.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,903,274.36

**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	0.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,412.71
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	2,413.60

**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	12,214.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,800.00
减：应计利息总额	0.89
减：交易费用	0.50
买卖债券差价收入	2,412.71

**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	-44,657.43

**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	695,337.70

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	695,337.70

#### 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	-3,676,053.14
股票投资	-3,676,053.14
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	305,760.00
权证投资	-
期货投资	305,760.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,370,293.14

#### 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	-94,591.35
合计	-94,591.35

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
银行划款手续费	1,751.80
合计	165,395.71

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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

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股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

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交易。

**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**

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支付关联方佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 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	238,212.46	466,152.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,389.88	9,691.64
应支付基金管理人的净管理费	235,822.58	456,460.46

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

**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	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托管费	47,642.46	93,230.50

注：支付基金托管人招商银行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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,857,539.58	7,305.87	8,873,335.48	13,974.01

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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	301458	钧威电子	网下申购	4,167	43,336.80
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	622	18,050.44
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	4,318	67,749.42

华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	1,173	30,498.00
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	2,506	54,455.38
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

#### 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
001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股锁定期内	5.30	14.44	320	1,696.00	4,620.80	-
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	-
301458	钧崴电子	2025年1月2日	6个月	新股锁定期内	10.40	34.11	417	4,336.80	14,223.87	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期内	11.80	33.85	316	3,728.80	10,696.60	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股锁定期内	6.70	24.80	470	3,149.00	11,656.00	-
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	121	1,488.30	6,588.45	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股锁定期内	19.38	83.49	215	4,166.70	17,950.35	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股锁定期内	11.68	26.95	365	4,263.20	9,836.75	-
688583	思看	2025	6个月	新股	33.46	79.68	159	4,082.12	12,669.12	含证券

	科技	年 1 月 8 日		锁定期内						送配
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	-

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	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	9,600	33,380.73	26,304.00	-

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，本基金无债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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	1,857,539.58	-	-	-	-	-	-1,857,539.58
结算备付金	2,832,843.16	-	-	-	-	-	-2,832,843.16
存出保证金	34,819.96	-	-	-	-	-566,217.60	601,037.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	56,058,978.30	56,058,978.30
资产总计	4,725,202.70	-	-	-	-	56,625,195.90	61,350,398.60
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	164.40	164.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,968.97	24,968.97
应付托管费	-	-	-	-	-	4,993.78	4,993.78
其他负债	-	-	-	-	-	-190,848.84	190,848.84
负债总计	-	-	-	-	-	-220,975.99	220,975.99
利率敏感度缺口	4,725,202.70	-	-	-	-	56,404,219.91	61,129,422.61
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	8,447,589.65	-	-	-	-	-	-8,447,589.65
结算备付金	3,829,535.60	-	-	-	-	-	-3,829,535.60

存出保证金	14,886.80	-	-	-	-	1,404,105.60	1,418,992.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	112,831,716.41	112,831,716.41
应收清算款	-	-	-	-	-	127,092.59	127,092.59
资产总计	12,292,012.05	-	-	-	-	114,362,914.60	126,654,926.65
负债	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,444.00	1,444.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,697.98	64,697.98
应付托管费	-	-	-	-	-	12,939.59	12,939.59
应付清算款	-	-	-	-	-	75,423.00	75,423.00
应交税费	-	-	-	-	-	51,739.43	51,739.43
其他负债	-	-	-	-	-	945,207.10	945,207.10
负债总计	-	-	-	-	-	1,151,451.10	1,151,451.10
利率敏感度缺口	12,292,012.05	-	-	-	-	113,211,463.50	125,503,475.55

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，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，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	56,058,978.30	91.71	112,831,716.41	89.90
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	-164.40	-0.00	-1,444.00	-0.00
合计	56,058,813.90	91.71	112,830,272.41	89.90

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%	2,925,252.30	6,101,676.54
	业绩比较基准下降5%	-2,925,252.30	-6,101,676.54

#### 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	55,927,466.67	112,586,463.51
第二层次	26,304.00	122,411.80
第三层次	105,207.63	122,841.10
合计	56,058,978.30	112,831,716.41

##### 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 43,171,301.26 元(2024 年度：110,086,635.18 元)，其中包括以股票支付的申购款 21,641,903.43 元和以现金支付的申购款 21,529,397.83 元(2024 年度：其中包括以股票支付的申购款

55,547,827.59 元和以现金支付的申购款 54,538,807.59 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	56,058,978.30	91.38
	其中：股票	56,058,978.30	91.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,690,382.74	7.65
8	其他各项资产	601,037.56	0.98
9	合计	61,350,398.60	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	398,078.00	0.65
B	采矿业	2,332,136.50	3.82
C	制造业	33,286,699.54	54.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,798,168.00	2.94
E	建筑业	692,065.00	1.13
F	批发和零售业	789,438.70	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,476,212.92	2.41
H	住宿和餐饮业	82,866.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,684,343.30	6.03
J	金融业	8,358,473.25	13.67
K	房地产业	698,585.00	1.14

L	租赁和商务服务业	489,603.40	0.80
M	科学研究和技术服务业	619,109.90	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	603,536.80	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	47,124.00	0.08
Q	卫生和社会工作	191,997.36	0.31
R	文化、体育和娱乐业	352,569.00	0.58
S	综合	43,031.00	0.07
	合计	55,944,037.67	91.52

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	96,841.03	0.16
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,403.00	0.01
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	10,696.60	0.02
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	114,940.63	0.19
--	----	------------	------

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	1,200	1,691,424.00	2.77
2	300750	宁德时代	3,856	972,560.32	1.59
3	601318	中国平安	12,900	715,692.00	1.17
4	601166	兴业银行	20,400	476,136.00	0.78
5	000333	美的集团	6,199	447,567.80	0.73
6	002594	比亚迪	1,300	431,483.00	0.71
7	601899	紫金矿业	21,800	425,100.00	0.70
8	600900	长江电力	14,100	424,974.00	0.70
9	300059	东方财富	16,600	383,958.00	0.63
10	688041	海光信息	2,520	356,050.80	0.58
11	601398	工商银行	45,000	341,550.00	0.56
12	600276	恒瑞医药	6,300	326,970.00	0.53
13	600030	中信证券	11,500	317,630.00	0.52
14	000858	五粮液	2,500	297,250.00	0.49
15	300760	迈瑞医疗	1,300	292,175.00	0.48
16	000651	格力电器	6,300	282,996.00	0.46
17	601211	国泰海通	14,116	270,462.56	0.44
18	600000	浦发银行	19,200	266,496.00	0.44
19	603259	药明康德	3,800	264,290.00	0.43
20	601328	交通银行	30,800	246,400.00	0.40
21	300502	新易盛	1,900	241,338.00	0.39
22	601288	农业银行	39,900	234,612.00	0.38
23	002475	立讯精密	6,200	215,078.00	0.35
24	600887	伊利股份	7,600	211,888.00	0.35
25	688008	澜起科技	2,520	206,640.00	0.34
26	688981	中芯国际	2,320	204,554.40	0.33
27	600919	江苏银行	16,600	198,204.00	0.32
28	603019	中科曙光	2,500	176,000.00	0.29
29	300476	胜宏科技	1,300	174,694.00	0.29
30	601127	赛力斯	1,300	174,616.00	0.29
31	300274	阳光电源	2,480	168,069.60	0.27
32	601816	京沪高铁	28,200	162,150.00	0.27
33	300124	汇川技术	2,500	161,425.00	0.26

34	002714	牧原股份	3,800	159,638.00	0.26
35	601728	中国电信	20,500	158,875.00	0.26
36	601088	中国神华	3,800	154,052.00	0.25
37	603501	豪威集团	1,200	153,180.00	0.25
38	603986	兆易创新	1,200	151,836.00	0.25
39	601988	中国银行	27,000	151,740.00	0.25
40	600016	民生银行	30,800	146,300.00	0.24
41	688230	芯导科技	2,607	144,506.01	0.24
42	601601	中国太保	3,800	142,538.00	0.23
43	600660	福耀玻璃	2,500	142,525.00	0.23
44	002415	海康威视	5,100	141,423.00	0.23
45	000001	平安银行	11,600	140,012.00	0.23
46	000568	泸州老窖	1,200	136,080.00	0.22
47	600309	万华化学	2,500	135,650.00	0.22
48	600941	中国移动	1,200	135,060.00	0.22
49	600031	三一重工	7,500	134,625.00	0.22
50	300394	天孚通信	1,652	131,895.68	0.22
51	000725	京东方 A	32,100	128,079.00	0.21
52	600690	海尔智家	5,000	123,900.00	0.20
53	600644	乐山电力	8,900	123,888.00	0.20
54	000063	中兴通讯	3,800	123,462.00	0.20
55	002352	顺丰控股	2,500	121,900.00	0.20
56	002230	科大讯飞	2,500	119,700.00	0.20
57	601077	渝农商行	16,600	118,524.00	0.19
58	601668	中国建筑	20,500	118,285.00	0.19
59	000338	潍柴动力	7,500	115,350.00	0.19
60	300920	润阳科技	2,500	114,575.00	0.19
61	601919	中远海控	7,600	114,304.00	0.19
62	601012	隆基绿能	7,600	114,152.00	0.19
63	300661	圣邦股份	1,560	113,521.20	0.19
64	601818	光大银行	27,000	112,050.00	0.18
65	601857	中国石油	12,900	110,295.00	0.18
66	600050	中国联通	20,500	109,470.00	0.18
67	601229	上海银行	10,200	108,222.00	0.18
68	300498	温氏股份	6,300	107,604.00	0.18
69	601138	工业富联	5,000	106,900.00	0.17
70	002463	沪电股份	2,500	106,450.00	0.17
71	002263	大东南	25,700	106,141.00	0.17
72	002142	宁波银行	3,800	103,968.00	0.17
73	601628	中国人寿	2,500	102,975.00	0.17
74	002050	三花智控	3,800	100,244.00	0.16
75	600418	江淮汽车	2,500	100,225.00	0.16
76	002625	光启技术	2,500	99,950.00	0.16

77	601766	中国中车	14,100	99,264.00	0.16
78	000100	TCL 科技	22,800	98,724.00	0.16
79	601998	中信银行	11,600	98,600.00	0.16
80	601225	陕西煤业	5,100	98,124.00	0.16
81	601665	齐鲁银行	15,400	97,328.00	0.16
82	688215	瑞晟智能	2,520	95,810.40	0.16
83	601985	中国核电	10,200	95,064.00	0.16
84	688701	卓锦股份	11,520	94,924.80	0.16
85	600988	赤峰黄金	3,800	94,544.00	0.15
86	002384	东山精密	2,500	94,425.00	0.15
87	688280	精进电动	12,985	94,400.95	0.15
88	002027	分众传媒	12,900	94,170.00	0.15
89	601100	恒立液压	1,300	93,600.00	0.15
90	300782	卓胜微	1,300	92,781.00	0.15
91	603799	华友钴业	2,500	92,550.00	0.15
92	600980	北矿科技	3,800	92,416.00	0.15
93	603160	汇顶科技	1,300	92,339.00	0.15
94	000938	紫光股份	3,800	91,162.00	0.15
95	600015	华夏银行	11,400	90,174.00	0.15
96	002422	科伦药业	2,500	89,800.00	0.15
97	000425	徐工机械	11,500	89,355.00	0.15
98	601169	北京银行	12,900	88,107.00	0.14
99	002402	和而泰	3,800	88,046.00	0.14
100	301196	唯科科技	1,300	87,971.00	0.14
101	002028	思源电气	1,200	87,492.00	0.14
102	002558	巨人网络	3,700	87,135.00	0.14
103	000792	盐湖股份	5,100	87,108.00	0.14
104	300854	中兰环保	5,100	86,853.00	0.14
105	002241	歌尔股份	3,700	86,284.00	0.14
106	002049	紫光国微	1,300	85,618.00	0.14
107	002396	星网锐捷	3,800	85,310.00	0.14
108	600406	国电南瑞	3,800	85,158.00	0.14
109	603093	南华期货	3,800	84,854.00	0.14
110	600643	爱建集团	11,400	84,588.00	0.14
111	600584	长电科技	2,500	84,225.00	0.14
112	600570	恒生电子	2,500	83,850.00	0.14
113	002472	双环传动	2,500	83,725.00	0.14
114	000158	常山北明	3,800	83,676.00	0.14
115	300142	沃森生物	7,600	83,600.00	0.14
116	300408	三环集团	2,500	83,500.00	0.14
117	300223	北京君正	1,200	83,040.00	0.14
118	601162	天风证券	16,600	81,838.00	0.13
119	002439	启明星辰	5,100	81,549.00	0.13

120	600150	中国船舶	2,500	81,350.00	0.13
121	000997	新大陆	2,500	80,950.00	0.13
122	000426	兴业银锡	5,100	80,580.00	0.13
123	000625	长安汽车	6,300	80,388.00	0.13
124	600110	诺德股份	11,500	80,385.00	0.13
125	300929	华骐环保	7,600	80,256.00	0.13
126	600547	山东黄金	2,500	79,825.00	0.13
127	002961	瑞达期货	3,800	79,800.00	0.13
128	688655	迅捷兴	3,765	79,780.35	0.13
129	600415	小商品城	3,800	78,584.00	0.13
130	301109	军信股份	5,280	78,566.40	0.13
131	002966	苏州银行	8,900	78,142.00	0.13
132	600885	宏发股份	3,500	78,085.00	0.13
133	301033	迈普医学	1,300	78,078.00	0.13
134	688718	唯赛勃	6,299	77,981.62	0.13
135	601128	常熟银行	10,563	77,849.31	0.13
136	300036	超图软件	5,100	77,826.00	0.13
137	002626	金达威	3,800	77,748.00	0.13
138	601360	三六零	7,600	77,520.00	0.13
139	300015	爱尔眼科	6,200	77,376.00	0.13
140	002261	拓维信息	2,500	77,375.00	0.13
141	688021	奥福环保	5,060	77,367.40	0.13
142	002624	完美世界	5,100	77,367.00	0.13
143	301317	鑫磊股份	2,500	77,100.00	0.13
144	688180	君实生物	2,264	76,930.72	0.13
145	300091	金通灵	25,700	76,843.00	0.13
146	601838	成都银行	3,800	76,380.00	0.12
147	600760	中航沈飞	1,300	76,206.00	0.12
148	601336	新华保险	1,300	76,050.00	0.12
149	600363	联创光电	1,300	75,829.00	0.12
150	688679	通源环境	5,060	75,748.20	0.12
151	300674	宇信科技	2,500	75,725.00	0.12
152	300237	美晨科技	34,700	75,646.00	0.12
153	001965	招商公路	6,300	75,600.00	0.12
154	300558	贝达药业	1,300	75,335.00	0.12
155	603993	洛阳钼业	8,900	74,938.00	0.12
156	300886	华业香料	2,500	74,900.00	0.12
157	603538	美诺华	3,800	74,898.00	0.12
158	601956	东贝集团	11,500	74,750.00	0.12
159	002456	欧菲光	6,300	74,655.00	0.12
160	601825	沪农商行	7,600	73,720.00	0.12
161	688314	康拓医疗	2,382	73,556.16	0.12
162	600967	内蒙一机	3,800	73,530.00	0.12

163	300987	川网传媒	3,800	73,416.00	0.12
164	002517	恺英网络	3,800	73,378.00	0.12
165	002812	恩捷股份	2,500	73,225.00	0.12
166	600183	生益科技	2,400	72,360.00	0.12
167	002797	第一创业	10,200	72,216.00	0.12
168	000975	山金国际	3,800	71,972.00	0.12
168	600137	浪莎股份	3,800	71,972.00	0.12
169	603927	中科软	3,720	71,944.80	0.12
170	601600	中国铝业	10,200	71,808.00	0.12
171	601939	建设银行	7,600	71,744.00	0.12
172	300054	鼎龙股份	2,500	71,700.00	0.12
173	688388	嘉元科技	3,551	71,304.08	0.12
174	002539	云图控股	7,600	71,288.00	0.12
175	600048	保利发展	8,800	71,280.00	0.12
176	603087	甘李药业	1,300	71,214.00	0.12
177	600810	神马股份	7,600	71,212.00	0.12
178	002595	豪迈科技	1,200	71,064.00	0.12
179	600884	杉杉股份	7,500	70,950.00	0.12
180	300724	捷佳伟创	1,300	70,590.00	0.12
181	002139	拓邦股份	5,100	70,431.00	0.12
182	002311	海大集团	1,200	70,308.00	0.12
183	603169	兰石重装	8,900	70,132.00	0.11
184	688681	科汇股份	4,994	69,916.00	0.11
185	000767	晋控电力	24,400	69,784.00	0.11
186	603323	苏农银行	12,430	69,732.30	0.11
187	600486	扬农化工	1,200	69,600.00	0.11
188	002268	电科网安	3,800	69,502.00	0.11
189	603659	璞泰来	3,700	69,486.00	0.11
190	300347	泰格医药	1,300	69,316.00	0.11
191	002958	青农商行	19,200	69,312.00	0.11
192	300432	富临精工	5,300	69,271.00	0.11
193	601963	重庆银行	6,378	69,265.08	0.11
194	601187	厦门银行	10,200	69,258.00	0.11
195	600160	巨化股份	2,400	68,832.00	0.11
196	603919	金徽酒	3,800	68,780.00	0.11
197	300496	中科创达	1,200	68,664.00	0.11
198	688013	天臣医疗	2,339	68,368.97	0.11
199	300832	新产业	1,200	68,064.00	0.11
200	000423	东阿阿胶	1,300	67,990.00	0.11
201	000009	中国宝安	7,600	67,488.00	0.11
202	300373	扬杰科技	1,300	67,470.00	0.11
203	300765	新诺威	1,300	67,197.00	0.11
204	600350	山东高速	6,300	67,158.00	0.11

205	300157	新锦动力	12,800	67,072.00	0.11
206	601888	中国中免	1,100	67,067.00	0.11
207	002807	江阴银行	14,100	66,975.00	0.11
208	601058	赛轮轮胎	5,100	66,912.00	0.11
209	601021	春秋航空	1,200	66,780.00	0.11
210	301256	华融化学	6,300	66,717.00	0.11
211	300458	全志科技	1,680	66,679.20	0.11
212	688237	超卓航科	2,274	66,469.02	0.11
213	000786	北新建材	2,500	66,200.00	0.11
213	002436	兴森科技	5,000	66,200.00	0.11
214	301212	联盛化学	2,500	66,175.00	0.11
215	002768	国恩股份	2,500	66,025.00	0.11
216	600392	盛和资源	5,000	65,850.00	0.11
217	601727	上海电气	8,900	65,771.00	0.11
218	003009	中天火箭	1,300	65,767.00	0.11
219	002555	三七互娱	3,800	65,702.00	0.11
220	002409	雅克科技	1,200	65,628.00	0.11
221	301236	软通动力	1,200	65,568.00	0.11
222	300241	瑞丰光电	11,500	65,550.00	0.11
223	688558	国盛智科	2,596	65,523.04	0.11
224	300487	蓝晓科技	1,300	65,390.00	0.11
225	300024	机器人	3,800	65,284.00	0.11
226	600300	维维股份	19,200	65,280.00	0.11
227	600938	中国海油	2,500	65,275.00	0.11
228	600862	中航高科	2,500	65,200.00	0.11
229	000722	湖南发展	5,100	65,025.00	0.11
230	688267	中触媒	2,257	64,956.46	0.11
231	603272	联翔股份	3,800	64,752.00	0.11
232	002195	岩山科技	11,500	64,745.00	0.11
233	300676	华大基因	1,300	64,701.00	0.11
234	300568	星源材质	5,100	64,668.00	0.11
235	300126	锐奇股份	8,900	64,614.00	0.11
236	002202	金风科技	6,300	64,575.00	0.11
237	600908	无锡银行	10,200	64,362.00	0.11
238	002156	通富微电	2,500	64,050.00	0.10
239	002389	航天彩虹	2,500	64,000.00	0.10
240	300182	捷成股份	11,600	63,916.00	0.10
241	603816	顾家家居	2,500	63,800.00	0.10
242	002948	青岛银行	12,800	63,744.00	0.10
243	600438	通威股份	3,800	63,650.00	0.10
244	002185	华天科技	6,300	63,630.00	0.10
245	000766	通化金马	2,500	63,425.00	0.10
246	601933	永辉超市	12,900	63,210.00	0.10

247	601168	西部矿业	3,800	63,194.00	0.10
248	002532	天山铝业	7,600	63,156.00	0.10
249	600221	海航控股	47,100	63,114.00	0.10
250	300535	达威股份	3,800	63,042.00	0.10
251	000069	华侨城 A	28,000	63,000.00	0.10
252	601658	邮储银行	11,500	62,905.00	0.10
253	600728	佳都科技	11,500	62,675.00	0.10
254	000564	供销大集	27,000	62,640.00	0.10
255	601577	长沙银行	6,300	62,622.00	0.10
256	601000	唐山港	15,400	62,524.00	0.10
257	600111	北方稀土	2,500	62,250.00	0.10
258	600066	宇通客车	2,500	62,150.00	0.10
259	300450	先导智能	2,500	62,125.00	0.10
260	300385	雪浪环境	11,600	62,060.00	0.10
261	603606	东方电缆	1,200	62,052.00	0.10
262	600460	士兰微	2,500	62,050.00	0.10
263	002025	航天电器	1,200	61,692.00	0.10
264	600702	舍得酒业	1,200	61,680.00	0.10
265	603338	浙江鼎力	1,300	61,620.00	0.10
266	603179	新泉股份	1,311	61,577.67	0.10
267	002294	信立泰	1,300	61,529.00	0.10
268	000600	建投能源	8,900	61,499.00	0.10
269	603083	剑桥科技	1,300	61,490.00	0.10
270	000402	金融街	21,800	61,476.00	0.10
271	300395	菲利华	1,200	61,320.00	0.10
272	600839	四川长虹	6,300	61,236.00	0.10
273	000977	浪潮信息	1,200	61,056.00	0.10
274	300132	青松股份	10,200	60,996.00	0.10
274	300339	润和软件	1,200	60,996.00	0.10
275	002407	多氟多	5,000	60,950.00	0.10
276	002008	大族激光	2,500	60,925.00	0.10
277	600536	中国软件	1,300	60,801.00	0.10
278	300088	长信科技	10,200	60,792.00	0.10
279	000807	云铝股份	3,800	60,724.00	0.10
280	002126	银轮股份	2,500	60,700.00	0.10
281	301190	善水科技	2,500	60,675.00	0.10
282	300327	中颖电子	2,500	60,550.00	0.10
283	603979	金诚信	1,300	60,372.00	0.10
284	002851	麦格米特	1,200	60,168.00	0.10
285	000733	振华科技	1,200	60,060.00	0.10
286	603939	益丰药房	2,440	59,706.80	0.10
287	002082	万邦德	8,900	59,630.00	0.10
288	300748	金力永磁	2,500	59,600.00	0.10

289	300014	亿纬锂能	1,300	59,553.00	0.10
290	300640	德艺文创	8,900	59,541.00	0.10
291	300442	润泽科技	1,200	59,436.00	0.10
292	600580	卧龙电驱	3,000	59,310.00	0.10
293	600435	北方导航	3,800	59,242.00	0.10
294	002281	光迅科技	1,200	59,184.00	0.10
295	000860	顺鑫农业	3,800	59,090.00	0.10
296	002373	千方科技	6,300	58,590.00	0.10
297	002212	天融信	7,600	58,520.00	0.10
298	002318	久立特材	2,500	58,475.00	0.10
299	688005	容百科技	2,611	58,277.52	0.10
300	605358	立昂微	2,500	58,250.00	0.10
301	600487	亨通光电	3,800	58,140.00	0.10
302	000750	国海证券	14,100	58,092.00	0.10
303	002155	湖南黄金	3,250	58,012.50	0.09
304	688178	万德斯	2,520	58,010.40	0.09
305	603968	醋化股份	5,100	57,987.00	0.09
306	603456	九洲药业	3,800	57,798.00	0.09
307	603308	应流股份	2,500	57,700.00	0.09
308	600482	中国动力	2,500	57,675.00	0.09
309	002839	张家港行	12,800	57,600.00	0.09
310	600060	海信视像	2,500	57,550.00	0.09
311	601918	新集能源	8,900	57,494.00	0.09
312	300058	蓝色光标	8,740	57,334.40	0.09
313	300085	银之杰	1,300	57,278.00	0.09
314	000799	酒鬼酒	1,300	57,187.00	0.09
315	300834	星辉环材	2,500	57,175.00	0.09
316	002130	沃尔核材	2,400	57,168.00	0.09
317	000002	万 科 A	8,900	57,138.00	0.09
318	002382	蓝帆医疗	10,200	57,120.00	0.09
319	002317	众生药业	3,800	57,038.00	0.09
320	300073	当升科技	1,300	57,031.00	0.09
321	601198	东兴证券	5,100	56,865.00	0.09
322	300026	红日药业	15,400	56,826.00	0.09
322	301098	金埔园林	6,300	56,826.00	0.09
323	002123	梦网科技	3,800	56,810.00	0.09
324	600285	羚锐制药	2,500	56,675.00	0.09
325	600338	西藏珠峰	5,100	56,559.00	0.09
326	000401	冀东水泥	12,900	56,502.00	0.09
327	002216	三全食品	5,100	56,457.00	0.09
328	000988	华工科技	1,200	56,412.00	0.09
329	603311	金海高科	5,100	56,406.00	0.09
330	601615	明阳智能	4,900	56,301.00	0.09

331	000066	中国长城	3,800	56,240.00	0.09
332	300601	康泰生物	3,700	56,203.00	0.09
333	600369	西南证券	12,900	56,115.00	0.09
334	600886	国投电力	3,800	56,012.00	0.09
335	300136	信维通信	2,500	56,000.00	0.09
336	300352	北信源	10,100	55,853.00	0.09
337	300433	蓝思科技	2,500	55,750.00	0.09
338	601872	招商轮船	8,900	55,714.00	0.09
339	600428	中远海特	8,900	55,625.00	0.09
340	600489	中金黄金	3,800	55,594.00	0.09
341	601997	贵阳银行	8,900	55,536.00	0.09
342	000617	中油资本	7,600	55,480.00	0.09
343	601099	太平洋	14,100	55,413.00	0.09
344	688779	长远锂科	10,140	55,161.60	0.09
345	301065	本立科技	2,500	55,150.00	0.09
346	600522	中天科技	3,800	54,948.00	0.09
347	600096	云天化	2,500	54,925.00	0.09
348	000735	罗牛山	8,900	54,913.00	0.09
349	000519	中兵红箭	2,500	54,725.00	0.09
350	300017	网宿科技	5,100	54,672.00	0.09
351	000400	许继电气	2,500	54,425.00	0.09
352	688251	井松智能	2,520	54,331.20	0.09
353	688098	申联生物	8,889	54,311.79	0.09
354	600642	申能股份	6,300	54,180.00	0.09
355	600426	华鲁恒升	2,500	54,175.00	0.09
356	300512	中亚股份	6,300	54,054.00	0.09
357	300509	新美星	6,300	53,928.00	0.09
358	300604	长川科技	1,200	53,892.00	0.09
359	002405	四维图新	6,300	53,802.00	0.09
360	601860	紫金银行	17,900	53,700.00	0.09
361	600258	首旅酒店	3,800	53,694.00	0.09
362	600585	海螺水泥	2,500	53,675.00	0.09
363	002271	东方雨虹	5,000	53,650.00	0.09
364	600548	深高速	5,100	53,397.00	0.09
364	600879	航天电子	5,100	53,397.00	0.09
365	688132	邦彦技术	2,629	53,368.70	0.09
366	688395	正弦电气	2,350	53,298.00	0.09
367	601609	金田股份	7,600	53,276.00	0.09
368	600129	太极集团	2,500	53,275.00	0.09
369	601375	中原证券	12,800	53,248.00	0.09
370	601106	中国一重	19,000	53,200.00	0.09
371	600863	内蒙华电	12,900	53,019.00	0.09
372	002465	海格通信	3,800	52,972.00	0.09

373	002701	奥瑞金	8,900	52,955.00	0.09
374	002550	千红制药	6,300	52,920.00	0.09
375	300383	光环新网	3,700	52,910.00	0.09
376	002081	金螳螂	15,400	52,822.00	0.09
377	600859	王府井	3,800	52,782.00	0.09
378	301175	中科环保	10,200	52,734.00	0.09
379	300009	安科生物	6,300	52,731.00	0.09
380	600026	中远海能	5,100	52,683.00	0.09
381	601218	吉鑫科技	12,800	52,608.00	0.09
382	000923	河钢资源	3,800	52,592.00	0.09
383	600143	金发科技	5,100	52,581.00	0.09
384	603712	七一二	2,500	52,525.00	0.09
385	688101	三达膜	3,765	52,484.10	0.09
386	000963	华东医药	1,300	52,468.00	0.09
387	300439	美康生物	5,000	52,450.00	0.09
387	600079	人福医药	2,500	52,450.00	0.09
388	002414	高德红外	5,100	52,275.00	0.09
389	301088	戎美股份	3,800	52,250.00	0.09
390	002837	英维克	1,750	51,992.50	0.09
391	301097	天益医疗	1,300	51,987.00	0.09
391	600115	中国东航	12,900	51,987.00	0.09
392	601155	新城控股	3,800	51,984.00	0.09
393	601890	亚星锚链	5,100	51,969.00	0.09
394	600390	五矿资本	8,900	51,887.00	0.08
395	002346	柘中股份	3,800	51,680.00	0.08
396	003039	顺控发展	3,800	51,528.00	0.08
397	600141	兴发集团	2,500	51,325.00	0.08
398	300346	南大光电	1,620	51,256.80	0.08
399	002335	科华数据	1,200	51,216.00	0.08
400	000408	藏格矿业	1,200	51,204.00	0.08
401	600095	湘财股份	5,100	51,153.00	0.08
402	300332	天壕能源	10,100	51,106.00	0.08
403	002479	富春环保	10,200	51,102.00	0.08
404	002152	广电运通	3,800	51,072.00	0.08
404	600416	湘电股份	3,800	51,072.00	0.08
405	600726	华电能源	21,800	51,012.00	0.08
406	600495	晋西车轴	10,200	51,000.00	0.08
407	300003	乐普医疗	3,700	50,986.00	0.08
408	002410	广联达	3,800	50,958.00	0.08
409	601528	瑞丰银行	8,800	50,952.00	0.08
410	002459	晶澳科技	5,100	50,898.00	0.08
410	002825	纳尔股份	5,100	50,898.00	0.08
411	600588	用友网络	3,800	50,806.00	0.08

412	603197	保隆科技	1,300	50,791.00	0.08
413	300251	光线传媒	2,500	50,675.00	0.08
414	603369	今世缘	1,300	50,609.00	0.08
415	603000	人民网	2,500	50,525.00	0.08
416	603132	金徽股份	3,800	50,426.00	0.08
417	600771	广誉远	2,500	50,400.00	0.08
418	002936	郑州银行	24,400	50,264.00	0.08
419	600028	中国石化	8,900	50,196.00	0.08
420	600928	西安银行	12,800	50,176.00	0.08
421	600971	恒源煤电	7,600	50,160.00	0.08
422	300207	欣旺达	2,500	50,150.00	0.08
423	600893	航发动力	1,300	50,102.00	0.08
424	002867	周大生	3,800	50,084.00	0.08
424	600019	宝钢股份	7,600	50,084.00	0.08
425	600499	科达制造	5,100	49,980.00	0.08
426	600033	福建高速	14,100	49,914.00	0.08
427	688303	大全能源	2,339	49,867.48	0.08
428	603885	吉祥航空	3,700	49,839.00	0.08
429	600201	生物股份	6,200	49,724.00	0.08
430	002969	嘉美包装	14,100	49,491.00	0.08
431	002128	电投能源	2,500	49,450.00	0.08
432	000429	粤高速 A	3,700	49,321.00	0.08
433	300459	汤姆猫	8,800	49,280.00	0.08
434	600512	腾达建设	21,800	49,268.00	0.08
435	603535	嘉诚国际	4,628	49,241.92	0.08
436	300983	尤安设计	2,520	49,190.40	0.08
437	600325	华发股份	10,100	49,187.00	0.08
438	600461	洪城环境	5,100	49,164.00	0.08
439	600316	洪都航空	1,300	49,010.00	0.08
440	600170	上海建工	20,500	48,995.00	0.08
441	300122	智飞生物	2,500	48,975.00	0.08
442	002065	东华软件	5,100	48,960.00	0.08
443	301037	保立佳	3,800	48,906.00	0.08
444	000683	博源化工	10,200	48,858.00	0.08
445	000686	东北证券	6,400	48,832.00	0.08
446	000551	创元科技	3,800	48,830.00	0.08
447	002245	蔚蓝锂芯	3,800	48,754.00	0.08
448	600027	华电国际	8,900	48,683.00	0.08
449	600797	浙大网新	5,100	48,603.00	0.08
450	002507	涪陵榨菜	3,800	48,602.00	0.08
451	002430	杭氧股份	2,500	48,550.00	0.08
452	601975	招商南油	16,600	48,472.00	0.08
453	600732	爱旭股份	3,700	48,470.00	0.08

454	002179	中航光电	1,200	48,432.00	0.08
455	002129	TCL 中环	6,300	48,384.00	0.08
456	300168	万达信息	6,300	48,321.00	0.08
456	601117	中国化学	6,300	48,321.00	0.08
457	301105	鸿铭股份	1,300	48,269.00	0.08
458	300303	聚飞光电	7,600	48,184.00	0.08
459	002400	省广集团	6,300	48,132.00	0.08
460	600763	通策医疗	1,162	47,967.36	0.08
461	002273	水晶光电	2,400	47,928.00	0.08
462	002506	协鑫集成	17,900	47,793.00	0.08
463	300390	天华新能	2,500	47,675.00	0.08
464	002240	盛新锂能	3,700	47,656.00	0.08
465	600161	天坛生物	2,480	47,591.20	0.08
466	002508	老板电器	2,500	47,525.00	0.08
467	600872	中炬高新	2,500	47,500.00	0.08
468	002057	中钢天源	5,100	47,379.00	0.08
469	002432	九安医疗	1,300	47,359.00	0.08
470	000581	威孚高科	2,500	47,350.00	0.08
471	300133	华策影视	6,300	47,313.00	0.08
472	001203	大中矿业	5,000	47,250.00	0.08
473	600703	三安光电	3,800	47,196.00	0.08
474	300777	中简科技	1,300	47,125.00	0.08
475	002607	中公教育	15,400	47,124.00	0.08
476	000999	华润三九	1,499	46,888.72	0.08
477	002385	大北农	11,600	46,864.00	0.08
478	000021	深科技	2,500	46,850.00	0.08
479	002865	钧达股份	1,200	46,800.00	0.08
480	002583	海能达	3,800	46,778.00	0.08
481	002332	仙琚制药	5,100	46,767.00	0.08
482	000531	穗恒运 A	7,600	46,740.00	0.08
483	600827	百联股份	5,100	46,614.00	0.08
484	600521	华海药业	2,500	46,575.00	0.08
485	002984	森麒麟	2,480	46,500.00	0.08
486	600157	永泰能源	34,700	46,498.00	0.08
487	300618	寒锐钴业	1,300	46,436.00	0.08
487	601001	晋控煤业	3,800	46,436.00	0.08
488	600733	北汽蓝谷	6,300	46,431.00	0.08
489	300296	利亚德	7,600	46,360.00	0.08
490	001258	立新能源	6,300	46,305.00	0.08
491	600783	鲁信创投	3,700	46,250.00	0.08
492	300193	佳士科技	5,100	46,155.00	0.08
493	600518	ST 康美	24,400	46,116.00	0.08
494	688669	聚石化学	2,439	46,023.93	0.08

495	601995	中金公司	1,300	45,968.00	0.08
496	601611	中国核建	5,000	45,950.00	0.08
497	603688	石英股份	1,300	45,786.00	0.07
498	300037	新宙邦	1,300	45,760.00	0.07
499	000563	陕国投 A	12,800	45,696.00	0.07
500	600515	海南机场	12,900	45,666.00	0.07
501	600100	同方股份	6,300	45,612.00	0.07
502	600388	ST 龙净	3,800	45,600.00	0.07
503	002926	华西证券	5,100	45,594.00	0.07
504	300315	掌趣科技	7,500	45,525.00	0.07
505	002353	杰瑞股份	1,300	45,500.00	0.07
506	600195	中牧股份	6,200	45,446.00	0.07
507	300824	北鼎股份	3,800	45,334.00	0.07
508	002709	天赐材料	2,500	45,300.00	0.07
509	000422	湖北宜化	3,800	45,296.00	0.07
509	001338	永顺泰	3,800	45,296.00	0.07
510	603589	口子窖	1,300	45,240.00	0.07
511	601020	华钰矿业	2,500	45,200.00	0.07
512	600963	岳阳林纸	10,200	45,186.00	0.07
513	000034	神州数码	1,200	45,168.00	0.07
514	600998	九州通	8,785	45,154.90	0.07
515	000823	超声电子	3,800	45,030.00	0.07
516	603658	安图生物	1,200	45,000.00	0.07
517	600011	华能国际	6,300	44,982.00	0.07
518	601788	光大证券	2,500	44,950.00	0.07
519	300002	神州泰岳	3,800	44,840.00	0.07
520	000157	中联重科	6,200	44,826.00	0.07
521	002131	利欧股份	12,800	44,800.00	0.07
522	001227	兰州银行	17,900	44,750.00	0.07
523	002706	良信股份	5,000	44,550.00	0.07
524	600171	上海贝岭	1,300	44,525.00	0.07
525	300012	华测检测	3,800	44,422.00	0.07
526	301019	宁波色母	2,509	44,384.21	0.07
527	002500	山西证券	7,600	44,384.00	0.07
528	600761	安徽合力	2,500	44,350.00	0.07
529	002367	康力电梯	6,300	44,289.00	0.07
530	600029	南方航空	7,500	44,250.00	0.07
531	300349	金卡智能	3,700	44,215.00	0.07
532	601009	南京银行	3,800	44,156.00	0.07
533	300470	中密控股	1,200	44,124.00	0.07
534	002226	江南化工	7,600	44,080.00	0.07
535	000723	美锦能源	10,200	44,064.00	0.07
536	300463	迈克生物	3,700	44,030.00	0.07

537	002783	凯龙股份	5,100	44,013.00	0.07
538	000887	中鼎股份	2,500	43,975.00	0.07
539	000987	越秀资本	6,400	43,904.00	0.07
540	002460	赣锋锂业	1,300	43,901.00	0.07
541	001979	招商蛇口	5,000	43,850.00	0.07
542	600155	华创阳安	6,300	43,848.00	0.07
542	600398	海澜之家	6,300	43,848.00	0.07
543	600248	陕建股份	11,500	43,815.00	0.07
544	002600	领益智造	5,100	43,809.00	0.07
545	600970	中材国际	5,100	43,758.00	0.07
546	000935	四川双马	2,400	43,728.00	0.07
547	600010	包钢股份	24,400	43,676.00	0.07
548	000783	长江证券	6,300	43,659.00	0.07
549	600331	宏达股份	5,000	43,650.00	0.07
550	002312	川发龙蟒	3,800	43,624.00	0.07
551	300144	宋城演艺	5,100	43,605.00	0.07
552	600699	均胜电子	2,500	43,600.00	0.07
553	600903	贵州燃气	6,300	43,596.00	0.07
554	300829	金丹科技	2,500	43,450.00	0.07
555	002739	万达电影	3,800	43,434.00	0.07
556	300285	国瓷材料	2,500	43,375.00	0.07
557	000831	中国稀土	1,200	43,344.00	0.07
558	002648	卫星化学	2,500	43,325.00	0.07
558	300181	佐力药业	2,500	43,325.00	0.07
559	600176	中国巨石	3,800	43,320.00	0.07
560	601777	力帆科技	5,100	43,299.00	0.07
561	600127	金健米业	6,300	43,281.00	0.07
562	600085	同仁堂	1,200	43,272.00	0.07
563	301059	金三江	3,800	43,244.00	0.07
564	600673	东阳光	3,700	43,031.00	0.07
565	002511	中顺洁柔	6,400	43,008.00	0.07
566	600906	财达证券	6,300	42,966.00	0.07
567	002498	汉缆股份	12,700	42,926.00	0.07
568	688126	沪硅产业	2,293	42,924.96	0.07
569	601881	中国银河	2,500	42,875.00	0.07
570	600282	南钢股份	10,200	42,840.00	0.07
571	601059	信达证券	2,500	42,750.00	0.07
572	002223	鱼跃医疗	1,200	42,720.00	0.07
573	600012	皖通高速	2,500	42,450.00	0.07
574	603300	华铁应急	3,800	42,370.00	0.07
575	002567	唐人神	8,900	42,364.00	0.07
576	600298	安琪酵母	1,200	42,204.00	0.07
577	600765	中航重机	2,500	42,200.00	0.07

578	002497	雅化集团	3,700	42,180.00	0.07
579	300049	福瑞股份	1,300	42,159.00	0.07
580	603609	禾丰股份	5,100	42,126.00	0.07
581	600926	杭州银行	2,500	42,050.00	0.07
582	300766	每日互动	1,200	41,928.00	0.07
583	300083	创世纪	5,100	41,922.00	0.07
583	603105	芯能科技	5,100	41,922.00	0.07
584	600559	老白干酒	2,500	41,875.00	0.07
585	002270	华明装备	2,500	41,850.00	0.07
586	600867	通化东宝	5,100	41,820.00	0.07
587	002738	中矿资源	1,300	41,808.00	0.07
588	600739	辽宁成大	3,800	41,800.00	0.07
589	300628	亿联网络	1,200	41,712.00	0.07
590	600986	浙文互联	5,100	41,667.00	0.07
591	002466	天齐锂业	1,300	41,652.00	0.07
592	002938	鹏鼎控股	1,300	41,639.00	0.07
593	000933	神火股份	2,500	41,600.00	0.07
594	300034	钢研高纳	2,500	41,575.00	0.07
595	601717	郑煤机	2,500	41,550.00	0.07
596	002841	视源股份	1,200	41,520.00	0.07
597	600166	福田汽车	15,300	41,463.00	0.07
598	002003	伟星股份	3,800	41,458.00	0.07
599	000797	中国武夷	15,400	41,426.00	0.07
600	002031	巨轮智能	5,100	41,412.00	0.07
601	600596	新安股份	5,100	41,310.00	0.07
602	601989	中国重工	8,900	41,296.00	0.07
603	688367	工大高科	2,339	41,283.35	0.07
604	002756	永兴材料	1,300	41,275.00	0.07
605	002023	海特高新	3,800	41,116.00	0.07
606	002360	同德化工	7,600	40,812.00	0.07
607	002136	安纳达	3,800	40,774.00	0.07
608	603063	禾望电气	1,200	40,632.00	0.07
609	601696	中银证券	3,800	40,622.00	0.07
610	301358	湖南裕能	1,300	40,547.00	0.07
611	002601	龙佰集团	2,500	40,525.00	0.07
612	300418	昆仑万维	1,200	40,356.00	0.07
613	600989	宝丰能源	2,500	40,350.00	0.07
614	000980	众泰汽车	19,200	40,320.00	0.07
615	300253	卫宁健康	3,800	40,280.00	0.07
615	601233	桐昆股份	3,800	40,280.00	0.07
616	600745	闻泰科技	1,200	40,236.00	0.07
617	002673	西部证券	5,100	40,188.00	0.07
618	600169	太原重工	16,600	40,172.00	0.07

619	600429	三元股份	8,900	40,139.00	0.07
620	002832	比音勒芬	2,500	40,125.00	0.07
621	601699	潞安环能	3,800	40,090.00	0.07
622	000966	长源电力	8,900	40,050.00	0.07
623	600933	爱柯迪	2,500	40,025.00	0.07
624	002060	广东建工	11,500	40,020.00	0.07
625	002563	森马服饰	7,600	39,976.00	0.07
626	605111	新洁能	1,300	39,962.00	0.07
627	603056	德邦股份	2,500	39,800.00	0.07
628	002085	万丰奥威	2,500	39,725.00	0.06
629	002236	大华股份	2,500	39,700.00	0.06
630	600873	梅花生物	3,700	39,553.00	0.06
631	601111	中国国航	5,000	39,450.00	0.06
632	002067	景兴纸业	10,200	39,372.00	0.06
633	002372	伟星新材	3,800	39,368.00	0.06
634	002203	海亮股份	3,800	39,216.00	0.06
635	000932	华菱钢铁	8,900	39,160.00	0.06
636	600535	天士力	2,500	39,125.00	0.06
637	601992	金隅集团	25,700	39,064.00	0.06
638	600373	中文传媒	3,800	39,026.00	0.06
639	600759	ST 洲际	16,600	39,010.00	0.06
640	300358	楚天科技	5,000	39,000.00	0.06
641	002911	佛燃能源	3,800	38,988.00	0.06
642	600283	钱江水利	3,800	38,836.00	0.06
643	600729	重庆百货	1,300	38,779.00	0.06
644	002548	金新农	10,200	38,760.00	0.06
645	300623	捷捷微电	1,300	38,740.00	0.06
646	301115	联检科技	2,500	38,725.00	0.06
647	300943	春晖智控	2,500	38,675.00	0.06
648	300633	开立医疗	1,300	38,636.00	0.06
649	000978	桂林旅游	6,300	38,619.00	0.06
650	000917	电广传媒	5,100	38,556.00	0.06
651	002157	正邦科技	14,100	38,493.00	0.06
652	600312	平高电气	2,500	38,475.00	0.06
653	600820	隧道股份	6,300	38,430.00	0.06
654	002154	报喜鸟	10,200	38,352.00	0.06
655	600383	金地集团	10,100	38,279.00	0.06
656	000960	锡业股份	2,500	38,250.00	0.06
657	600637	东方明珠	5,100	38,097.00	0.06
658	601636	旗滨集团	7,600	38,076.00	0.06
659	301373	凌玮科技	1,300	38,051.00	0.06
660	002661	克明食品	3,800	38,038.00	0.06
661	300699	光威复材	1,200	38,004.00	0.06

662	600256	广汇能源	6,300	37,926.00	0.06
663	600511	国药股份	1,300	37,908.00	0.06
664	600208	新湖中宝	12,800	37,888.00	0.06
665	600058	五矿发展	4,900	37,877.00	0.06
666	002327	富安娜	5,100	37,842.00	0.06
667	300355	蒙草生态	8,900	37,825.00	0.06
668	002670	国盛金控	2,500	37,625.00	0.06
669	002007	华兰生物	2,400	37,608.00	0.06
670	688728	格科微	2,439	37,560.60	0.06
671	002556	辉隆股份	6,300	37,485.00	0.06
672	000998	隆平高科	3,800	37,430.00	0.06
673	603279	景津装备	2,500	37,325.00	0.06
674	600197	伊力特	2,500	37,300.00	0.06
675	002151	北斗星通	1,300	37,297.00	0.06
676	300638	广和通	1,300	37,219.00	0.06
677	600118	中国卫星	1,300	37,141.00	0.06
678	002244	滨江集团	3,800	37,050.00	0.06
679	002176	江特电机	5,100	37,026.00	0.06
680	600927	永安期货	2,500	37,025.00	0.06
681	002533	金杯电工	3,800	37,012.00	0.06
682	301237	和顺科技	1,300	36,933.00	0.06
683	603005	晶方科技	1,300	36,907.00	0.06
684	000598	兴蓉环境	5,100	36,771.00	0.06
685	002864	盘龙药业	1,300	36,751.00	0.06
686	600909	华安证券	6,300	36,729.00	0.06
687	601966	玲珑轮胎	2,500	36,675.00	0.06
688	603578	三星新材	2,543	36,619.20	0.06
689	600618	氯碱化工	3,800	36,594.00	0.06
690	000528	柳工	3,800	36,518.00	0.06
691	300118	东方日升	3,800	36,404.00	0.06
692	301077	星华新材	1,798	36,391.52	0.06
693	601969	海南矿业	5,000	36,250.00	0.06
694	000893	亚钾国际	1,200	36,168.00	0.06
695	000090	天健集团	10,200	36,108.00	0.06
696	605589	圣泉集团	1,300	36,075.00	0.06
697	002675	东诚药业	2,500	35,975.00	0.06
698	600422	昆药集团	2,500	35,775.00	0.06
699	002299	圣农发展	2,500	35,725.00	0.06
700	000543	皖能电力	5,100	35,700.00	0.06
701	000876	新希望	3,800	35,644.00	0.06
702	000629	钒钛股份	13,900	35,584.00	0.06
703	601390	中国中铁	6,300	35,343.00	0.06
704	601216	君正集团	6,400	35,328.00	0.06

705	300316	晶盛机电	1,300	35,295.00	0.06
706	002646	天佑德酒	3,800	35,264.00	0.06
707	002603	以岭药业	2,500	35,250.00	0.06
708	600222	太龙药业	6,300	35,217.00	0.06
709	000930	中粮科技	6,300	35,154.00	0.06
710	600271	航天信息	3,800	35,112.00	0.06
711	300775	三角防务	1,300	34,918.00	0.06
712	300284	苏交科	3,800	34,580.00	0.06
713	002488	金固股份	2,500	34,500.00	0.06
714	002441	众业达	3,800	34,466.00	0.06
714	600848	上海临港	3,800	34,466.00	0.06
715	000636	风华高科	2,500	34,350.00	0.06
716	603882	金域医学	1,200	34,272.00	0.06
717	301189	奥尼电子	1,300	34,203.00	0.06
718	600126	杭钢股份	3,800	34,200.00	0.06
719	600133	东湖高新	3,800	34,124.00	0.06
720	000415	渤海租赁	10,200	33,966.00	0.06
720	600348	华阳股份	5,100	33,966.00	0.06
721	300876	蒙泰高新	1,300	33,800.00	0.06
722	002138	顺络电子	1,200	33,744.00	0.06
723	300377	赢时胜	1,300	33,735.00	0.06
724	603077	和邦生物	19,200	33,600.00	0.05
725	300657	弘信电子	1,200	33,468.00	0.05
726	000921	海信家电	1,300	33,410.00	0.05
726	600895	张江高科	1,300	33,410.00	0.05
727	000410	沈阳机床	5,100	33,405.00	0.05
728	300077	国民技术	1,300	33,280.00	0.05
729	600123	兰花科创	5,100	33,252.00	0.05
730	600546	山煤国际	3,800	33,174.00	0.05
731	002444	巨星科技	1,300	33,163.00	0.05
732	688599	天合光能	2,282	33,157.46	0.05
733	600399	抚顺特钢	6,300	32,886.00	0.05
734	688223	晶科能源	6,325	32,826.75	0.05
735	601098	中南传媒	2,500	32,800.00	0.05
736	688472	阿特斯	3,580	32,757.00	0.05
737	000036	华联控股	8,900	32,485.00	0.05
738	600378	昊华科技	1,200	32,484.00	0.05
739	002044	美年健康	6,300	32,382.00	0.05
740	000729	燕京啤酒	2,500	32,325.00	0.05
741	600233	圆通速递	2,500	32,225.00	0.05
742	300375	鹏翎股份	6,300	32,193.00	0.05
743	601236	红塔证券	3,800	32,186.00	0.05
744	688772	珠海冠宇	2,250	32,152.50	0.05

745	603806	福斯特	2,480	32,140.80	0.05
746	300364	中文在线	1,200	31,800.00	0.05
747	600868	梅雁吉祥	11,500	31,740.00	0.05
748	600566	济川药业	1,200	31,596.00	0.05
749	601179	中国西电	5,100	31,314.00	0.05
750	600916	中国黄金	3,800	31,046.00	0.05
751	688327	云从科技	2,250	31,027.50	0.05
752	600120	浙江东方	5,100	30,855.00	0.05
753	000301	东方盛虹	3,700	30,821.00	0.05
754	603613	国联股份	1,300	30,797.00	0.05
755	300677	英科医疗	1,300	30,784.00	0.05
756	002568	百润股份	1,200	30,732.00	0.05
757	600845	宝信软件	1,300	30,706.00	0.05
758	000567	海德股份	5,100	30,192.00	0.05
759	601901	方正证券	3,800	30,058.00	0.05
760	688469	芯联集成	6,300	30,051.00	0.05
761	002180	纳思达	1,300	29,822.00	0.05
762	600801	华新水泥	2,500	29,600.00	0.05
763	300759	康龙化成	1,200	29,448.00	0.05
764	300762	上海瀚讯	1,300	29,419.00	0.05
765	600720	中交设计	3,800	29,374.00	0.05
766	300298	三诺生物	1,300	29,367.00	0.05
767	001696	宗申动力	1,300	29,185.00	0.05
768	600754	锦江酒店	1,300	29,172.00	0.05
769	600750	江中药业	1,300	28,379.00	0.05
770	300413	芒果超媒	1,300	28,366.00	0.05
771	600985	淮北矿业	2,500	28,350.00	0.05
772	000099	中信海直	1,300	28,314.00	0.05
773	601666	平煤股份	3,800	28,158.00	0.05
774	002557	洽洽食品	1,300	28,106.00	0.05
775	300146	汤臣倍健	2,500	28,100.00	0.05
776	300529	健帆生物	1,300	28,041.00	0.05
777	601633	长城汽车	1,300	27,924.00	0.05
778	300115	长盈精密	1,300	27,820.00	0.05
779	002429	兆驰股份	6,300	27,594.00	0.05
780	601878	浙商证券	2,500	27,275.00	0.04
781	603298	杭叉集团	1,300	27,235.00	0.04
782	002262	恩华药业	1,300	27,014.00	0.04
783	603733	仙鹤股份	1,300	26,962.00	0.04
784	601567	三星医疗	1,200	26,904.00	0.04
785	600529	山东药玻	1,200	26,568.00	0.04
786	000403	派林生物	1,460	26,469.80	0.04
787	000627	*ST 天茂	9,600	26,304.00	0.04

788	601456	国联证券	2,500	25,875.00	0.04
789	603156	养元饮品	1,200	25,392.00	0.04
790	300738	奥飞数据	1,200	25,116.00	0.04
791	300045	华力创通	1,300	24,817.00	0.04
792	600481	双良节能	5,100	24,582.00	0.04
793	003008	开普检测	1,150	24,437.50	0.04
794	000983	山西焦煤	3,800	24,320.00	0.04
795	600602	云赛智联	1,200	24,204.00	0.04
796	300229	拓尔思	1,300	23,972.00	0.04
797	000785	居然智家	7,600	23,180.00	0.04
798	600206	有研新材	1,200	22,932.00	0.04
799	600131	国网信通	1,200	21,240.00	0.03
800	300068	南都电源	1,300	20,696.00	0.03
801	300170	汉得信息	1,200	20,652.00	0.03
802	600621	华鑫股份	1,300	19,903.00	0.03
803	601865	福莱特	1,300	19,773.00	0.03
804	002635	安洁科技	1,300	17,602.00	0.03
805	601038	一拖股份	1,300	16,991.00	0.03

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	688411	海博思创	215	17,950.35	0.03
2	301458	钧崑电子	417	14,223.87	0.02
3	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.02
4	688583	思看科技	159	12,669.12	0.02
5	301602	超研股份	470	11,656.00	0.02
6	301601	惠通科技	316	10,696.60	0.02
7	688545	兴福电子	365	9,836.75	0.02
8	001391	国货航	1,100	7,403.00	0.01
9	603072	天和磁材	121	6,588.45	0.01
10	001356	富岭股份	320	4,620.80	0.01
11	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.01
12	835185	贝特瑞	100	2,330.00	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	967,357.40	0.77
2	601211	国泰海通	467,651.08	0.37

3	000333	美的集团	444,699.00	0.35
4	002594	比亚迪	441,956.00	0.35
5	000858	五粮液	324,433.00	0.26
6	300059	东方财富	306,110.00	0.24
7	300760	迈瑞医疗	305,294.00	0.24
8	600519	贵州茅台	298,436.00	0.24
9	000651	格力电器	270,893.00	0.22
10	002475	立讯精密	235,953.00	0.19
11	000158	常山北明	220,557.00	0.18
12	300432	富临精工	199,641.00	0.16
13	300832	新产业	173,706.00	0.14
14	301109	军信股份	170,307.00	0.14
15	300124	汇川技术	167,416.00	0.13
16	300274	阳光电源	164,351.00	0.13
17	002439	启明星辰	153,236.00	0.12
18	000860	顺鑫农业	151,192.00	0.12
19	002415	海康威视	150,870.00	0.12
20	002123	梦网科技	150,462.00	0.12

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,917,179.00	1.53
2	000333	美的集团	950,270.00	0.76
3	002594	比亚迪	890,172.00	0.71
4	300059	东方财富	683,448.00	0.54
5	000858	五粮液	679,103.00	0.54
6	300308	中际旭创	663,408.60	0.53
7	300760	迈瑞医疗	595,843.00	0.47
8	000651	格力电器	579,890.00	0.46
9	002475	立讯精密	459,672.00	0.37
10	000725	京东方 A	392,043.00	0.31
11	300124	汇川技术	349,015.00	0.28
12	300454	深信服	346,594.00	0.28
13	300274	阳光电源	335,416.00	0.27
14	000568	泸州老窖	326,161.00	0.26
15	000001	平安银行	312,642.00	0.25
16	002415	海康威视	307,459.00	0.24
17	002714	牧原股份	303,030.00	0.24
18	603596	伯特利	292,253.00	0.23
19	300674	宇信科技	286,903.00	0.23
20	688002	睿创微纳	286,162.56	0.23

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	43,465,470.60
卖出股票收入（成交）总额	68,077,797.19

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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	601,037.56
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	601,037.56

### 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	688411	海博思创	17,950.35	0.03	新股锁定期内
2	301458	钧崑电子	14,223.87	0.02	新股锁定期内
3	688758	赛分科技	13,185.69	0.02	新股锁定期内
4	688583	思看科技	12,669.12	0.02	新股锁定期内
5	301602	超研股份	11,656.00	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 (%)
1,172	15,154.11	10,371,487.00	58.40	7,389,134.00	41.60

## 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	招商证券股份有限公司	2,295,705.00	12.93
2	国联证券股份有限公司	1,500,000.00	8.45
3	中信证券股份有限公司	927,655.00	5.22
4	云南省烟草公司昆明市公司企业年金计划—中国光大银行股份有限公司	839,000.00	4.72
5	浙商证券股份有限公司	743,626.00	4.19
6	广发证券股份有限公司	609,170.00	3.43
7	中国国际金融股份有限公司	598,921.00	3.37
8	招商银行股份有限公司—交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF)	586,100.00	3.30
9	中国银河证券股份有限公司	554,834.00	3.12
10	太原市热力集团有限责任公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	400,000.00	2.25

## 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（2023 年 10 月 30 日） 基金份额总额	635,421,000.00
本报告期期初基金份额总额	38,560,621.00
本报告期基金总申购份额	13,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	33,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,760,621.00

## § 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 (%)	
银河证券	2	53,498,048.57	48.25	10,701.04	48.25	-
招商证券	2	31,200,508.96	28.14	6,241.74	28.14	-
方正证券	4	20,428,517.70	18.43	4,086.20	18.42	-
广发证券	2	5,740,883.50	5.18	1,148.56	5.18	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	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，基金租用券商交易单元新增申万宏源证券、国泰海通证券。

4、国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。根据《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，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

## 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 (%)
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	12,214.10	100.00	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-

证券							
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-

## 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	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股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 04 月 24 日
7	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
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20250311-202	6,675,340	186,300.	6,861,636	4.00	0.00

	50324;202504 08-20250415;	.00	00	.00	
--	------------------------------	-----	----	-----	--

#### 产品特有风险

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

### 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