

华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 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	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产变动表	18
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	39
7.1	期末基金资产组合情况	39
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	53
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	56
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12	投资组合报告附注	56

§ 8	基金份额持有人信息	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§ 9	开放式基金份额变动	59
§ 10	重大事件揭示	60
10.1	基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4	基金投资策略的改变	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	60
10.8	其他重大事件	61
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 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	华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰保兴中证 A500 指数增强	
基金主代码	023516	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 05 月 30 日	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	238,571,681.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴中证 A500 指数增强 A	华泰保兴中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023516	023517
报告期末下属分级基金的份额总额	53,186,504.87 份	185,385,176.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过基本面及定量分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强投资策略，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，有限度地调整成份股或者各成份股在标的指数中权重的偏离，力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。 本基金可以将标的指数成份股及备选成份股之外的股票纳入基金股票池，并构建主动型投资组合。 在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，年跟踪误差不超过 8%。如因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和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为股票指数增强型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金若投资港股通标的股票，则还会面临港股交易失败风险、汇率风险、境外市场等特有风险。

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		华泰保兴基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王相国	冯萌
	联系电话	021-80299000	021-52629999-213310
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-632-9090	95561
传真		021-60756968	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道 88 号 3810 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200126	200120
法定代表人		杨平	吕家进

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰保兴基金管理有限公司	上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026年01月01日至2026年06月30日）	
	华泰保兴中证 A500 指数增强 A	华泰保兴中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	2,603,719.00	38,491,054.91
本期利润	4,344,568.21	42,142,814.25
加权平均基金份额本期利润	0.2984	0.1592
本期加权平均净值利润率	24.02%	13.05%
本期基金份额净值增长率	14.54%	14.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年06月30日）	
	华泰保兴中证 A500 指数增强 A	华泰保兴中证 A500 指数增强 C
期末可供分配利润	16,360,603.63	55,969,279.42
期末可供分配基金份额利润	0.3076	0.3019
期末基金资产净值	71,035,115.73	246,534,967.59
期末基金份额净值	1.3356	1.3299
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年06月30日）	
	华泰保兴中证 A500 指数增强 A	华泰保兴中证 A500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	33.56%	32.99%

注：1、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。

2、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、所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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.50%	1.35%	13.54%	1.34%	1.96%	0.01%
过去六个月	14.54%	1.23%	11.34%	1.22%	3.20%	0.01%
过去一年	32.39%	1.05%	34.41%	1.09%	-2.02%	-0.04%
自基金合同生效起至今	33.56%	1.01%	37.18%	1.05%	-3.62%	-0.04%

华泰保兴中证 A500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.38%	1.35%	13.54%	1.34%	1.84%	0.01%
过去六个月	14.31%	1.23%	11.34%	1.22%	2.97%	0.01%
过去一年	31.87%	1.05%	34.41%	1.09%	-2.54%	-0.04%
自基金合同生效起至今	32.99%	1.01%	37.18%	1.05%	-4.19%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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



华泰保兴中证 A500 指数增强 C



§ 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

华泰保兴基金管理有限公司（以下或简称“公司”或“本公司”）经中国证监会证监许可（2016）1309 号文核准，于 2016 年 07 月 26 日成立，公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司（以下简称“华泰保险集团”）、上海飞恒资产管理中心（有限合伙）（以下简称“飞恒资产”）、上海旷正资产管理中心（有限合伙）（以下简称“旷正资产”）、上海泰颐资产管理中心（有限合伙）（以下简称“泰颐资产”）、上海哲昌资产管理中心（有限合伙）（以下简称“哲昌资产”）、上海志庄资产管理中心（有限合伙）（以下简称“志庄资产”）。公司注册资本人民币 24,000 万元，其中，华泰保险集团持股比例为 85%，飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台，合计持股比例为 15%。2022 年 03 月 25 日，公司设立北京分公司。2024 年 12 月 27 日，公司设立华南分公司。目前，公司经营范围为基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。此外，公司还具有保险资金受托管理资格。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 37 只公募基金，公募基金资产管理总规模为 783.98 亿元人民币，包括货币型、债券型、混合型、股票型、指数型等类型。

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		
赵旭照	基金经理、投资经理	2025 年 05 月 30 日	—	12 年	北京大学金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员。2016 年 12 月加入华泰保兴基金管理有限公司。
王恺钺	基金经理	2025 年 06 月 26 日	—	8 年	南开大学经济学硕士，CPA。历任民生证券股份有限公司研究员、投资经理。2024 年 12 月加入华泰保兴基金管理有限公司。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
赵旭照	公募基金	5	1,130,619,949.53	2018 年 01 月 15 日
	私募资产管理计划	1	8,505,671.41	2025 年 10 月 17 日
	其他组合	-	-	-
	合计	6	1,139,125,620.94	-

注：任职时间为首次开始管理本类产品的时间。

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投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他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

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统内的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内，未发现各投资组合因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《异常交易监控与报告管理办法》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部的反向交易以

及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为，严格监控同一交易日内不同投资组合之间的反向交易。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内，未发生本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的情形，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场整体呈现高波动与结构快速轮动并存的特征。一季度在流动性充裕与风险偏好快速提升的背景下，市场成交显著放大，指数阶段性上行；随后在政策预期变化、外部扰动及资金行为调整等多重因素影响下，市场转入震荡整理阶段，波动明显加大。进入二季度，期初迎来阶段性修复，部分超跌板块及具备产业逻辑支撑的方向表现活跃；随后受地缘政治冲突演化、全球流动性预期反复及风险偏好波动影响，市场一度承压，逐步进入存量资金博弈阶段；随着外部不确定性逐步落地，市场情绪修复，指数再度企稳回升。

从指数表现来看，上半年中证 A500 指数整体呈现震荡上行态势，阶段性波动有所加大，单季度涨幅约 12%，同期沪深 300 指数上涨约 8%。相较传统大盘宽基指数，中证 A500 在行业分布均衡的基础上兼具一定成长弹性，在风格切换频繁的市场环境中展现出较强的适应能力。

从结构层面来看，指数成份股延续明显分化特征。科技成长仍为市场主线，AI 产业链由前期主题驱动逐步过渡至业绩验证阶段，算力、半导体等细分方向在基本面支撑下表现相对稳健；与此同时，部分高估值、交易拥挤的领域出现阶段性回调，市场内部结构分化进一步加剧。

风格视角，上半年市场风格切换较为频繁。一季度在流动性宽松阶段，高估值、高弹性及中小市值板块表现更为突出，而在震荡调整阶段，资金逐步回流至盈利确定性更强、估值更具性价比的资产；二季度延续这一趋势，市场风格由高弹性逐步向业绩确定性回归，中小盘波动加剧，资金向大盘成长及部分价值风格切换，整体风格演绎趋于理性。

在组合管理层面，本产品坚持“基本面驱动+量化增强”的核心投资框架，并持续深化多策略协同运作。一方面，以基本面研究为核心，重点关注企业盈利能力、估值水平与成长性的匹配度，围绕具备产业趋势与业绩支撑的方向进行配置；另一方面，在传统基本面因子基础上融合量价、预期与行为特征，挖掘低相关性因子，提升收益来源的多样性与稳定性。同时，稳步推进分域建模与

多策略融合，针对不同行业景气特征与市场环境构建差异化子策略，并在组合层面进行动态优化，以增强策略在高轮动市场中的适应能力与超额收益获取能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.3356 元，本报告期内基金份额净值增长率为 14.54%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；截至本报告期末华泰保兴中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.3299 元，本报告期内基金份额净值增长率为 14.31%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面来看，当前经济增长呈现边际放缓与结构分化并存的特征。一线城市房地产价格出现止跌企稳迹象，但改善持续性仍有待观察；制造业 PMI 回落至临界水平附近，整体呈现供给偏强、需求偏弱、价格相对高位的格局。工业企业利润增速有所回升，但行业间分化显著，TMT、半导体及部分出口导向的中高端制造业维持较高景气，而消费及地产链仍处于修复过程中。

流动性方面，国内整体维持“稳中偏松、边际收敛”的状态，货币政策在保持合理充裕的同时更加注重节奏与结构优化。海外方面，地缘政治冲突边际缓和带动油价回落，美联储流动性收紧预期逐步缓解，但 AI 产业发展对就业结构及资本开支的影响仍在持续演绎。

市场层面，短期内地缘政治及全球流动性预期仍可能对市场形成扰动，A 股整体或维持震荡格局，结构性行情仍将主导。市场风格方面，当前科技板块交易热度已接近历史高位，叠加大型 IPO 对流动性的分流及算力供给扩张带来的潜在不确定性，短期波动可能加大；与此同时，前期滞涨的价值板块在估值与持仓上均处于低位，具备一定修复空间，市场风格具备再平衡基础，但短期内大级别风格切换的概率相对有限。

行业层面，中长期产业升级与科技创新主线未发生改变。在海外 AI 资本开支逻辑未被证伪的前提下，科技成长仍是景气度最为明确的方向。随着中报季临近，业绩验证的重要性提升，高景气成长板块有望占优；同时，在基本面逐步确认的背景下，大盘股或具备阶段性相对优势，但需关注潜在拥挤风险，而小盘股在流动性边际改善阶段仍存在阶段性机会。

总体来看，市场将在震荡中延续结构性分化格局，基本面与产业趋势仍是决定中长期收益的核心变量。产品将继续坚持多策略融合与风险控制，在复杂市场环境中积极把握结构性机会，力争实现持续稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的

公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由公司分管运营副总和投研部门、风险管理部、监察稽核部及运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

投研部门负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，提出适用的估值模型和参数；负责对第三方估值机构的估值质量进行定期评估。风险管理部负责对特殊投资品种的估值技术和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证投研部门提供的估值模型和参数并协助提供数据支持文件。监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核。运营保障部根据相关法规和公司估值管理办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的固定收益品种/在证券交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

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

本基金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合规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	74,887,792.49	30,084,185.80
结算备付金		1,650,718.08	2,155,724.02
存出保证金		361,391.05	372,848.15
交易性金融资产	6.4.7.2	293,541,272.76	406,847,651.98
其中：股票投资		293,532,642.83	405,634,265.90
基金投资		-	-
债券投资		8,629.93	1,213,386.08
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	-	-
应收清算款		-	4,872,829.77
应收股利		-	-
应收申购款		1,639,347.27	539,065.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		372,080,521.65	444,872,305.35
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		50,467,619.32	-
应付赎回款		3,366,058.35	15,724,945.38
应付管理人报酬		173,360.07	341,177.40
应付托管费		43,340.02	85,294.34
应付销售服务费		75,620.27	156,710.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	384,440.30	445,589.45
负债合计		54,510,438.33	16,753,716.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	238,571,681.00	367,915,014.86
未分配利润	6.4.7.8	78,998,402.32	60,203,573.67
净资产合计		317,570,083.32	428,118,588.53
负债和净资产总计		372,080,521.65	444,872,305.35

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，华泰保兴中证 A500 指数增强 A 基金份额净值 1.3356 元，基金份额总额 53,186,504.87 份；华泰保兴中证 A500 指数增强 C 基金份额净值 1.3299 元，基金份额总额 185,385,176.13 份。华泰保兴中证 A500 指数增强份额总额合计为 238,571,681.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 05 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		48,935,409.43	3,098,934.19
1. 利息收入		53,843.55	170,582.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	53,843.55	47,278.57
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		-	123,304.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		43,464,689.95	706,214.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	41,611,430.97	55,010.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	740.05	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,852,518.93	651,203.90
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	5,392,608.55	2,222,136.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	24,267.38	-
减：二、营业总支出		2,448,026.97	384,984.50
1. 管理人报酬		1,366,975.87	216,080.77

2. 托管费		341,743.91	54,020.18
3. 销售服务费		646,999.38	95,219.51
4. 投资顾问费		-	0.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	4.84
8. 其他费用	6.4.7.18	92,307.81	19,659.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,487,382.46	2,713,949.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,487,382.46	2,713,949.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		46,487,382.46	2,713,949.69

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	367,915,014.86	60,203,573.67	428,118,588.53
二、本期期初净资产	367,915,014.86	60,203,573.67	428,118,588.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-129,343,333.86	18,794,828.65	-110,548,505.21
（一）、综合收益总额	-	46,487,382.46	46,487,382.46
（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）	-129,343,333.86	-27,692,553.81	-157,035,887.67
其中：1. 基金申购款	592,198,738.25	138,841,552.06	731,040,290.31
2. 基金赎回款	-721,542,072.11	-166,534,105.87	-888,076,177.98
（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、本期期末净资产	238,571,681.00	78,998,402.32	317,570,083.32
项目	上期 2025 年 05 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	317,909,709.84	-	317,909,709.84
三、本期增减变动额（减少以“-”	-	2,713,949.69	2,713,949.69

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	2,713,949.69	2,713,949.69
(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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
(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、本期期末净资产	317,909,709.84	2,713,949.69	320,623,659.53

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>王现成</u>	<u>赵俊</u>	<u>王云凌</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

华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金(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(2025)257 号《关于准予华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由华泰保兴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《华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案，《华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 05 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 317,909,709.84 份基金份额，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度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

本基金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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，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。对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人

运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	74,887,792.49
等于：本金	74,885,156.10
加：应计利息	2,636.39
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
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	—
合计	74,887,792.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		275,867,797.38	-	293,532,642.83	17,664,845.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,000.00	2.13	8,629.93	3,627.80
	银行间市场	-	-	-	-
	小计	5,000.00	2.13	8,629.93	3,627.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		275,872,797.38	2.13	293,541,272.76	17,668,473.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

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

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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 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	300,137.74
其中：交易所市场	300,137.74
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	24,795.19

应付信息披露费	59,507.37
合计	384,440.30

6.4.7.7 实收基金

华泰保兴中证 A500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,178,349.76	34,178,349.76
本期申购	55,737,053.56	55,737,053.56
本期赎回（以“-”号填列）	-36,728,898.45	-36,728,898.45
本期末	53,186,504.87	53,186,504.87

华泰保兴中证 A500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	333,736,665.10	333,736,665.10
本期申购	536,461,684.69	536,461,684.69
本期赎回（以“-”号填列）	-684,813,173.66	-684,813,173.66
本期末	185,385,176.13	185,385,176.13

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

华泰保兴中证 A500 指数增强 A

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	4,278,166.31	1,398,397.07	5,676,563.38
本期期初	4,278,166.31	1,398,397.07	5,676,563.38
本期利润	2,603,719.00	1,740,849.21	4,344,568.21
本期基金份额交易产生的变动数	9,478,718.32	-1,651,239.05	7,827,479.27
其中：基金申购款	15,644,387.78	52,374.54	15,696,762.32
基金赎回款	-6,165,669.46	-1,703,613.59	-7,869,283.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,360,603.63	1,488,007.23	17,848,610.86

华泰保兴中证 A500 指数增强 C

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	40,887,464.46	13,639,545.83	54,527,010.29

本期期初	40,887,464.46	13,639,545.83	54,527,010.29
本期利润	38,491,054.91	3,651,759.34	42,142,814.25
本期基金份额交易产生的变动数	-23,409,239.95	-12,110,793.13	-35,520,033.08
其中：基金申购款	110,425,970.98	12,718,818.76	123,144,789.74
基金赎回款	-133,835,210.93	-24,829,611.89	-158,664,822.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,969,279.42	5,180,512.04	61,149,791.46

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	50,342.34
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	2,809.83
其他	691.38
合计	53,843.55

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,448,608,171.38
减：卖出股票成本总额	1,405,561,190.43
减：交易费用	1,435,549.98
买卖股票差价收入	41,611,430.97

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	536.05
债券投资收益--买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	204.00
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	740.05

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,213,920.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,199,796.00
减：应计利息总额	13,920.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	204.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,852,518.93
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	1,852,518.93

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1. 交易性金融资产	5,392,608.55
— 股票投资	5,389,184.75
— 债券投资	3,423.80
— 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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,392,608.55

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	24,267.38
合计	24,267.38

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	8.28
银行汇划费用	7,996.97
合计	92,307.81

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

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期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
华泰保兴基金管理有限公司（“华泰保兴基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰人寿保险股份有限公司（“华泰寿险”）	基金管理人控股股东控制的机构

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年 06月30日	上年度可比期间 2025年05月30日（基金合 同生效日）至2025年06月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,366,975.87	216,080.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	674,632.77	107,726.19
应支付基金管理人的净管理费	692,343.10	108,354.58

注：支付基金管理人华泰保兴基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年 06月30日	上年度可比期间 2025年05月30日（基金合 同生效日）至2025年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	341,743.91	54,020.18

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴中证 A500 指数 增强 A	华泰保兴中证 A500 指数 增强 C	合计
兴业银行	-	597,397.38	597,397.38
合计	-	597,397.38	597,397.38

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年05月30日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴中证 A500 指数 增强 A	华泰保兴中证 A500 指数 增强 C	合计
兴业银行	-	95,141.56	95,141.56
合计	-	95,141.56	95,141.56

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰保兴基金，再由华泰保兴基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未持有过本基金份额。

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

华泰保兴中证 A500 指数增强 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰寿险	40,536,565.19	16.99%	-	-

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金法律文件公布的费率执行。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年05月30日（基金合同生效日）至2025年06月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	74,887,792.49	50,342.34	179,836,121.17	47,270.40

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2026 年 06 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	锁定期股票	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	锁定期股票	53.26	58.74	104	5,539.04	6,108.96	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期股票	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	锁定期股票	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	锁定期股票	27.19	31.31	311	8,456.09	9,737.41	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	锁定期股票	30.38	38.99	214	6,501.32	8,343.86	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	10.12	27.73	1,460	14,775.20	40,485.80	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	锁定期股票	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	锁定期股票	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	锁定期股票	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	锁定期股票	7.08	28.40	513	3,632.04	14,569.20	-
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	锁定期股票	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	锁定期股票	69.66	160.06	389	27,097.74	62,263.34	-
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期股票	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	锁定期股票	11.18	17.59	306	3,421.08	5,382.54	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	锁定期股票	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	锁定期股票	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	锁定期股票	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	锁定期股票	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	锁定期股票	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	锁定期股票	40.98	308.19	92	3,770.16	28,353.48	-
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	锁定期股票	17.52	35.92	1,416	24,808.32	50,862.72	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	锁定期股票	44.56	468.67	109	4,857.04	51,085.03	-
688808	联讯仪器	2026 年 04 月 16 日	6 个月	锁定期股票	81.88	1,584.33	130	10,644.40	205,962.90	-
688811	有研复材	2026 年 04 月 01 日	6 个月	锁定期股票	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	锁定期股票	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	6 个月	锁定期股票	55.95	57.10	159	8,896.05	9,078.90	-
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	锁定期股票	9.47	70.14	1,104	10,454.88	77,434.56	-

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（张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

113704	春风转债	2026 年 06 月 10 日	1 个月内 (含)	新债未上 市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.05	-
--------	------	------------------------	--------------	-----------	--------	--------	----	----------	----------	---

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。

5、以上“受限期”为上市公司公告披露的限售期。

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
603137	恒尚节能	2026 年 06 月 16 日	重大事 项	12.94	2026 年 07 月 01 日	14.23	200	2,548.00	2,588.00	-
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事 项	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	1,300	640,854.31	1,081,600.00	-

注：本基金本报告期末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

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

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、董事会审计委员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，检查公司内部风险控制制度的执行情况，并对公司出现的风险问题和存在的风险隐患进行研究并提出处理意见；董事会下设审计委员会，负责检查公司财务，并对公司董事、高级管理人员执行职务的行为进行监督，如公司董事、高级管理人员的行为损害公司或股东的利益时，有权要求其予以纠正。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，其他高级管理人员负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，使得各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

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评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；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的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及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之内。

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兴业银行，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，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0027%（2025 年 12 月 31 日：0.2834%）。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

于 2026 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时间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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金

的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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%。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	74,887,792.49	-	-	-	-	74,887,792.49
结算备付金	1,650,718.08	-	-	-	-	1,650,718.08
存出保证金	361,391.05	-	-	-	-	361,391.05
交易性金融资产	-	8,629.93	-	-	-293,532,642.83	293,541,272.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	1,639,347.27	1,639,347.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	76,899,901.62	8,629.93	-	-	-295,171,990.10	372,080,521.65
负债						
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	50,467,619.32	50,467,619.32
应付赎回款	-	-	-	-	3,366,058.35	3,366,058.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	173,360.07	173,360.07
应付托管费	-	-	-	-	43,340.02	43,340.02
应付销售服务费	-	-	-	-	75,620.27	75,620.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	384,440.30	384,440.30
负债总计	-	-	-	-	54,510,438.33	54,510,438.33
利率敏感度缺口	76,899,901.62	8,629.93	-	-	-240,661,551.77	317,570,083.32
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	30,084,185.80	-	-	-	-	30,084,185.80
结算备付金	2,155,724.02	-	-	-	-	2,155,724.02
存出保证金	372,848.15	-	-	-	-	372,848.15
交易性金融资产	1,213,386.08	-	-	-	-405,634,265.90	406,847,651.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	4,872,829.77	4,872,829.77
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	539,065.63	539,065.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,826,144.05	-	-	-	411,046,161.30	444,872,305.35
负债	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	15,724,945.38	15,724,945.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	341,177.40	341,177.40
应付托管费	-	-	-	-	85,294.34	85,294.34
应付销售服务费	-	-	-	-	156,710.25	156,710.25
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	445,589.45	445,589.45
负债总计	-	-	-	-	16,753,716.82	16,753,716.82
利率敏感度缺口	33,826,144.05	-	-	-	-394,292,444.48	428,118,588.53

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0027%（2025 年 12 月 31 日：0.2834%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易

的证券投资品种，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例不低于 80%，其中投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	293,532,642.83	92.43	405,634,265.90	94.75
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,629.93	0.00	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	293,541,272.76	92.43	405,634,265.90	94.75

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	14,591,719.84	17,351,684.42
	业绩比较基准下降 5%	-14,591,719.84	-17,351,684.42

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	291,659,640.46	402,470,682.90
第二层次	1,085,188.05	4,376,969.08
第三层次	796,444.25	-
合计	293,541,272.76	406,847,651.98

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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	293,532,642.83	78.89
	其中：股票	293,532,642.83	78.89
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,629.93	0.00
	其中：债券	8,629.93	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	76,538,510.57	20.57
8	其他各项资产	2,000,738.32	0.54
9	合计	372,080,521.65	100.00

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	262,425.00	0.08
B	采矿业	9,785,407.80	3.08
C	制造业	188,035,306.08	59.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,174,513.00	1.94
E	建筑业	2,026,130.00	0.64
F	批发和零售业	4,252,079.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	6,897,080.00	2.17
H	住宿和餐饮业	262,367.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,152,763.00	3.51
J	金融业	22,093,332.00	6.96
K	房地产业	1,660,154.00	0.52
L	租赁和商务服务业	4,352,713.00	1.37
M	科学研究和技术服务业	6,825,263.00	2.15
N	水利、环境和公共设施管理业	139,656.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	711,269.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	57,988.00	0.02
S	综合	465,970.00	0.15
	合计	265,154,415.88	83.49

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	75,023.82	0.02
C	制造业	22,475,074.67	7.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	597,808.00	0.19
E	建筑业	366,872.00	0.12
F	批发和零售业	1,134,328.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	2,575.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	368,812.00	0.12
J	金融业	137,805.00	0.04
K	房地产业	144,114.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,551,081.00	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	877,543.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	647,190.00	0.20
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,378,226.95	8.94

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	12,944	16,438,880.00	5.18
2	300750	宁德时代	20,100	7,899,501.00	2.49
3	300502	新易盛	12,360	7,502,520.00	2.36
4	688008	澜起科技	20,100	6,228,990.00	1.96
5	603259	药明康德	46,800	5,827,068.00	1.83
6	603986	兆易创新	6,600	5,379,000.00	1.69

7	688256	寒武纪	3,300	5,265,315.00	1.66
8	600519	贵州茅台	4,100	4,860,509.00	1.53
9	600030	中信证券	121,100	3,479,203.00	1.10
10	600150	中国船舶	102,251	3,455,061.29	1.09
11	300408	三环集团	19,700	3,287,930.00	1.04
12	688012	中微公司	6,900	3,232,650.00	1.02
13	601988	中国银行	550,500	3,148,860.00	0.99
14	688981	中芯国际	19,500	3,096,990.00	0.98
15	000651	格力电器	77,263	2,897,362.50	0.91
16	002353	杰瑞股份	18,000	2,745,000.00	0.86
17	600487	亨通光电	25,100	2,744,434.00	0.86
18	601318	中国平安	57,200	2,730,728.00	0.86
19	002463	沪电股份	17,500	2,674,000.00	0.84
20	688396	华润微	26,700	2,604,585.00	0.82
21	300475	香农芯创	8,600	2,580,000.00	0.81
22	688002	睿创微纳	15,339	2,372,789.91	0.75
23	601899	紫金矿业	94,300	2,370,702.00	0.75
24	002281	光迅科技	8,900	2,286,766.00	0.72
25	002273	水晶光电	63,900	2,267,172.00	0.71
26	601328	交通银行	342,600	2,202,918.00	0.69
27	601398	工商银行	297,800	2,105,446.00	0.66
28	000933	神火股份	96,900	2,054,280.00	0.65
29	601872	招商轮船	116,300	2,043,391.00	0.64
30	002384	东山精密	7,700	2,020,095.00	0.64
31	605117	德业股份	18,700	1,985,566.00	0.63
32	300857	协创数据	5,800	1,971,420.00	0.62
33	002916	深南电路	4,300	1,968,970.00	0.62
34	600183	生益科技	11,300	1,959,420.00	0.62
35	000333	美的集团	25,100	1,895,803.00	0.60
36	688498	源杰科技	1,000	1,886,000.00	0.59
37	002049	紫光国微	21,200	1,881,500.00	0.59
38	600887	伊利股份	77,800	1,864,088.00	0.59
39	300054	鼎龙股份	17,400	1,843,878.00	0.58
40	600885	宏发股份	49,700	1,714,153.00	0.54
41	300476	胜宏科技	4,900	1,697,507.00	0.53
42	600036	招商银行	45,800	1,625,900.00	0.51
43	002415	海康威视	46,000	1,573,200.00	0.50
44	600160	巨化股份	29,600	1,569,096.00	0.49
45	000408	藏格矿业	22,600	1,566,632.00	0.49
46	003816	中国广核	396,500	1,550,315.00	0.49
47	000807	云铝股份	70,000	1,549,800.00	0.49

48	600522	中天科技	24,700	1,498,796.00	0.47
49	000338	潍柴动力	53,500	1,457,875.00	0.46
50	600497	驰宏锌锗	119,100	1,442,301.00	0.45
51	300033	同花顺	5,940	1,431,540.00	0.45
52	000792	盐湖股份	47,300	1,427,987.00	0.45
53	000960	锡业股份	33,000	1,408,770.00	0.44
54	688521	芯原股份	3,700	1,373,218.00	0.43
55	600176	中国巨石	18,300	1,333,704.00	0.42
56	600674	川投能源	93,600	1,326,312.00	0.42
57	000415	渤海租赁	325,000	1,322,750.00	0.42
58	600535	天士力	99,500	1,316,385.00	0.41
59	002008	大族激光	8,500	1,275,935.00	0.40
60	601766	中国中车	242,600	1,261,520.00	0.40
61	688041	海光信息	3,400	1,259,020.00	0.40
62	600938	中国海油	46,200	1,254,330.00	0.39
63	600104	上汽集团	127,800	1,247,328.00	0.39
64	688017	绿的谐波	2,900	1,211,794.00	0.38
65	002738	中矿资源	20,400	1,203,396.00	0.38
66	000032	深桑达 A	48,200	1,202,590.00	0.38
67	002027	分众传媒	246,200	1,191,608.00	0.38
68	300661	圣邦股份	8,300	1,190,884.00	0.37
69	000938	紫光股份	40,800	1,177,488.00	0.37
70	601601	中国太保	40,600	1,157,912.00	0.36
71	600482	中国动力	34,700	1,138,160.00	0.36
72	601238	广汽集团	215,700	1,095,756.00	0.35
73	601100	恒立液压	10,100	1,086,356.00	0.34
74	688072	拓荆科技	1,300	1,081,600.00	0.34
75	000426	兴业银锡	32,800	1,081,088.00	0.34
76	600875	东方电气	37,400	1,075,998.00	0.34
77	600115	中国东航	275,500	1,049,655.00	0.33
78	600900	长江电力	39,200	1,037,624.00	0.33
79	002028	思源电气	5,800	1,003,400.00	0.32
80	000568	泸州老窖	12,550	972,876.00	0.31
81	688063	派能科技	17,800	948,206.00	0.30
82	600549	厦门钨业	11,100	945,720.00	0.30
83	600515	海南机场	344,300	943,382.00	0.30
84	002938	鹏鼎控股	8,900	937,882.00	0.30
85	000001	平安银行	93,100	935,655.00	0.29
86	300759	康龙化成	32,300	934,439.00	0.29
87	600415	小商品城	91,600	930,656.00	0.29
88	000725	京东方 A	105,000	911,400.00	0.29

89	688213	思特威	8,500	910,095.00	0.29
90	601888	中国中免	16,900	907,699.00	0.29
91	002821	凯莱英	5,600	907,200.00	0.29
92	600000	浦发银行	104,300	898,023.00	0.28
93	301358	湖南裕能	11,700	887,679.00	0.28
94	002851	麦格米特	5,300	886,054.00	0.28
95	002466	天齐锂业	14,200	870,744.00	0.27
96	300760	迈瑞医疗	6,400	869,312.00	0.27
97	002460	赣锋锂业	13,000	850,200.00	0.27
98	601658	邮储银行	171,800	846,974.00	0.27
99	301308	江波龙	1,200	844,560.00	0.27
100	300124	汇川技术	12,700	842,391.00	0.27
101	600011	华能国际	109,000	827,310.00	0.26
102	600489	中金黄金	45,100	814,055.00	0.26
103	605499	东鹏饮料	6,530	805,997.90	0.25
104	002156	通富微电	10,600	804,222.00	0.25
105	688390	固德威	7,400	802,974.00	0.25
106	000683	博源化工	138,800	799,488.00	0.25
107	601880	辽港股份	575,600	794,328.00	0.25
108	002558	巨人网络	28,700	790,972.00	0.25
109	600026	中远海能	43,200	775,008.00	0.24
110	600886	国投电力	58,200	774,642.00	0.24
111	600859	王府井	80,000	734,400.00	0.23
112	002475	立讯精密	10,400	732,160.00	0.23
113	603979	金诚信	12,260	723,707.80	0.23
114	300073	当升科技	15,000	720,600.00	0.23
115	002497	雅化集团	35,000	712,950.00	0.22
116	601216	君正集团	159,800	712,708.00	0.22
117	002371	北方华创	800	707,648.00	0.22
118	002648	卫星化学	29,900	702,351.00	0.22
119	000657	中钨高新	7,300	698,756.00	0.22
120	002044	美年健康	137,300	690,619.00	0.22
121	300394	天孚通信	2,280	690,110.40	0.22
122	002422	科伦药业	17,400	670,248.00	0.21
123	600019	宝钢股份	123,200	668,976.00	0.21
124	600989	宝丰能源	32,800	666,824.00	0.21
125	600141	兴发集团	13,600	638,792.00	0.20
126	600418	江淮汽车	24,600	635,418.00	0.20
127	300763	锦浪科技	7,000	632,450.00	0.20
128	601211	国泰海通	34,600	629,720.00	0.20
129	300037	新宙邦	6,700	622,095.00	0.20

130	002128	电投能源	26,800	619,616.00	0.20
131	601127	赛力斯	10,100	618,625.00	0.19
132	601117	中国化学	81,900	601,965.00	0.19
133	300223	北京君正	2,400	597,360.00	0.19
134	601000	唐山港	143,400	595,110.00	0.19
135	000988	华工科技	3,200	590,752.00	0.19
136	002179	中航光电	12,600	582,120.00	0.18
137	601088	中国神华	14,800	577,792.00	0.18
138	600233	圆通速递	36,100	568,575.00	0.18
139	000977	浪潮信息	7,700	539,000.00	0.17
140	000858	五粮液	7,200	532,800.00	0.17
141	603993	洛阳钼业	29,000	508,950.00	0.16
142	600089	特变电工	22,100	497,250.00	0.16
143	300568	星源材质	26,500	496,080.00	0.16
144	688111	金山办公	2,300	490,015.00	0.15
145	600392	盛和资源	16,300	485,251.00	0.15
146	300438	鹏辉能源	5,800	480,530.00	0.15
147	300136	信维通信	4,000	477,000.00	0.15
148	600460	士兰微	8,700	475,542.00	0.15
149	300432	富临精工	22,300	448,007.00	0.14
150	300014	亿纬锂能	6,800	442,204.00	0.14
151	002001	新和成	15,500	440,510.00	0.14
152	300757	罗博特科	700	433,300.00	0.14
153	601677	明泰铝业	26,100	433,260.00	0.14
154	600673	东阳光	12,900	433,182.00	0.14
155	000975	山金国际	24,600	418,200.00	0.13
156	688266	泽璟制药	3,500	408,310.00	0.13
157	600352	浙江龙盛	33,100	400,841.00	0.13
158	601857	中国石油	45,900	398,412.00	0.13
159	601628	中国人寿	11,100	392,385.00	0.12
160	601233	桐昆股份	18,100	391,865.00	0.12
161	688676	金盘科技	4,600	389,344.00	0.12
162	600941	中国移动	4,500	387,585.00	0.12
163	002812	恩捷股份	5,700	381,387.00	0.12
164	688099	晶晨股份	3,700	380,730.00	0.12
165	603659	璞泰来	13,000	376,090.00	0.12
166	002120	韵达股份	58,600	372,696.00	0.12
167	600226	亨通股份	38,700	371,133.00	0.12
168	000034	神州数码	13,300	369,075.00	0.12
169	000831	中国稀土	6,600	366,234.00	0.12
170	002025	航天电器	4,800	365,856.00	0.12

171	600893	航发动力	9,500	364,230.00	0.11
172	603486	科沃斯	7,000	355,250.00	0.11
173	600029	南方航空	67,400	349,132.00	0.11
174	002294	信立泰	10,800	344,412.00	0.11
175	600499	科达制造	24,900	343,620.00	0.11
176	600426	华鲁恒升	14,200	339,664.00	0.11
177	601689	拓普集团	6,000	338,520.00	0.11
178	000519	中兵红箭	16,000	337,120.00	0.11
179	688347	华虹宏力	1,000	336,300.00	0.11
180	601225	陕西煤业	16,500	335,775.00	0.11
181	002544	普天科技	18,100	329,782.00	0.10
182	002891	中宠股份	12,300	328,656.00	0.10
183	002600	领益智造	17,700	306,918.00	0.10
184	600584	长电科技	2,900	300,295.00	0.09
185	688525	佰维存储	600	296,838.00	0.09
186	600570	恒生电子	13,700	290,303.00	0.09
187	002185	华天科技	12,900	287,799.00	0.09
188	300567	精测电子	900	285,840.00	0.09
189	601155	新城控股	27,300	280,098.00	0.09
190	000630	铜陵有色	41,700	265,212.00	0.08
191	002714	牧原股份	7,500	262,425.00	0.08
192	603650	彤程新材	2,600	254,748.00	0.08
193	000423	东阿阿胶	5,500	249,480.00	0.08
194	300418	昆仑万维	6,000	242,160.00	0.08
195	600660	福耀玻璃	4,700	237,068.00	0.07
196	002602	世纪华通	16,300	229,830.00	0.07
197	300972	万辰集团	1,300	225,433.00	0.07
198	300274	阳光电源	1,400	222,628.00	0.07
199	002436	兴森科技	4,200	213,990.00	0.07
200	601288	农业银行	35,100	213,057.00	0.07
201	002202	金风科技	8,800	210,320.00	0.07
202	300604	长川科技	600	204,852.00	0.06
203	600699	均胜电子	9,200	198,812.00	0.06
204	600066	宇通客车	6,800	182,308.00	0.06
205	600008	首创环保	66,800	181,696.00	0.06
206	600039	四川路桥	23,000	179,860.00	0.06
207	000100	TCL 科技	29,800	173,436.00	0.05
208	000932	华菱钢铁	49,800	172,806.00	0.05
209	600346	恒力石化	9,400	166,474.00	0.05
210	688169	石头科技	1,700	161,449.00	0.05
211	600048	保利发展	34,700	160,661.00	0.05

212	002271	东方雨虹	13,400	159,058.00	0.05
213	300001	特锐德	4,100	155,103.00	0.05
214	601168	西部矿业	5,700	154,698.00	0.05
215	300059	东方财富	7,500	152,850.00	0.05
216	600988	赤峰黄金	5,700	150,024.00	0.05
217	603899	晨光股份	7,200	148,536.00	0.05
218	300454	深信服	1,500	144,300.00	0.05
219	002266	浙富控股	27,600	139,656.00	0.04
220	600711	盛屯矿业	12,700	139,319.00	0.04
221	002532	天山铝业	12,900	138,417.00	0.04
222	600754	锦江酒店	7,300	131,327.00	0.04
223	600258	首旅酒店	12,000	131,040.00	0.04
224	300346	南大光电	1,400	129,710.00	0.04
225	688120	华海清科	400	128,872.00	0.04
226	002230	科大讯飞	3,100	126,604.00	0.04
227	002080	中材科技	1,400	126,000.00	0.04
228	688331	荣昌生物	900	117,234.00	0.04
229	002138	顺络电子	1,600	116,960.00	0.04
230	600547	山东黄金	5,000	115,450.00	0.04
231	000069	华侨城 A	69,700	114,308.00	0.04
232	002432	九安医疗	1,600	113,088.00	0.04
233	688578	艾力斯	1,000	109,200.00	0.03
234	603766	隆鑫通用	8,900	106,177.00	0.03
235	000425	徐工机械	12,700	102,743.00	0.03
236	002493	荣盛石化	9,500	102,125.00	0.03
237	300450	先导智能	2,500	101,800.00	0.03
238	002155	湖南黄金	4,100	97,867.00	0.03
239	601607	上海医药	6,300	97,020.00	0.03
240	002223	鱼跃医疗	3,700	94,942.00	0.03
241	002414	高德红外	6,800	90,168.00	0.03
242	002831	裕同科技	2,500	88,900.00	0.03
243	600398	海澜之家	16,700	87,341.00	0.03
244	600655	豫园股份	20,200	83,022.00	0.03
245	002074	国轩高科	3,000	82,530.00	0.03
246	000301	东方盛虹	7,000	80,150.00	0.03
247	300409	道氏技术	4,000	79,720.00	0.03
248	600663	陆家嘴	12,200	76,616.00	0.02
249	688235	百济神州	300	76,383.00	0.02
250	603501	豪威集团	800	75,880.00	0.02
251	600009	上海机场	3,200	73,920.00	0.02
252	600998	九州通	15,300	71,757.00	0.02

253	300896	爱美客	800	69,760.00	0.02
254	601319	中国人保	10,200	68,952.00	0.02
255	300573	兴齐眼药	1,640	66,846.40	0.02
256	302132	中航成飞	1,100	64,152.00	0.02
257	300012	华测检测	4,600	63,756.00	0.02
258	688166	博瑞医药	1,800	63,018.00	0.02
259	300866	安克创新	600	62,700.00	0.02
260	601816	京沪高铁	13,600	61,608.00	0.02
261	300919	中伟新材	1,400	61,250.00	0.02
262	600018	上港集团	12,600	59,472.00	0.02
263	688599	天合光能	4,000	56,480.00	0.02
264	600031	三一重工	3,200	55,296.00	0.02
265	601021	春秋航空	1,200	54,696.00	0.02
266	688617	惠泰医疗	300	54,468.00	0.02
267	688180	君实生物	1,600	54,112.00	0.02
268	600690	海尔智家	2,600	53,066.00	0.02
269	600276	恒瑞医药	1,000	52,040.00	0.02
270	601058	赛轮轮胎	4,500	51,885.00	0.02
271	603087	甘李药业	900	51,084.00	0.02
272	600325	华发股份	20,100	46,431.00	0.01
273	688188	柏楚电子	420	44,814.00	0.01
274	000157	中联重科	5,900	41,123.00	0.01
275	600143	金发科技	2,600	40,170.00	0.01
276	300458	全志科技	1,000	39,460.00	0.01
277	000963	华东医药	1,400	39,368.00	0.01
278	603833	欧派家居	1,300	39,143.00	0.01
279	300251	光线传媒	3,500	38,815.00	0.01
280	300803	指南针	400	36,668.00	0.01
281	301550	斯菱智驱	400	36,572.00	0.01
282	601360	三六零	4,200	36,498.00	0.01
283	300677	英科医疗	900	35,253.00	0.01
284	688469	芯联集成	3,300	35,013.00	0.01
285	300049	福瑞医科	900	34,992.00	0.01
286	002126	银轮股份	700	34,860.00	0.01
287	300115	长盈精密	1,200	33,528.00	0.01
288	605090	九丰能源	900	33,453.00	0.01
289	300100	双林股份	1,200	33,336.00	0.01
290	301078	孩子王	4,900	33,124.00	0.01
291	001965	招商公路	3,600	32,976.00	0.01
292	600635	大众公用	7,700	32,956.00	0.01
293	300342	天银机电	700	32,900.00	0.01

294	000833	粤桂股份	1,400	32,788.00	0.01
295	600816	建元信托	13,200	32,208.00	0.01
296	300433	蓝思科技	600	32,196.00	0.01
297	600064	南京高科	4,500	32,085.00	0.01
298	600221	海航控股	23,600	31,860.00	0.01
299	603596	伯特利	1,252	31,099.68	0.01
300	600177	雅戈尔	3,800	28,614.00	0.01
301	600406	国电南瑞	1,200	27,420.00	0.01
302	601799	星宇股份	300	27,186.00	0.01
303	601668	中国建筑	6,200	26,908.00	0.01
304	300395	菲利华	200	26,746.00	0.01
305	603129	春风动力	100	25,580.00	0.01
306	601728	中国电信	4,900	25,431.00	0.01
307	600028	中国石化	5,700	25,422.00	0.01
308	603799	华友钴业	500	24,130.00	0.01
309	002594	比亚迪	300	23,910.00	0.01
310	688036	传音控股	400	23,580.00	0.01
311	603288	海天味业	700	23,212.00	0.01
312	000733	振华科技	400	22,656.00	0.01
313	600905	三峡能源	6,000	22,260.00	0.01
314	600362	江西铜业	500	21,650.00	0.01
315	603019	中科曙光	200	21,446.00	0.01
316	002236	大华股份	1,300	21,437.00	0.01
317	002595	豪迈科技	450	20,970.00	0.01
318	002555	三七互娱	1,100	20,757.00	0.01
319	300015	爱尔眼科	2,500	20,650.00	0.01
320	600585	海螺水泥	1,200	20,340.00	0.01
321	600741	华域汽车	1,300	20,176.00	0.01
322	601877	正泰电器	800	20,056.00	0.01
323	000830	鲁西化工	1,600	19,200.00	0.01
324	300144	宋城演艺	3,300	19,173.00	0.01
325	300207	欣旺达	1,000	18,990.00	0.01
326	002130	沃尔核材	1,000	18,960.00	0.01
327	600704	物产中大	4,000	18,880.00	0.01
328	300748	金力永磁	600	18,510.00	0.01
329	600332	白云山	900	18,036.00	0.01
330	601018	宁波港	5,700	17,955.00	0.01
331	603816	顾家家居	800	17,888.00	0.01
332	002459	晶澳科技	2,200	17,820.00	0.01
333	002572	索菲亚	2,400	17,520.00	0.01
334	688303	大全能源	1,000	17,430.00	0.01

335	000547	航天发展	900	17,235.00	0.01
336	600219	南山铝业	4,300	17,157.00	0.01
337	600795	国电电力	3,600	16,812.00	0.01
338	688608	恒玄科技	100	16,719.00	0.01
339	600004	白云机场	2,300	16,698.00	0.01
340	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.01
341	600118	中国卫星	200	16,410.00	0.01
342	002410	广联达	2,000	16,320.00	0.01
343	600166	福田汽车	5,600	16,296.00	0.01
344	000887	中鼎股份	900	16,101.00	0.01
345	600312	平高电气	900	15,894.00	0.01
346	600862	中航高科	800	14,424.00	0.00
347	600309	万华化学	200	13,682.00	0.00
348	601390	中国中铁	3,100	12,927.00	0.00
349	688271	联影医疗	100	10,123.00	0.00
350	601727	上海电气	1,300	9,100.00	0.00
351	001979	招商蛇口	700	4,501.00	0.00
352	002050	三花智控	100	4,383.00	0.00
353	600050	中国联通	1,000	4,000.00	0.00
354	002064	华峰化学	400	3,796.00	0.00
355	000623	吉林敖东	200	3,546.00	0.00
356	000617	中油资本	500	3,295.00	0.00
357	000002	万科 A	700	2,072.00	0.00
358	601669	中国电建	400	1,880.00	0.00
359	600864	哈投股份	200	1,038.00	0.00

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	301188	力诺药包	17,500	1,170,750.00	0.37
2	001309	德明利	1,200	1,131,480.00	0.36
3	605358	立昂微	13,300	1,032,080.00	0.32
4	688182	灿勤科技	21,100	908,777.00	0.29
5	605020	永和股份	22,300	908,056.00	0.29
6	688308	欧科亿	4,900	890,869.00	0.28
7	000417	合百集团	98,500	861,875.00	0.27
8	688221	前沿生物	36,900	826,560.00	0.26
9	688710	益诺思	12,200	819,840.00	0.26
10	301389	隆扬电子	8,500	737,715.00	0.23
11	000430	张家界	98,400	718,320.00	0.23

12	688293	奥浦迈	16,900	704,561.00	0.22
13	688275	万润新能	5,400	688,770.00	0.22
14	603031	安孚科技	12,300	654,975.00	0.21
15	000526	学大教育	25,500	647,190.00	0.20
16	603198	迎驾贡酒	20,000	592,000.00	0.19
17	603931	格林达	8,500	504,900.00	0.16
18	688388	嘉元科技	11,200	492,800.00	0.16
19	301086	鸿富瀚	2,300	481,344.00	0.15
20	603936	博敏电子	12,800	341,888.00	0.11
21	301191	菲菱科思	3,000	340,650.00	0.11
22	603186	华正新材	1,500	337,950.00	0.11
23	300623	捷捷微电	7,400	332,926.00	0.10
24	002975	博杰股份	2,300	326,600.00	0.10
25	002850	科达利	1,700	321,810.00	0.10
26	002134	天津普林	10,300	313,326.00	0.10
27	603269	海鸥股份	18,840	310,294.80	0.10
28	603083	剑桥科技	1,200	305,844.00	0.10
29	300548	长芯博创	1,100	305,800.00	0.10
30	301189	奥尼电子	5,160	304,078.80	0.10
31	301246	宏源药业	11,300	303,970.00	0.10
32	603929	亚翔集成	1,100	299,222.00	0.09
33	002885	京泉华	7,200	294,192.00	0.09
34	003023	彩虹集团	15,000	291,600.00	0.09
35	603042	华脉科技	20,070	289,008.00	0.09
36	301176	逸豪新材	4,200	285,600.00	0.09
37	301377	鼎泰高科	500	275,450.00	0.09
38	600903	贵州燃气	41,200	273,568.00	0.09
39	002515	金字火腿	27,200	272,272.00	0.09
40	603045	福达合金	3,700	264,143.00	0.08
41	603124	江南新材	1,400	261,772.00	0.08
42	301511	德福科技	1,800	258,930.00	0.08
43	301280	珠城科技	5,100	257,907.00	0.08
44	001339	智微智能	2,300	235,244.00	0.07
45	000692	惠天热电	56,400	222,216.00	0.07
46	688808	联讯仪器	130	205,962.90	0.06
47	601126	四方股份	3,100	195,920.00	0.06
48	605318	法狮龙	1,700	191,862.00	0.06
49	603738	泰晶科技	2,900	174,145.00	0.05
50	301150	中一科技	2,700	170,397.00	0.05
51	688630	芯碁微装	300	164,817.00	0.05
52	603990	麦迪科技	6,600	140,514.00	0.04

53	301502	华阳智能	2,000	139,040.00	0.04
54	002645	华宏科技	4,800	132,048.00	0.04
55	600872	中炬高新	7,600	131,936.00	0.04
56	301328	维峰电子	1,800	128,160.00	0.04
57	300489	光智科技	400	124,780.00	0.04
58	603099	长白山	3,400	121,278.00	0.04
59	688337	普源精电	1,600	119,888.00	0.04
60	600641	先导基电	2,900	115,594.00	0.04
61	605299	舒华体育	8,000	106,800.00	0.03
62	002484	江海股份	1,000	105,000.00	0.03
63	300975	商络电子	2,000	103,500.00	0.03
64	688479	友车科技	2,700	102,519.00	0.03
65	301072	中捷精工	2,300	94,323.00	0.03
66	603823	百合花	1,700	92,769.00	0.03
67	601939	建设银行	9,400	90,522.00	0.03
68	688301	奕瑞科技	720	89,280.00	0.03
69	300966	共同药业	3,200	88,032.00	0.03
70	300302	同有科技	1,700	86,989.00	0.03
71	688328	深科达	900	86,130.00	0.03
72	600961	株冶集团	2,500	80,975.00	0.03
73	300606	金太阳	1,900	80,864.00	0.03
74	301526	国际复材	1,700	79,339.00	0.02
75	688818	电科蓝天	1,104	77,434.56	0.02
76	688193	仁度生物	1,364	75,429.20	0.02
77	301196	唯科科技	590	73,997.80	0.02
78	688323	瑞华泰	1,300	73,450.00	0.02
79	605018	长华集团	4,900	73,059.00	0.02
80	600827	百联股份	9,400	69,654.00	0.02
81	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.02
82	002297	博云新材	2,200	63,778.00	0.02
83	301682	宏明电子	389	62,263.34	0.02
84	300042	朗科科技	800	60,936.00	0.02
85	688677	海泰新光	600	60,678.00	0.02
86	603719	良品铺子	6,700	57,955.00	0.02
87	603803	瑞斯康达	4,900	57,526.00	0.02
88	000421	南京公用	10,500	52,080.00	0.02
89	688797	臻宝科技	109	51,085.03	0.02
90	688712	北芯生命	1,416	50,862.72	0.02
91	001359	平安电工	400	50,100.00	0.02
92	002552	宝鼎科技	800	48,800.00	0.02
93	301371	敷尔佳	1,700	44,200.00	0.01

94	002803	吉宏股份	1,600	41,344.00	0.01
95	001399	惠科股份	1,460	40,485.80	0.01
96	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
97	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.01
98	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.01
99	301362	民爆光电	200	36,784.00	0.01
100	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
101	601208	东材科技	500	35,395.00	0.01
102	002980	华盛昌	300	34,962.00	0.01
103	603678	火炬电子	400	33,200.00	0.01
104	600367	红星发展	500	31,465.00	0.01
105	605289	罗曼股份	200	29,000.00	0.01
106	000007	全新好	2,300	28,520.00	0.01
107	688635	长进光子	92	28,353.48	0.01
108	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
109	002056	横店东磁	900	27,432.00	0.01
110	688156	路德科技	900	27,225.00	0.01
111	688757	胜科纳米	400	26,680.00	0.01
112	688183	生益电子	200	26,480.00	0.01
113	601881	中国银河	1,900	23,883.00	0.01
114	000776	广发证券	1,000	23,400.00	0.01
115	688615	合合信息	200	22,620.00	0.01
116	600578	京能电力	3,500	22,575.00	0.01
117	688811	有研新材	834	20,124.42	0.01
118	002079	苏州固锝	1,300	19,539.00	0.01
119	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
120	603160	汇顶科技	300	18,513.00	0.01
121	688550	瑞联新材	300	17,355.00	0.01
122	300101	振芯科技	1,000	16,170.00	0.01
123	000800	一汽解放	2,700	16,065.00	0.01
124	600027	华电国际	3,600	16,020.00	0.01
125	300334	津膜科技	1,500	15,630.00	0.00
126	002206	海利得	3,000	15,510.00	0.00
127	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
128	002116	中国海诚	2,200	14,872.00	0.00
129	603111	康尼机电	2,600	14,716.00	0.00
130	301669	高特电子	513	14,569.20	0.00
131	600970	中材国际	2,000	14,260.00	0.00
132	688049	炬芯科技	300	14,073.00	0.00
133	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
134	601311	骆驼股份	1,800	14,022.00	0.00

135	601717	中创智领	1,000	13,910.00	0.00
136	688775	影石创新	100	13,865.00	0.00
137	600583	海油工程	2,700	13,581.00	0.00
138	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
139	688322	奥比中光	100	13,055.00	0.00
140	601808	中海油服	1,200	12,972.00	0.00
141	600968	海油发展	3,700	12,321.00	0.00
142	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
143	300999	金龙鱼	500	11,630.00	0.00
144	600642	申能股份	1,300	11,349.00	0.00
145	601033	永兴股份	800	10,720.00	0.00
146	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
147	001365	天海电子	311	9,737.41	0.00
148	688816	易思维	159	9,078.90	0.00
149	002014	永新股份	800	8,448.00	0.00
150	001393	维通利	214	8,343.86	0.00
151	002763	汇洁股份	1,200	8,148.00	0.00
152	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
153	002061	浙江交科	2,100	6,930.00	0.00
154	000895	双汇发展	300	6,720.00	0.00
155	001237	惠康科技	104	6,108.96	0.00
156	601112	振石股份	306	5,382.54	0.00
157	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
158	002396	星网锐捷	230	4,409.10	0.00
159	601163	三角轮胎	300	3,807.00	0.00
160	300888	稳健医疗	100	2,799.00	0.00
161	600060	海信视像	100	2,787.00	0.00
162	603137	恒尚节能	200	2,588.00	0.00
163	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
164	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
165	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
166	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
167	002486	嘉麟杰	600	1,284.00	0.00
168	601598	中国外运	200	992.00	0.00

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	300308	中际旭创	19,644,175.40	4.59

2	300750	宁德时代	19,173,944.00	4.48
3	688981	中芯国际	12,088,941.15	2.82
4	300502	新易盛	11,803,347.60	2.76
5	600519	贵州茅台	11,555,162.00	2.70
6	601318	中国平安	11,437,318.00	2.67
7	603986	兆易创新	9,955,991.53	2.33
8	603259	药明康德	9,599,465.00	2.24
9	601899	紫金矿业	9,560,755.00	2.23
10	600150	中国船舶	8,682,169.88	2.03
11	688008	澜起科技	8,596,035.12	2.01
12	600030	中信证券	8,316,200.00	1.94
13	601328	交通银行	7,837,508.00	1.83
14	601988	中国银行	7,627,288.00	1.78
15	600487	亨通光电	6,851,054.00	1.60
16	600036	招商银行	6,703,149.00	1.57
17	688256	寒武纪	6,699,397.00	1.56
18	300408	三环集团	6,482,748.56	1.51
19	300394	天孚通信	6,439,764.00	1.50
20	000792	盐湖股份	6,142,449.00	1.43

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	27,276,573.00	6.37
2	300308	中际旭创	23,097,758.00	5.40
3	600519	贵州茅台	20,459,814.00	4.78
4	601318	中国平安	18,032,640.00	4.21
5	601899	紫金矿业	16,802,099.00	3.92
6	000333	美的集团	11,332,208.00	2.65
7	688981	中芯国际	11,228,306.84	2.62
8	600036	招商银行	10,911,113.00	2.55
9	601328	交通银行	10,263,207.00	2.40
10	300394	天孚通信	10,186,113.20	2.38
11	300274	阳光电源	10,183,205.11	2.38
12	603259	药明康德	9,955,054.11	2.33
13	603986	兆易创新	8,916,066.00	2.08
14	002475	立讯精密	8,404,987.00	1.96
15	601988	中国银行	8,186,754.00	1.91
16	600183	生益科技	8,174,678.00	1.91
17	688256	寒武纪	8,046,620.78	1.88
18	601319	中国人保	7,891,443.00	1.84

19	300502	新易盛	7,832,535.00	1.83
20	002916	深南电路	7,737,596.00	1.81

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	1,288,070,382.61
卖出股票收入（成交）总额	1,448,608,171.38

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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）	8,629.93	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,629.93	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113701	祥和转债	30	5,916.08	0.00
2	127113	长高转债	10	1,713.80	0.00
3	113704	春风转债	10	1,000.05	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资决策程序符合法律法规及公司投资制度有关规定，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

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	361,391.05
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,639,347.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,000,738.32

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末持有的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

本基金本报告期末持有的积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中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

份额级别	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
华泰保兴中证 A500 指数增强 A	719	73,972.89	41,902,988.87	78.79%	11,283,516.00	21.21%
华泰保兴中证 A500 指数增强 C	1,649	112,422.79	—	—	185,385,176.13	100.00%
合计	2,321	102,788.32	41,902,988.87	17.56%	196,668,692.13	82.44%

注：1、机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华泰保兴中证 A500 指数增 强 A	1,480,988.33	2.78%
	华泰保兴中证 A500 指数增 强 C	13,679.81	0.01%
	合计	1,494,668.14	0.63%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万 份）
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责 人持有本开放式基金	华泰保兴中证 A500 指数增强 A	>100
	华泰保兴中证 A500 指数增强 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本 开放式基金	华泰保兴中证 A500 指数增强 A	0~10
	华泰保兴中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴中证 A500 指数增强 A	华泰保兴中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 05 月 30 日） 基金份额总额	37,720,066.85	280,189,642.99
本报告期期初基金份额总额	34,178,349.76	333,736,665.10
本报告期基金总申购份额	55,737,053.56	536,461,684.69
减：本报告期基金总赎回份额	36,728,898.45	684,813,173.66
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	53,186,504.87	185,385,176.13

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 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，本基金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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本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

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	3	2,735,277,973.65	100.00%	535,315.55	100.00%	本报告期新增
国元证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择专用交易单元所属券商的标准如下：

- （1）财务状况良好，经营行为规范；
- （2）合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- （3）内部管理规范、严谨，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

2、基金管理人选择专用交易单元所属券商的程序如下：

基金管理人按照上述选择标准，对交易单元所属券商进行综合评估，并按照规定与符合规定条件的券商签署交易单元租用协议。

3、本基金的股票交易佣金费率标准按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）的规定执行。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期内，本基金未有通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年01月22日
2	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告的提示性公告	管理人网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2026年03月31日
3	华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年03月31日
4	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026年04月07日
5	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2026年04月17日
6	华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年04月22日
7	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季	管理人网站、《中国证券报》	2026年04月22日

	度报告的提示性公告	《上海证券报》《证券时报》 《证券日报》	
8	华泰保兴基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露（2025 年度）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026年04月30日
9	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》 《上海证券报》《证券时报》 《证券日报》	2026年05月22日
10	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加汇添富基金销售（上海）有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》 《上海证券报》《证券时报》 《证券日报》	2026年06月18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

本报告期内无单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件
- 2、《华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

12.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站 www.ehuataifund.com 查阅
- 3、拨打基金管理人客服热线电话 400-632-9090（免长途话费）查询

华泰保兴基金管理有限公司

2026 年 08 月 29 日