

# 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 2026 年第 2 季度报告

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                 |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华泰柏瑞上证科创板 50 成份 ETF                                                                                                                                                             |
| 场内简称       | 科创板(扩位证券简称:科创 50ETF 华泰柏瑞)                                                                                                                                                       |
| 基金主代码      | 588090                                                                                                                                                                          |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                                                                                                                          |
| 基金合同生效日    | 2020 年 9 月 28 日                                                                                                                                                                 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,950,072,758.00 份                                                                                                                                                              |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。                                                                                                             |
| 投资策略       | 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；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。 |
| 业绩比较基准     | 上证科创板 50 成份指数                                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征     | 本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证科创板 50 成份指数，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。                                                                     |
| 基金管理人      | 华泰柏瑞基金管理有限公司                                                                                                                                                                    |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司                                                                                                                                                                    |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,200,484,263.55                      |
| 2. 本期利润         | 2,410,862,536.81                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.9873                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 4,409,466,916.99                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 2.2612                                |

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 2020 年 11 月 9 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.69829249。  
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 元购买科创板 ETF 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             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 74.85%     | 2.83%         | 75.74%         | 2.85%                 | -0.89% | -0.02% |
| 过去六个月          | 63.30%     | 2.49%         | 64.25%         | 2.51%                 | -0.95% | -0.02% |
| 过去一年           | 118.68%    | 2.26%         | 120.04%        | 2.27%                 | -1.36% | -0.01% |
| 过去三年           | 117.57%    | 2.13%         | 119.66%        | 2.14%                 | -2.09% | -0.01% |
| 过去五年           | 37.81%     | 1.93%         | 39.02%         | 1.94%                 | -1.21% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 57.90%     | 1.88%         | 61.86%         | 1.90%                 | -3.96% | -0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华泰柏瑞上证科创板50成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2020 年 9 月 28 日至 2026 年 6 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务            | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----|---------------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |               | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 柳军 | 副总经理、本基金的基金经理 | 2020 年 9 月 28 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 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>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</p> |
|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                               |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 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。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

4.1.1 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

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 4 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，科创 50 指数上涨 75.74%，表现优于科创 100 指数的 60.62%，同时也优于科创 200 指数的 42.43%，表明二季度大盘成长风格十分明确，与我们在一季报中提到的从全年来看，科创 50 指数有望在二季度产生主要投资机会的观点相吻合。

进入三季度，我们判断科创 50 指数的涨势大概率将有所放缓，特别是考虑到在二季度的极致

分化行情，指数对单一板块的风险暴露相对较大，若后续 AI 板块上涨陷入停滞甚至阶段性回调，那么指数可能将较大程度承压。

站在当前时点来看，市场的极致分化大概率已经达到临界点，AI 板块的“抱团”可能会随着重磅 IPO 的临近而逐渐松动，叠加 token maxxing 叙事的可靠性受到越来越多关注，以及前沿模型所受监管日益严格，AI 在三季度可能将开始向物理层面扩散，借助技术不断迭代升级的世界模型在智能驾驶、机器人、工业制造等领域加快应用落地，创新药作为独立板块也处在基本面和股价高度背离的状态，上述行业有望在三季度成为对冲算力主题回调的主要支撑力，并且当市场逻辑开始向端侧推理需求传导时，可能为算力主题提供二次上涨的动能。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.2612 元，本报告期基金份额净值增长率为 74.85%，业绩比较基准收益率为 75.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 4,354,687,828.64 | 98.04        |
|    | 其中：股票             | 4,354,687,828.64 | 98.04        |
| 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      | 84,133,847.45    | 1.89         |
| 8  | 其他资产              | 3,074,098.52     | 0.07         |
| 9  | 合计                | 4,441,895,774.61 | 100.00       |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | —                | —            |
| B  | 采矿业              | —                | —            |
| C  | 制造业              | 3,443,605,567.49 | 78.10        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —                | —            |
| E  | 建筑业              | —                | —            |
| F  | 批发和零售业           | —                | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —                | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 908,291,480.09   | 20.60        |
| 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               | 4,351,897,047.58 | 98.69        |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —            | —            |
| B  | 采矿业              | —            | —            |
| C  | 制造业              | 2,790,781.06 | 0.06         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —            |
| E  | 建筑业              | —            | —            |
| F  | 批发和零售业           | —            | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —            | —            |
| 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            | 2,790,781.06 | 0.06 |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.2.3 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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  | 688256 | 寒武纪  | 253,251   | 404,074,633.05 | 9.16         |
| 2  | 688008 | 澜起科技 | 1,149,630 | 354,616,337.00 | 8.04         |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 755,388   | 353,899,278.00 | 8.03         |
| 4  | 688041 | 海光信息 | 935,156   | 346,288,266.80 | 7.85         |
| 5  | 688981 | 中芯国际 | 2,009,875 | 319,208,347.50 | 7.24         |
| 6  | 688498 | 源杰科技 | 114,864   | 216,633,504.00 | 4.91         |
| 7  | 688525 | 佰维存储 | 436,138   | 215,770,552.74 | 4.89         |
| 8  | 688072 | 拓荆科技 | 224,377   | 184,323,735.49 | 4.18         |
| 9  | 688521 | 芯原股份 | 488,042   | 181,131,907.88 | 4.11         |
| 10 | 688347 | 华虹宏力 | 465,455   | 156,532,516.50 | 3.55         |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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  | 688818 | 电科蓝天 | 17,168 | 1,266,122.03 | 0.03         |
| 2  | 688820 | 盛合晶微 | 2,391  | 338,302.59   | 0.01         |
| 3  | 688790 | 昂瑞微  | 2,319  | 293,237.55   | 0.01         |
| 4  | 688781 | 视涯科技 | 6,335  | 267,083.60   | 0.01         |
| 5  | 688808 | 联讯仪器 | 163    | 258,245.79   | 0.01         |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

## 5.4 报告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。

#### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告

编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 118,051.71   |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,895,554.18 |
| 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      | 3,074,098.52 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明  |
|----|--------|------|----------------|--------------|-----------|
| 1  | 688072 | 拓荆科技 | 164,062,080.00 | 3.72         | 重大事项停牌    |
| 1  | 688072 | 拓荆科技 | 20,261,655.49  | 0.46         | 非公开发行流通受限 |
| 2  | 688008 | 澜起科技 | 13,841,000.00  | 0.31         | 新股锁定期内    |

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688820 | 盛合晶微 | 338,302.59     | 0.01         | 新股锁定期内   |
| 2  | 688790 | 昂瑞微  | 293,237.55     | 0.01         | 新股锁定期内   |
| 3  | 688781 | 视涯科技 | 267,083.60     | 0.01         | 新股锁定期内   |
| 4  | 688808 | 联讯仪器 | 258,245.79     | 0.01         | 新股锁定期内   |
| 5  | 688818 | 电科蓝天 | 120,430.38     | 0.00         | 新股锁定期内   |

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 3,171,072,758.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3,366,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 4,587,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 1,950,072,758.00 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |                | 报告期末持有基金情况     |                         |
|-------|----------------|-------------------------|------------------|----------------|----------------|-------------------------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额           | 赎回份额           | 持有份额<br>占比 (%)          |
| 机构    | 1              | 20260626-20260629;      | 75,853,800.00    | 540,415,300.00 | 342,938,500.00 | 273,330,600.00<br>14.02 |
| 联接基金  | 1              | 20260401-20260630;      | 1,110,502,444.00 | 7,139,900.00   | 424,359,912.00 | 693,282,432.00<br>35.55 |

#### 产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同

提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 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

### 9.3 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 7 月 21 日