华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026年8月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 46
7.1 期末基金资产组合情况 46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 58
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 58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 58

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 58
7.12 投资组合报告附注 58

§8 基金份额持有人信息 59

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60
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 60

§9 开放式基金份额变动 60

§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 61
10.4 基金投资策略的改变 61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 61
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 62
10.8 其他重大事件 65

§11 影响投资者决策的其他重要信息 67

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 67

§12 备查文件目录 67

12.1 备查文件目录 67
12.2 存放地点 67
12.3 查阅方式 67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF
场内简称	300ETF(扩位证券简称：沪深 300ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,914,887,690.00 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	2012 年 5 月 28 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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	康珂	郭明
	联系电话	021-38601777	（010）66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	（010）66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	贾波	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	80,327,105,156.45
本期利润	19,043,417,085.43
加权平均基金份额本期利润	0.4227
本期加权平均净值利润率	8.88%
本期基金份额净值增长率	8.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	43,881,674,437.72
期末可供分配基金份额利润	2.3200
期末基金资产净值	94,872,183,996.40
期末基金份额净值	5.0157
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	135.68%

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。

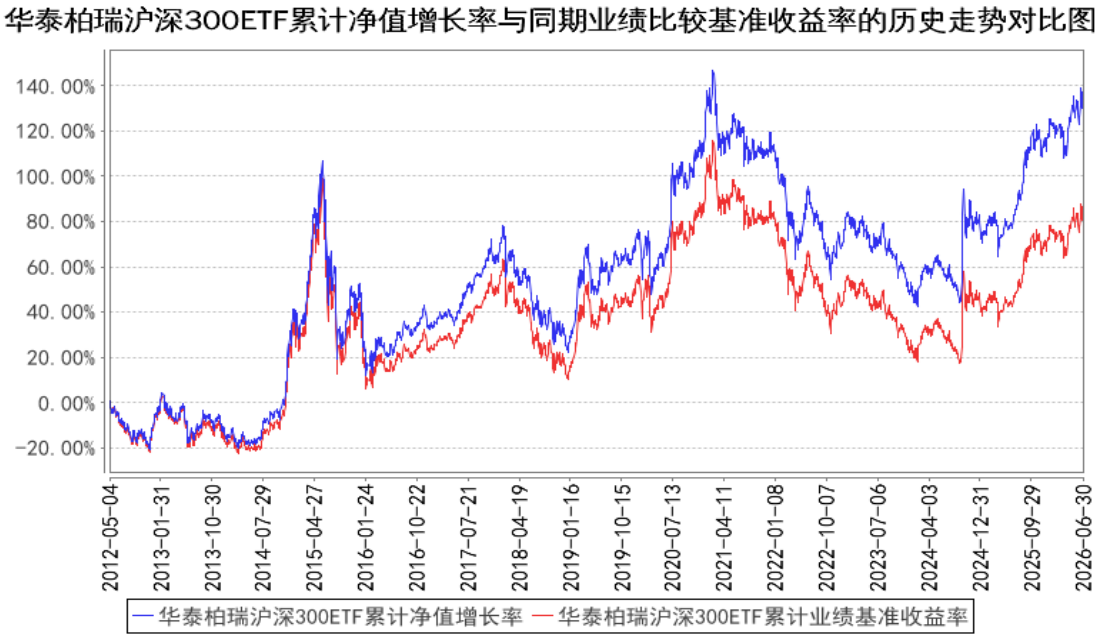
3、本基金于 2012 年 5 月 11 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值＋基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买沪深 300ETF 后的实际份额净值变动情况。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.47%	1.24%	11.90%	1.26%	0.57%	-0.02%
过去六个月	8.25%	1.12%	7.55%	1.13%	0.70%	-0.01%
过去一年	29.15%	1.02%	26.51%	1.02%	2.64%	0.00%
过去三年	38.51%	1.11%	29.59%	1.11%	8.92%	0.00%
过去五年	5.31%	1.11%	-4.68%	1.12%	9.99%	-0.01%
过去七年	48.06%	1.16%	30.16%	1.17%	17.90%	-0.01%
过去十年	88.11%	1.14%	57.88%	1.15%	30.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	135.68%	1.33%	85.00%	1.34%	50.68%	-0.01%

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



注：图示日期为 2012 年 5 月 4 日至 2026 年 6 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

为华泰证券股份有限公司、Heron View Partners LLC 和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 201 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	2026 年 2 月 25 日	7 年	理学硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
柳军	副总经理、本基金的基金经理	2012 年 5 月 4 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，兼任华泰盈科资产管理有限公司证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）。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。2025 年 7 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发起式联接基金的基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成

交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 11 次，是指数或量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，A 股整体维持震荡上行格局，但市场内部风格分化明显，沪深 300 收于 4979 点，上半年上涨 8.63%，场内日均成交稳定维持 3 万亿元上方，整体资金活跃度充裕。本轮行情由 AI 产业红利主导，资金单向扎堆高景气成长赛道，其中电子、通信板块二季度涨幅分别高达 86.29%、73.59%。

复盘宏观基本面，一季度国内 GDP 同比 5%开局平稳，二季度受国际油价上行扰动，内需修复动能边际放缓，经济呈现典型外需偏强、内需偏弱的特征，5 月社零同比转负，但出口韧性超预期，前五月出口同比增长 15.3%；同时 PPI 时隔数年同比转正，成长板块盈利预期提前升温，景气优势在中报落地前或已被市场充分定价。

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 5.0157 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.25%，业绩比较基准收益率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，我们认为 A 股仍然以结构性行情为主，当下需要重点警惕两大风险：一是外部流动性扰动，美元韧性走强叠加海外央行加息，全球流动性边际收紧，叠加海外科技股高位回撤、新兴市场外资大幅流出，较易压制 A 股风险偏好；二是内部赛道拥挤风险，AI 产业链经过二季度行情演绎，后续业绩兑现压力陡增。估值维度来看，当前沪深 300PE-TTM 为 13.9 倍、PB1.29 倍，处于历史偏低分位，大盘蓝筹具备一定估值优势；反观成长赛道，创业板市盈率达 52.99 倍，科技主线交易拥挤度逼近历史警戒线，局部估值泡沫凸显，继续上行容错率或大幅收窄。

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，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率

达到 1%以上，方可进行收益分配。本报告期内，本基金符合分红条件：于 2026 年 1 月 12 日宣告 2026 年度第 1 次分红，向截至 2026 年 1 月 16 日止在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.2300 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,118,519,422.60	2,348,803,004.06
结算备付金		2,720,129,142.40	2,924,699,640.38
存出保证金		456,568,963.31	605,969,963.90

交易性金融资产	6.4.7.2	91,003,211,192.29	416,562,848,300.30
其中：股票投资		91,003,211,192.29	416,562,848,300.30
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		385,085,617.65	19,716,219.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		95,683,574,830.88	422,462,037,128.46
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		17,946,995.34	426,835.21
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		199,247,160.20	19,478,340.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,910,458.00	53,801,772.50
应付托管费		5,303,486.02	17,933,924.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,688,001.12	8,154,765.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	564,294,733.80	104,509,129.15
负债合计		811,390,834.48	204,304,766.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	50,990,509,558.68	239,465,653,446.48
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	43,881,674,437.72	182,792,078,915.09
净资产合计		94,872,183,996.40	422,257,732,361.57

负债和净资产总计		95,683,574,830.88	422,462,037,128.46

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 5.0157 元，基金份额总额 18,914,887,690.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		19,259,022,784.07	8,482,818,086.80
1.利息收入		22,250,568.67	18,740,713.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	22,250,568.67	18,740,713.56
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）		80,346,139,075.09	10,865,164,489.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	78,250,851,253.07	6,032,445,119.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	7,673,934.79
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	416,677,024.73	-68,720,524.57
股利收益	6.4.7.19	1,678,610,797.29	4,893,765,960.40
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	-61,283,688,071.02	-2,419,761,494.94
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	174,321,211.33	18,674,378.22
减：二、营业总支出		215,605,698.64	382,565,067.21
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	160,446,723.58	269,393,767.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	53,482,241.18	89,797,922.49
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		1,503,155.65	234,637.59
8．其他费用	6.4.7.23	173,578.23	23,138,739.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,043,417,085.43	8,100,253,019.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,043,417,085.43	8,100,253,019.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,043,417,085.43	8,100,253,019.59

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	239,465,653,446.48	-	182,792,078,915.09	422,257,732,361.57
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	239,465,653,446.48	-	182,792,078,915.09	422,257,732,361.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-188,475,143,887.80	-	-138,910,404,477.37	-327,385,548,365.17
（一）、综合收益总额	-	-	19,043,417,085.43	19,043,417,085.43
（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）	-188,475,143,887.80	-	-148,143,306,176.80	-336,618,450,064.60
其中：1.基金申购款	32,656,764,501.03	-	24,931,653,936.60	57,588,418,437.63
2.基金赎回款	-221,131,908,388.83	-	-173,074,960,113.40	-394,206,868,502.23
（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）	-	-	-9,810,515,386.00	-9,810,515,386.00
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,990,509,558.68	-	43,881,674,437.72	94,872,183,996.40
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	240,967,476,445.23	-	118,659,647,097.77	359,627,123,543.00

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	240,967,476,445.23	-	118,659,647,097.77	359,627,123,543.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	12,550,775,812.87	-	2,526,076,879.52	15,076,852,692.39
（一）、综合收益总额	-	-	8,100,253,019.59	8,100,253,019.59
（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）	12,550,775,812.87	-	2,819,324,376.88	15,370,100,189.75
其中：1.基金申购款	67,560,197,920.22	-	28,855,678,616.76	96,415,876,536.98
2.基金赎回款	-55,009,422,107.35	-	-26,036,354,239.88	-81,045,776,347.23
（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）	-	-	-8,393,500,516.95	-8,393,500,516.95
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	253,518,252,258.10	-	121,185,723,977.29	374,703,976,235.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

崔春　　房伟力　　赵景云

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 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[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 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 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,297,269.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933，并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2012]14 号文审核同意，本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 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《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数沪深 300 指数成份股、备选成份股为主要投资对象；此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证、债券、权证、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。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”)。华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资

产投资于本基金。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,118,519,422.60
等于：本金	1,118,385,885.19
加：应计利息	133,537.41
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	1,118,519,422.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		75,640,307,454.45	-	91,003,211,192.29	15,362,903,737.84
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		75,640,307,454.45	-	91,003,211,192.29	15,362,903,737.84

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 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,442,648,051.43	-	-	-
其中：股指期货投资	3,442,648,051.43	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,442,648,051.43	-	-	-

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
IF2609	沪深 300 股指期货 2609	2,400.00	3,491,856,000.00	49,207,948.57
合计				49,207,948.57
减：可抵销期货暂收款				49,207,948.57
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。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

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

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,593,639.74
其中：交易所市场	10,593,639.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
其他应付款	500,000.00

应退退补款	553,091,998.12
合计	564,294,733.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,829,587,690.00	239,465,653,446.48
本期申购	12,114,000,000.00	32,656,764,501.03
本期赎回（以“-”号填列）	-82,028,700,000.00	-221,131,908,388.83
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	18,914,887,690.00	50,990,509,558.68

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	308,085,510,116.89	- 125,293,431,201.80	182,792,078,915.09
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	308,085,510,116.89	- 125,293,431,201.80	182,792,078,915.09
本期利润	80,327,105,156.45	-61,283,688,071.02	19,043,417,085.43
本期基金份额交易产生的变动数	-281,234,921,914.03	133,091,615,737.23	- 148,143,306,176.80
其中：基金申购款	51,570,846,155.69	-26,639,192,219.09	24,931,653,936.60
基金赎回款	-332,805,768,069.72	159,730,807,956.32	- 173,074,960,113.40
本期已分配利润	-9,810,515,386.00	-	-9,810,515,386.00
本期末	97,367,177,973.31	-53,485,503,535.59	43,881,674,437.72

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,842,829.41
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	19,353,258.77
其他	54,480.49
合计	22,250,568.67

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	45,160,152,350.12
股票投资收益——赎回差价收入	33,090,698,902.95
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	78,250,851,253.07

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	188,756,739,428.86
减：卖出股票成本总额	143,463,186,647.63
减：交易费用	133,400,431.11
买卖股票差价收入	45,160,152,350.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	394,206,868,502.23
减：现金支付赎回款总额	158,246,209,549.23
减：赎回股票成本总额	202,869,960,050.05
减：交易费用	-
赎回差价收入	33,090,698,902.95

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	416,677,024.73

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,678,610,797.29
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	1,678,610,797.29

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-61,237,765,995.25
股票投资	-61,237,765,995.25
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	-45,794,731.43
权证投资	-
期货投资	-45,794,731.43
3.其他	-127,344.34
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-61,283,688,071.02

注：其他为可退替代的公允价值变动。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-

替代损益	174,321,211.33
合计	174,321,211.33

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	59,507.37
银行划款手续费	4,974.92
合计	173,578.23

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
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（“华泰柏瑞沪深	本基金的基金管理人管理的其他基金

300ETF 联接基金”）	

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	58,913,296,608.08	24.78	11,080,204,100.67	12.48

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	5,891,655.90	24.78	1,732,163.34	16.35
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	1,108,146.41	12.48	366,706.90	6.17

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

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服

务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	160,446,723.58	269,393,767.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	160,446,723.58	269,393,767.54

注：

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	53,482,241.18	89,797,922.49

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
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	1,022,082,168.00	5.4036	665,052,468.00	0.7487
华泰证券股份有限公司	22,903,814.00	0.1211	21,756,727.00	0.0245

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,118,519,422.60	2,842,829.41	1,331,168,714.16	4,693,432.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/	总金额

				张 ）	
华泰联合证券	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张 ）	总金额
华泰联合证券	301458	钧崴电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合证券	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 01 月 16 日	2026 年 01 月 19 日	-	1.2300	9,810,515,386.00	-	9,810,515,386.00	-
合计	-	-	-	1.2300	9,810,515,386.00	-	9,810,515,386.00	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股锁定期内	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股锁定期内	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股锁定期内	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股锁定期内	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股锁定期内	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股锁定期内	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股	2026年6月	6个月	新股锁	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

	份	16日		定期内						
300803	指南针	2026年4月24日	6个月	询价转让流通受限	85.11	85.76	500,000	42,555,000.00	42,880,000.00	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股锁定期内	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股锁定期内	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股锁定期内	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股锁定期内	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股锁定期内	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电	2026年2月	6个月	新股锁	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-

	材	27日		定期内						
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定期内	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定期内	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定期内	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定期内	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定期内	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股锁定期内	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股锁定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

				内						
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股锁定期内	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股锁定期内	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股锁定期内	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688008	澜起科技	2026年5月29日	6个月	询价转让流通受限	250.08	276.82	200,000	50,016,000.00	55,364,000.00	-
688047	龙芯中科	2026年6月16日	6个月	询价转让流通受限	120.00	139.86	80,000	9,600,000.00	11,188,800.00	-
688072	拓荆科技	2026年6月23日	6个月	定向增发流通受限	576.01	745.27	120,832	69,600,440.32	90,052,464.64	-
68863	长	202	6个月	新	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

5	进光子	6年5月20日		股锁定期内						
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股锁定期内	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月以上	新股锁定期内	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	6个月以上	新股锁定期内	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定期内	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	6个月以上	新股锁定期内	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月以上	新股锁定期内	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688797	臻宝科	2026年6月	6个月	新股锁	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

	技	16日		定期内						
688802	沐曦股份	2025年12月9日	6个月以上	新股锁定期内	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股锁定期内	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股锁定期内	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股锁定期内	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股锁定期内	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股锁定期内	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股锁定期	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

				内						

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股，按发行人及主承销商公告的限售档位执行，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份或创业板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	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
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项停牌	832.00	2026年7月13日	890.99	597,223	392,349,553.47	496,889,536.00	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具

相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资(2025 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 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。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,118,519,422.60	-	-	-	-	-	1,118,519,422.60
结算备付金	2,720,129,142.40	-	-	-	-	-	2,720,129,142.40
存出保证金	37,546,243.31	-	-	-	-	419,022,720.00	456,568,963.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	91,003,211,192.29	91,003,211,192.29
应收清算款	-	-	-	-	-	385,085,617.65	385,085,617.65
其他资产	-	-	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	3,876,194,808.31	-	-	-	-	91,807,380,022.57	95,683,574,830.88
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	17,946,995.34	17,946,995.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,910,458.00	15,910,458.00
应付托管费	-	-	-	-	-	5,303,486.02	5,303,486.02
应付清算款	-	-	-	-	-	199,247,160.20	199,247,160.20
应交税费	-	-	-	-	-	8,688,001.12	8,688,001.12
其他负债	-	-	-	-	-	564,294,733.80	564,294,733.80
负债总计	-	-	-	-	-	811,390,834.48	811,390,834.48
利率敏感度缺	3,876,194,80	-	-	-	-	90,995,989	94,872,183,9

口	8.31					,188.09	96.40
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,348,803,004.06	-	-	-	-	-	2,348,803,004.06
结算备付金	2,924,699,640.38	-	-	-	-	-	2,924,699,640.38
存出保证金	10,691,243.90	-	-	-	-	595,278,720.00	605,969,963.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	416,562,848,300.30	416,562,848,300.30
应收清算款	-	-	-	-	-	19,716,219.82	19,716,219.82
资产总计	5,284,193,888.34	-	-	-	-	417,177,843,240.12	422,462,037,128.46
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	426,835.21	426,835.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,801,772.50	53,801,772.50
应付托管费	-	-	-	-	-	17,933,924.18	17,933,924.18
应付清算款	-	-	-	-	-	19,478,340.84	19,478,340.84
应交税费	-	-	-	-	-	8,154,765.01	8,154,765.01
其他负债	-	-	-	-	-	104,509,129.15	104,509,129.15
负债总计	-	-	-	-	-	204,304,766.89	204,304,766.89
利率敏感度缺口	5,284,193,888.34	-	-	-	-	416,973,538,473.23	422,257,732,361.57

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	91,003,211,192.29	95.92	416,562,848,300.30	98.65
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	-17,946,995.34	-0.02	-426,835.21	-0.00
合计	90,985,264,196.95	95.90	416,562,421,465.09	98.65

注：其他为可退替代款。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

	业绩比较基准上升5%	4,694,785,203.22	21,090,406,910.96
	业绩比较基准下降5%	-4,694,785,203.22	-21,090,406,910.96

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	90,290,328,371.69	413,672,518,335.63
第二层次	497,739,827.44	2,882,114,035.92
第三层次	215,142,993.16	8,215,928.75
合计	91,003,211,192.29	416,562,848,300.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）基金申购款

于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 57,588,418,437.63 元（2025 年度：168,842,895,418.30 元），其中包括以股票支付的申购款 32,858,511,948.83 元和以现金支付的申购款 24,729,906,488.80 元（2025 年度：其中包括以股票支付的申购款 103,381,590,372.48 元和以现金支付的申购款 65,461,305,045.82 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	91,003,211,192.29	95.11
	其中：股票	91,003,211,192.29	95.11
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	3,838,648,565.00	4.01
8	其他各项资产	841,715,073.59	0.88
9	合计	95,683,574,830.88	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	523,214,531.91	0.55
B	采矿业	3,821,369,426.03	4.03

C	制造业	58,262,262,781.12	61.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,263,752,324.53	2.39
E	建筑业	1,038,963,711.42	1.10
F	批发和零售业	136,797,789.40	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	2,204,253,587.99	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,880,263,404.22	5.14
J	金融业	15,973,077,417.40	16.84
K	房地产业	297,667,928.33	0.31
L	租赁和商务服务业	414,094,832.74	0.44
M	科学研究和技术服务业	991,857,990.41	1.05
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	125,059,299.26	0.13
R	文化、体育和娱乐业	52,922,455.92	0.06
S	综合	-	-
	合计	90,985,557,480.68	95.90

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	16,765,686.89	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	17,653,711.61	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	3,546,472	4,504,019,440.00	4.75
2	300750	宁德时代	8,559,997	3,364,164,420.97	3.55
3	300502	新易盛	4,524,708	2,746,497,756.00	2.89
4	600519	贵州茅台	2,014,854	2,388,589,268.46	2.52
5	603986	兆易创新	2,168,627	1,767,431,005.00	1.86
6	688256	寒武纪	1,070,613	1,708,216,572.15	1.80
7	601318	中国平安	34,349,979	1,639,867,997.46	1.73
8	600036	招商银行	39,842,279	1,414,400,904.50	1.49
9	601899	紫金矿业	53,177,716	1,336,887,780.24	1.41
10	000333	美的集团	15,641,377	1,181,393,204.81	1.25
11	002475	立讯精密	16,473,715	1,159,749,536.00	1.22
12	002371	北方华创	1,270,324	1,123,677,797.44	1.18
13	688008	澜起科技	3,645,315	1,123,067,118.50	1.18
14	002384	东山精密	4,142,858	1,086,878,796.30	1.15

15	688041	海光信息	2,855,885	1,057,534,215.50	1.11
16	688012	中微公司	2,235,967	1,047,550,539.50	1.10
17	600900	长江电力	39,368,050	1,042,072,283.50	1.10
18	688981	中芯国际	6,493,978	1,031,373,585.96	1.09
19	000725	京东方 A	117,190,247	1,017,211,343.96	1.07
20	603259	药明康德	7,966,091	991,857,990.41	1.05
21	601138	工业富联	12,840,606	926,449,722.90	0.98
22	601166	兴业银行	54,519,813	902,848,103.28	0.95
23	600030	中信证券	31,343,976	900,512,430.48	0.95
24	300059	东方财富	40,867,944	832,888,698.72	0.88
25	600183	生益科技	4,738,400	821,638,560.00	0.87
26	300274	阳光电源	4,719,037	750,421,263.74	0.79
27	600276	恒瑞医药	14,416,771	750,248,762.84	0.79
28	601398	工商银行	104,127,310	736,180,081.70	0.78
29	300408	三环集团	4,345,298	725,230,236.20	0.76
30	002594	比亚迪	8,805,379	701,788,706.30	0.74
31	300476	胜宏科技	1,964,471	680,551,688.53	0.72
32	002463	沪电股份	4,364,091	666,833,104.80	0.70
33	601211	国泰海通	36,408,066	662,626,801.20	0.70
34	300394	天孚通信	2,117,338	640,875,865.84	0.68
35	301308	江波龙	904,380	636,502,644.00	0.67
36	688072	拓荆科技	718,055	586,942,000.64	0.62
37	000988	华工科技	3,135,172	578,784,102.92	0.61
38	600176	中国巨石	7,711,051	561,981,396.88	0.59
39	601288	农业银行	92,531,444	561,665,865.08	0.59
40	601328	交通银行	85,754,254	551,399,853.22	0.58
41	000651	格力电器	14,477,119	542,891,962.50	0.57
42	600522	中天科技	8,847,089	536,841,360.52	0.57
43	600919	江苏银行	47,338,829	510,312,576.62	0.54
44	603019	中科曙光	4,757,058	510,099,329.34	0.54
45	603993	洛阳钼业	28,122,542	493,550,612.10	0.52
46	600150	中国船舶	14,590,390	493,009,278.10	0.52
47	600887	伊利股份	20,393,245	488,622,150.20	0.52
48	600584	长电科技	4,650,958	481,606,700.90	0.51
49	000338	潍柴动力	17,242,716	469,864,011.00	0.50
50	000858	五 粮 液	6,273,908	464,269,192.00	0.49
51	601816	京沪高铁	94,285,660	427,114,039.80	0.45
52	002916	深南电路	928,612	425,211,434.80	0.45
53	600309	万华化学	6,058,035	414,430,174.35	0.44
54	300124	汇川技术	6,114,385	405,567,157.05	0.43
55	002415	海康威视	11,791,156	403,257,535.20	0.43
56	600111	北方稀土	8,152,870	391,745,403.50	0.41
57	601688	华泰证券	18,918,210	390,093,490.20	0.41

58	000100	TCL 科技	66,704,726	388,221,505.32	0.41
59	000063	中兴通讯	10,414,610	376,904,735.90	0.40
60	600000	浦发银行	42,905,776	369,418,731.36	0.39
61	600089	特变电工	16,315,199	367,091,977.50	0.39
62	601857	中国石油	41,665,403	361,655,698.04	0.38
63	688521	芯原股份	966,094	358,556,127.16	0.38
64	601088	中国神华	8,945,910	349,248,326.40	0.37
65	002028	思源电气	2,008,161	347,411,853.00	0.37
66	300433	蓝思科技	6,444,714	345,823,353.24	0.36
67	600031	三一重工	19,206,180	331,882,790.40	0.35
68	300014	亿纬锂能	4,957,910	322,412,887.30	0.34
69	002142	宁波银行	10,712,878	318,065,347.82	0.34
70	601601	中国太保	11,138,275	317,663,603.00	0.33
71	000001	平安银行	31,413,733	315,708,016.65	0.33
72	002050	三花智控	7,123,166	312,208,365.78	0.33
73	002714	牧原股份	8,891,813	311,124,536.87	0.33
74	000792	盐湖股份	10,251,974	309,507,095.06	0.33
75	600549	厦门钨业	3,546,667	302,176,028.40	0.32
76	002353	杰瑞股份	1,976,115	301,357,537.50	0.32
77	600406	国电南瑞	13,039,566	297,954,083.10	0.31
78	601668	中国建筑	66,464,319	288,455,144.46	0.30
79	000657	中钨高新	2,992,703	286,461,531.16	0.30
80	601229	上海银行	32,034,903	278,062,958.04	0.29
81	002602	世纪华通	19,074,298	268,947,601.80	0.28
82	601919	中远海控	20,217,335	268,081,862.10	0.28
83	300760	迈瑞医疗	1,950,549	264,943,070.67	0.28
84	601988	中国银行	46,068,765	263,513,335.80	0.28
85	603501	豪威集团	2,774,758	263,185,796.30	0.28
86	601939	建设银行	27,222,847	262,156,016.61	0.28
87	601728	中国电信	49,916,697	259,067,657.43	0.27
88	600941	中国移动	3,004,133	258,745,975.29	0.27
89	600016	民生银行	79,838,981	257,081,518.82	0.27
90	600660	福耀玻璃	5,077,533	256,110,764.52	0.27
91	601225	陕西煤业	12,551,132	255,415,536.20	0.27
92	601012	隆基绿能	19,455,435	255,255,307.20	0.27
93	002230	科大讯飞	6,208,832	253,568,698.88	0.27
94	600999	招商证券	11,952,587	252,199,585.70	0.27
95	300033	同花顺	1,026,292	247,336,372.00	0.26
96	600690	海尔智家	12,089,628	246,749,307.48	0.26
97	002352	顺丰控股	7,712,922	241,105,941.72	0.25
98	601985	中国核电	26,483,915	239,149,752.45	0.25
99	603799	华友钴业	4,943,537	238,575,095.62	0.25
100	002709	天赐材料	4,636,468	238,453,549.24	0.25

101	002938	鹏鼎控股	2,256,207	237,759,093.66	0.25
102	600926	杭州银行	16,375,227	236,622,030.15	0.25
103	002460	赣锋锂业	3,597,742	235,292,326.80	0.25
104	601169	北京银行	47,524,272	232,868,932.80	0.25
105	600160	巨化股份	4,372,602	231,791,632.02	0.24
106	000977	浪潮信息	3,208,889	224,622,230.00	0.24
107	300442	润泽科技	2,683,517	222,919,757.19	0.23
108	688082	盛美上海	513,892	222,001,344.00	0.23
109	000776	广发证券	9,478,743	221,802,586.20	0.23
110	000425	徐工机械	26,453,918	214,012,196.62	0.23
111	002202	金风科技	8,949,316	213,888,652.40	0.23
112	300498	温氏股份	17,215,097	212,089,995.04	0.22
113	600028	中国石化	47,012,734	209,676,793.64	0.22
114	601600	中国铝业	25,492,786	209,550,700.92	0.22
115	600938	中国海油	7,690,621	208,800,360.15	0.22
116	688126	沪硅产业	5,231,510	208,684,933.90	0.22
117	000938	紫光股份	7,230,738	208,679,098.68	0.22
118	601766	中国中车	39,227,954	203,985,360.80	0.22
119	002600	领益智造	11,690,856	202,719,443.04	0.21
120	600460	士兰微	3,699,607	202,220,518.62	0.21
121	600050	中国联通	50,355,024	201,420,096.00	0.21
122	002466	天齐锂业	3,239,267	198,631,852.44	0.21
123	002837	英维克	2,492,466	198,300,594.96	0.21
124	601009	南京银行	19,892,972	196,741,493.08	0.21
125	002049	紫光国微	2,203,000	195,516,250.00	0.21
126	300661	圣邦股份	1,330,056	190,836,434.88	0.20
127	002179	中航光电	4,098,619	189,356,197.80	0.20
128	601628	中国人寿	5,321,017	188,097,950.95	0.20
129	000568	泸州老窖	2,394,939	185,655,671.28	0.20
130	601100	恒立液压	1,710,199	183,949,004.44	0.19
131	601872	招商轮船	10,449,141	183,591,407.37	0.19
132	002241	歌尔股份	8,009,493	180,453,877.29	0.19
133	000408	藏格矿业	2,585,000	179,192,200.00	0.19
134	601006	大秦铁路	38,327,923	176,691,725.03	0.19
135	603288	海天味业	5,325,026	176,577,862.16	0.19
136	601658	邮储银行	35,426,509	174,652,689.37	0.18
137	601818	光大银行	59,578,261	172,181,174.29	0.18
138	600905	三峡能源	45,935,078	170,419,139.38	0.18
139	688111	金山办公	799,337	170,298,747.85	0.18
140	605117	德业股份	1,589,848	168,810,060.64	0.18
141	600809	山西汾酒	1,541,601	168,604,901.37	0.18
142	600489	中金黄金	9,324,403	168,305,474.15	0.18
143	002625	光启技术	5,502,470	166,834,890.40	0.18

144	601888	中国中免	3,088,542	165,885,590.82	0.17
145	600893	航发动力	4,314,713	165,426,096.42	0.17
146	000630	铜陵有色	25,932,900	164,933,244.00	0.17
147	601336	新华保险	2,761,657	164,760,456.62	0.17
148	601127	赛力斯	2,668,878	163,468,777.50	0.17
149	600010	包钢股份	72,917,994	162,607,126.62	0.17
150	601689	拓普集团	2,847,221	160,640,208.82	0.17
151	600958	东方证券	16,880,105	159,348,191.20	0.17
152	002027	分众传媒	32,637,074	157,963,438.16	0.17
153	600118	中国卫星	1,890,226	155,093,043.30	0.16
154	600019	宝钢股份	28,055,515	152,341,446.45	0.16
155	000807	云铝股份	6,783,604	150,188,992.56	0.16
156	688183	生益电子	1,133,942	150,133,920.80	0.16
157	600760	中航沈飞	3,610,520	148,392,372.00	0.16
158	600104	上汽集团	14,888,881	145,315,478.56	0.15
159	601838	成都银行	8,203,387	145,199,949.90	0.15
160	002001	新 和 成	5,055,073	143,665,174.66	0.15
161	600875	东方电气	4,990,769	143,584,424.13	0.15
162	688271	联影医疗	1,414,282	143,167,766.86	0.15
163	600989	宝丰能源	7,027,565	142,870,396.45	0.15
164	600362	江西铜业	3,295,825	142,709,222.50	0.15
165	601727	上海电气	20,322,050	142,254,350.00	0.15
166	300450	先导智能	3,479,519	141,686,013.68	0.15
167	000538	云南白药	2,968,442	140,615,097.54	0.15
168	601825	沪农商行	18,699,462	140,058,970.38	0.15
169	601390	中国中铁	33,061,080	137,864,703.60	0.15
170	002422	科伦药业	3,559,038	137,094,143.76	0.14
171	601995	中金公司	3,742,968	135,308,293.20	0.14
172	603893	瑞芯微	717,415	135,132,289.40	0.14
173	603296	华勤技术	1,813,149	134,662,576.23	0.14
174	601377	兴业证券	22,239,265	134,325,160.60	0.14
175	600547	山东黄金	5,812,535	134,211,433.15	0.14
176	600795	国电电力	28,730,197	134,170,019.99	0.14
177	600015	华夏银行	20,510,077	131,059,392.03	0.14
178	600585	海螺水泥	7,700,457	130,522,746.15	0.14
179	601669	中国电建	27,666,197	130,031,125.90	0.14
180	000166	申万宏源	29,152,217	128,269,754.80	0.14
181	300316	晶盛机电	2,118,195	127,938,978.00	0.13
182	601916	浙商银行	48,511,319	127,584,768.97	0.13
183	002648	卫星化学	5,391,881	126,655,284.69	0.13
184	300015	爱尔眼科	15,140,351	125,059,299.26	0.13
185	601698	中国卫通	4,086,057	123,603,224.25	0.13
186	688396	华润微	1,257,288	122,648,444.40	0.13

187	601066	中信建投	4,201,625	122,141,238.75	0.13
188	600346	恒力石化	6,891,409	122,046,853.39	0.13
189	601868	中国能建	44,985,086	120,110,179.62	0.13
190	002311	海大集团	2,690,498	120,023,115.78	0.13
191	300418	昆仑万维	2,952,193	119,150,509.48	0.13
192	601998	中信银行	17,156,691	118,895,868.63	0.13
193	002558	巨人网络	4,307,295	118,709,050.20	0.13
194	600482	中国动力	3,607,990	118,342,072.00	0.12
195	600436	片仔癀	1,074,724	117,445,838.72	0.12
196	600426	华鲁恒升	4,864,279	116,353,553.68	0.12
197	600066	宇通客车	4,298,900	115,253,509.00	0.12
198	000625	长安汽车	15,997,326	114,700,827.42	0.12
199	605499	东鹏饮料	921,600	113,753,088.00	0.12
200	002532	天山铝业	10,492,800	112,587,744.00	0.12
201	000157	中联重科	16,015,896	111,630,795.12	0.12
202	600221	海航控股	82,649,500	111,576,825.00	0.12
203	600048	保利发展	23,252,918	107,661,010.34	0.11
204	600011	华能国际	14,173,565	107,577,358.35	0.11
205	600438	通威股份	8,741,080	105,854,478.80	0.11
206	601077	渝农商行	17,208,742	105,145,413.62	0.11
207	002236	大华股份	6,344,530	104,621,299.70	0.11
208	600570	恒生电子	4,935,893	104,591,572.67	0.11
209	688047	龙芯中科	683,307	104,502,293.69	0.11
210	600115	中国东航	27,355,219	104,223,384.39	0.11
211	002493	荣盛石化	9,639,551	103,625,173.25	0.11
212	600886	国投电力	7,707,889	102,592,002.59	0.11
213	600188	兖矿能源	5,743,904	102,069,174.08	0.11
214	300803	指南针	1,123,328	100,020,477.76	0.11
215	003816	中国广核	25,303,100	98,935,121.00	0.10
216	002736	国信证券	9,900,725	98,908,242.75	0.10
217	601058	赛轮轮胎	8,525,197	98,295,521.41	0.10
218	000301	东方盛虹	8,558,781	97,998,042.45	0.10
219	601360	三六零	11,170,827	97,074,486.63	0.10
220	600026	中远海能	5,334,394	95,699,028.36	0.10
221	601901	方正证券	13,157,821	94,736,311.20	0.10
222	002074	国轩高科	3,434,863	94,493,081.13	0.10
223	688036	传音控股	1,572,800	92,716,560.00	0.10
224	600009	上海机场	4,011,744	92,671,286.40	0.10
225	000768	中航西飞	4,511,249	92,390,379.52	0.10
226	600196	复星医药	4,102,974	92,193,825.78	0.10
227	601111	中国国航	15,127,376	91,520,624.80	0.10
228	601788	光大证券	6,319,500	91,190,385.00	0.10
229	000975	山金国际	5,320,143	90,442,431.00	0.10

230	600415	小商品城	8,882,461	90,245,803.76	0.10
231	600029	南方航空	17,312,441	89,678,444.38	0.09
232	601456	国联民生	10,116,626	89,430,973.84	0.09
233	600674	川投能源	6,302,416	89,305,234.72	0.09
234	601881	中国银河	7,093,161	89,161,033.77	0.09
235	301269	华大九天	743,669	88,808,951.98	0.09
236	600219	南山铝业	22,192,710	88,548,912.90	0.09
237	601186	中国铁建	14,875,164	88,507,225.80	0.09
238	601117	中国化学	11,794,690	86,690,971.50	0.09
239	600233	圆通速递	5,461,200	86,013,900.00	0.09
240	601877	正泰电器	3,427,260	85,921,408.20	0.09
241	301236	软通动力	2,001,067	84,945,294.15	0.09
242	688506	百利天恒	288,424	84,805,308.72	0.09
243	601878	浙商证券	8,919,669	84,736,855.50	0.09
244	600372	中航机载	7,754,535	84,136,704.75	0.09
245	002920	德赛西威	1,017,127	82,895,850.50	0.09
246	000963	华东医药	2,914,155	81,946,038.60	0.09
247	300866	安克创新	764,251	79,864,229.50	0.08
248	600741	华域汽车	5,012,711	77,797,274.72	0.08
249	001979	招商蛇口	11,602,959	74,607,026.37	0.08
250	000895	双汇发展	3,304,447	74,019,612.80	0.08
251	002304	洋河股份	1,938,408	73,950,265.20	0.08
252	601898	中煤能源	5,893,691	71,785,156.38	0.08
253	601021	春秋航空	1,546,627	70,495,258.66	0.07
254	601319	中国人保	10,309,856	69,694,626.56	0.07
255	600023	浙能电力	13,052,010	68,653,572.60	0.07
256	600039	四川路桥	8,433,490	65,949,891.80	0.07
257	601800	中国交建	11,406,562	65,131,469.02	0.07
258	000002	万　科A	21,942,627	64,950,175.92	0.07
259	688223	晶科能源	13,145,343	62,440,379.25	0.07
260	600588	用友网络	6,644,343	60,995,068.74	0.06
261	001965	招商公路	6,633,041	60,758,655.56	0.06
262	601633	长城汽车	4,020,262	60,665,753.58	0.06
263	302132	中航成飞	1,002,100	58,442,472.00	0.06
264	603369	今世缘	2,454,624	58,199,135.04	0.06
265	600027	华电国际	12,823,914	57,066,417.30	0.06
266	601618	中国中冶	23,042,213	56,222,999.72	0.06
267	600600	青岛啤酒	1,069,174	55,842,958.02	0.06
268	601607	上海医药	3,561,802	54,851,750.80	0.06
269	600918	中泰证券	10,213,529	54,335,974.28	0.06
270	600061	国投资本	8,247,132	54,018,714.60	0.06
271	000617	中油资本	8,164,807	53,806,078.13	0.06
272	300628	亿联网络	1,584,905	53,601,487.10	0.06

273	600025	华能水电	5,995,177	53,297,123.53	0.06
274	300251	光线传媒	4,772,088	52,922,455.92	0.06
275	600930	华电新能	10,820,736	51,614,910.72	0.05
276	600085	同仁堂	2,231,037	51,559,265.07	0.05
277	688472	阿特斯	4,738,666	51,272,366.12	0.05
278	300832	新产业	1,207,892	50,731,464.00	0.05
279	600515	海南机场	18,412,305	50,449,715.70	0.05
280	603260	合盛硅业	1,042,556	50,313,752.56	0.05
281	601059	信达证券	3,067,354	49,660,461.26	0.05
282	600803	新奥股份	3,094,898	48,899,388.40	0.05
283	000999	华润三九	2,161,860	48,620,231.40	0.05
284	300896	爱美客	539,200	47,018,240.00	0.05
285	600845	宝信软件	2,811,527	46,755,694.01	0.05
286	600018	上港集团	9,710,629	45,834,168.88	0.05
287	300122	智飞生物	3,847,687	44,979,461.03	0.05
288	300999	金龙鱼	1,916,700	44,582,442.00	0.05
289	000596	古井贡酒	557,137	44,459,532.60	0.05
290	000708	中信特钢	3,203,444	40,427,463.28	0.04
291	688009	中国通号	8,347,892	39,735,965.92	0.04
292	601018	宁波港	12,581,661	39,632,232.15	0.04
293	001280	中国铀业	589,515	39,320,650.50	0.04
294	301165	锐捷网络	475,620	38,263,629.00	0.04
295	300413	芒果超媒	2,456,202	35,934,235.26	0.04
296	601238	广汽集团	7,062,673	35,878,378.84	0.04
297	688303	大全能源	1,829,096	31,881,143.28	0.03
298	603392	万泰生物	1,163,158	31,370,371.26	0.03
299	601136	首创证券	1,742,701	24,310,678.95	0.03
300	001391	国货航	4,807,077	19,564,803.39	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.01
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.00
3	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.00
4	688818	电科蓝天	17,168	1,266,122.03	0.00
5	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
6	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
7	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
8	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
9	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00

10	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
11	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
12	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
13	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
14	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
15	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
16	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
17	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
18	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
19	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
20	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
21	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
22	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
23	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
24	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
25	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
26	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
27	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
28	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
29	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
30	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
31	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
32	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
33	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
34	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
35	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
36	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
37	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
38	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
39	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	3,216,091,118.11	0.76
2	688012	中微公司	2,883,795,054.75	0.68
3	300502	新易盛	2,554,960,075.75	0.61
4	300750	宁德时代	2,124,425,353.98	0.50
5	002371	北方华创	1,868,070,823.89	0.44
6	688041	海光信息	1,036,714,642.60	0.25

7	688271	联影医疗	906,799,671.76	0.21
8	000988	华工科技	890,220,926.24	0.21
9	000333	美的集团	871,530,796.32	0.21
10	300394	天孚通信	867,063,678.90	0.21
11	688521	芯原股份	836,293,575.63	0.20
12	002475	立讯精密	643,886,293.63	0.15
13	300059	东方财富	613,077,074.69	0.15
14	002594	比亚迪	594,893,128.46	0.14
15	301308	江波龙	590,842,691.01	0.14
16	688072	拓荆科技	588,761,657.03	0.14
17	300803	指南针	560,903,225.24	0.13
18	600436	片仔癀	533,555,277.23	0.13
19	002353	杰瑞股份	493,319,736.59	0.12
20	300476	胜宏科技	465,487,477.24	0.11

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	15,244,328,361.61	3.61
2	300308	中际旭创	14,474,588,020.52	3.43
3	300502	新易盛	8,961,091,166.31	2.12
4	000333	美的集团	5,984,047,306.34	1.42
5	002371	北方华创	5,124,943,568.66	1.21
6	002475	立讯精密	4,751,045,958.30	1.13
7	300059	东方财富	4,338,130,153.49	1.03
8	688256	寒武纪	4,243,961,334.45	1.01
9	002594	比亚迪	3,962,827,902.77	0.94
10	300274	阳光电源	3,418,130,122.22	0.81
11	000858	五 粮 液	2,895,415,731.38	0.69
12	300476	胜宏科技	2,774,402,800.66	0.66
13	000725	京东方 A	2,763,759,721.40	0.65
14	000651	格力电器	2,693,177,453.76	0.64
15	002384	东山精密	2,556,353,705.69	0.61
16	300394	天孚通信	2,545,362,040.25	0.60
17	000338	潍柴动力	2,213,897,132.41	0.52
18	300124	汇川技术	2,190,797,653.04	0.52
19	002230	科大讯飞	2,055,307,523.37	0.49
20	002714	牧原股份	2,002,210,129.34	0.47

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	49,152,763,636.09
卖出股票收入（成交）总额	188,756,739,428.86

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	456,568,963.31
2	应收清算款	385,085,617.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	841,715,073.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.01	新股锁定期内
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.00	新股锁定期内
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.00	新股锁定期内
4	001248	华润新能源	595,206.03	0.00	新股锁定期内
4	001248	华润新能源	255,085.41	0.00	新股未上市
5	688818	电科蓝天	120,430.38	0.00	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有	户均持	持有人结构

人户数（户）	有的基金份额	机构投资者		个人投资者		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	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
511,881	36,951.73	11,660,211,416.00	61.65	6,232,594,106.00	32.95	1,022,082,168.00	5.40

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 5 月 4 日）基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	88,829,587,690.00
本报告期基金总申购份额	12,114,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	82,028,700,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,914,887,690.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 3 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	-
管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 2	**内容**
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 6 月 8 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施

受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无重大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

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
华泰证券	2	58,913,296,608.08	24.78	5,891,655.90	24.78	-
国泰海通证券	3	55,678,385,431.95	23.42	5,568,166.05	23.42	-
国投证券	1	32,480,325,763.75	13.66	3,248,155.72	13.66	-
东方财富证券	2	27,265,972,030.44	11.47	2,726,749.94	11.47	-
方正证券	2	13,994,877,450.08	5.89	1,399,564.66	5.89	-
申万宏源	3	12,649,210,662.43	5.32	1,264,996.88	5.32	-
广发证券	6	12,136,870,929.89	5.11	1,213,734.36	5.11	-
中信证券	3	9,266,596,040.71	3.90	926,681.87	3.90	-
中信建投	2	6,147,243,529.73	2.59	614,754.43	2.59	-
长江证券	2	5,487,586,985.67	2.31	548,796.39	2.31	-
德邦证券	1	3,712,322,207.88	1.56	371,240.00	1.56	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

(1)具有相应的业务经营资格；

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

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

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

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

(6)被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1)公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核

的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

（2)基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

（3)如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于东莞证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 26 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配拓荆科技（688072）非公开发行 A 股的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
5	关于西部证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 16 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 12 日
7	关于东方证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 11 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 06 日
9	关于中国银河证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 05 月 28 日
10	关于国投证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 21 日

11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 10 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 27 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 05 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 27 日
15	关于同意东吴证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 03 日
16	关于同意东方财富证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 02 日
17	关于同意兴业证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 28 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 26 日
19	关于同意国投证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 16 日
20	上海证券交易所关于提醒沪深 300ETF 期权合约即将调整的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 12 日
21	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 12 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更扩位证券简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 08 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日