

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
2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 500 指增 |
| 场内简称 | 500 指增（扩位证券简称：500 增强 ETF） |
| 基金主代码 | 561550 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 2 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 671,989,551.00 份 |
| 投资目标 | 利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，力争实现超越标的指数的投资回报，追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>1、股票的投资策略</p> <p>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制相对业绩基准指数跟踪误差的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>本基金运用的量化投资模型主要包括：</p> <p>（1）多因子 alpha 模型——股票超额回报预测</p> <p>多因子 alpha 模型以中国股票市场较长期的回溯研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。</p> <p>多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>要性做出具有一定前瞻性的判断, 适合调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>(2) 风险估测模型——有效控制预期风险 本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施, 有效控制投资组合的预期投资风险, 并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。</p> <p>(3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩 本基金的交易成本模型既考虑固定成本, 也考虑交易的市场冲击效应, 以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上, 进行投资收益的优化。</p> <p>(4) 投资组合的优化和调整 本基金将综合考虑预期回报, 风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。投资组合构建完成后, 本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况, 对投资组合进行相应调整, 并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。 本基金对标的指数的跟踪目标是力争使基金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 0.35%, 年化跟踪误差不超过 6.5%。 本基金以 T-1 日优化投资组合为基础, 考虑 T 日将会发生的成份股公司变动等情况, 设计 T 日申购、赎回清单并公告。</p> <p>2、存托凭证投资策略;3、债券投资策略;4、股指期货投资策略;5、资产支持证券的投资策略;6、融资及转融通证券出借业务的投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率 |
| 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; 本基金同时是指数型基金, 具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§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 (2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|-----------------|--------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 10,732,309.48 |
| 2. 本期利润 | -22,640,452.90 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0331 |
| 4. 期末基金资产净值 | 602,575,847.91 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8967 |

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。

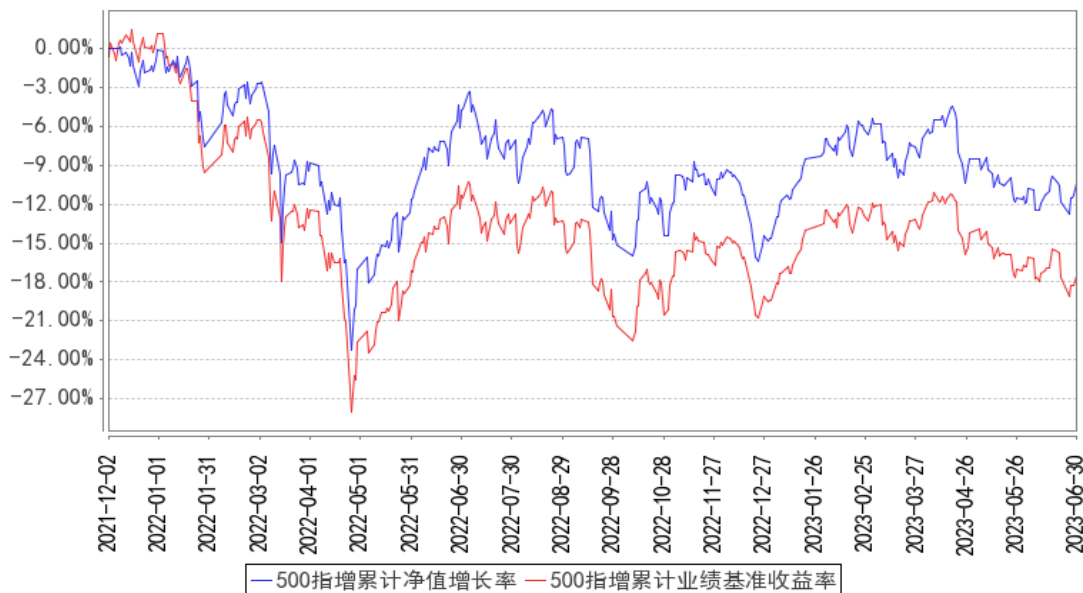
3.2 基金净值表现

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 ① | 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 | -3.67% | 0.81% | -5.38% | 0.83% | 1.71% | -0.02% |
| 过去六个月 | 5.07% | 0.80% | 2.29% | 0.79% | 2.78% | 0.01% |
| 过去一年 | -5.85% | 0.97% | -7.06% | 0.96% | 1.21% | 0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | -10.33% | 1.17% | -17.52% | 1.19% | 7.19% | -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

500指增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 2021 年 12 月 2 日至 2023 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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|------------------------|-----------------|---|------|---|
| 田汉卿 | 副总经理、本基金的基金经理 | 2021 年 12 月 2 日 | - | 21 年 | <p>副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2021 年 11 月任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型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 4 月起任华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。</p> |
| 柳军 | 总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理 | 2021 年 12 月 2 日 | - | 22 年 | <p>复旦大学财务管理硕士，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、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。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 月起任华泰柏瑞中证 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 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

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

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：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 4 次为指数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

2023 年二季度，A 股市场整体表现较弱，各主要股票指数呈现下跌后企稳的走势，市场热点从 AI、中特估等主题板块开始转向超跌板块的修复和可能的政策博弈。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别下跌 6.38%和 5.15%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别下跌 7.69%和 7.06%；中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别下跌 5.38%和 3.98%。横向比较来看，中小市值与主题板块相对较强，成长板块下跌较多。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

回顾 2023 年二季度，在经历了经济快速修复之后，市场逐渐从对经济复苏的强一致预期状态切换到对国内经济复苏进度、外部经济衰退风险、产业政策发展方向等核心矛盾的分歧状态，行情结构先是延续主题驱动的结构性情到短期见顶，而后调整转向政策博弈，市场开始期待可能的经济刺激政策与产业政策。展望 2023 年全年，疫情之后，尽管需要付出很大的努力，经济的恢复和增长是值得期待的；同时，我们认为股票市场的表现会继续反应经济的修复。此外，A 股市场当前的整体估值或仍具吸引力，投资人情绪可能正处在恢复过程中，估值修复本身也可以推动市场的上行。在不出现极端情况的前提下，我们对 2023 年的股票市场持乐观态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格可能会更加有利于华泰柏瑞量化模型获取超额收益。从因子表现来看，前两年受到压制的估值因子于近一年反转为正，其趋势或仍将延续，而我们的成长因子预期可能会继续表现良好；政策面和消息面的扰动始终影响较短，相信市场主线是会回归到股票的基本面上；未来大小市值、各行业股票的表现或将更加均衡；量化投资全市场选股的优势有望得以更好体现。尽管市场这些方面的回归可能还会有一定的反复，但我们认为大方向上是比较确定的。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，或是很不错的买入风格均衡的量化基金的机会。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.249%，期间日跟踪误差为 0.328%，较好地实现了本基金的投资目标。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用量化选股策略，在有效控制主动投资风险的前提下，力求争取继续获得超越标的指数的超额收益。

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 0.8967 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.67%，业绩

比较基准收益率为-5.38%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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 | 594,789,526.93 | 98.16 |
| | 其中：股票 | 594,789,526.93 | 98.16 |
| 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 | 11,024,423.06 | 1.82 |
| 8 | 其他资产 | 130,563.04 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 605,944,513.03 | 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 | 4,582,595.00 | 0.76 |
| B | 采矿业 | 39,184,948.00 | 6.50 |
| C | 制造业 | 364,591,830.48 | 60.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 28,338,688.40 | 4.70 |
| E | 建筑业 | 5,409,529.60 | 0.90 |
| F | 批发和零售业 | 41,425,698.97 | 6.87 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,336,378.99 | 1.55 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,258,280.00 | 0.21 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,832,556.00 | 3.62 |
| J | 金融业 | 46,636,056.58 | 7.74 |
| K | 房地产业 | 6,746,653.00 | 1.12 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 4,907,352.00 | 0.81 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,850,249.20 | 0.80 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,157,103.10 | 1.02 |
| 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 | 7,389,788.00 | 1.23 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 592,647,707.32 | 98.35 |

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 | 1,875,582.07 | 0.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 9,608.91 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 56,208.73 | 0.01 |
| 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 | 111,968.52 | 0.02 |
| 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 | 14,394.48 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 14,826.57 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 23,782.86 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,141,819.61 | 0.36 |

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 | 688516 | 奥特维 | 85,600 | 16,127,040.00 | 2.68 |
| 2 | 300724 | 捷佳伟创 | 73,461 | 8,253,343.35 | 1.37 |
| 3 | 688002 | 睿创微纳 | 184,122 | 8,248,665.60 | 1.37 |
| 4 | 002223 | 鱼跃医疗 | 214,400 | 7,716,256.00 | 1.28 |
| 5 | 000933 | 神火股份 | 544,300 | 7,075,900.00 | 1.17 |
| 6 | 002518 | 科士达 | 174,000 | 6,961,740.00 | 1.16 |
| 7 | 600566 | 济川药业 | 236,900 | 6,879,576.00 | 1.14 |
| 8 | 601717 | 郑煤机 | 549,000 | 6,835,050.00 | 1.13 |
| 9 | 600481 | 双良节能 | 478,100 | 6,683,838.00 | 1.11 |
| 10 | 300861 | 美畅股份 | 148,691 | 6,448,728.67 | 1.07 |

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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 | 301291 | 明阳电气 | 8,018 | 260,127.66 | 0.04 |
| 2 | 301486 | 致尚科技 | 4,251 | 245,112.66 | 0.04 |
| 3 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.02 |
| 4 | 301488 | 豪恩汽电 | 2,618 | 104,144.04 | 0.02 |
| 5 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.01 |

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，睿创微纳（688002）于 2022 年 7 月 29 日被山东证监局，因定期报告披露超期限，给予责令改正的处罚。对该证券投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，上述证券系标的指数成份股，上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金本报告期末投资的前十名证券中，鱼跃医疗（002223）于 2023 年 2 月 2 日收到镇江市市场监督管理局下发的镇市监处罚（2023）00001 号，因公司血氧仪销售价格上涨严重，属于未依法履行其他职责，作出责令改正相关违法行为，并处以 270 万元罚款。对该证券投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，上述证券系标的指数成份股，上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内基金投资的前十名其他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规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 54,946.80 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 75,616.24 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 130,563.04 |

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

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。

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 | 301486 | 致尚科技 | 245,112.66 | 0.04 | 新股未上市 |
| 2 | 301292 | 海科新源 | 116,421.76 | 0.02 | 新股未上市 |
| 3 | 301488 | 豪恩汽电 | 93,721.68 | 0.02 | 新股未上市 |
| 3 | 301488 | 豪恩汽电 | 10,422.36 | 0.00 | 新股锁定期内 |
| 4 | 301202 | 朗威股份 | 79,009.20 | 0.01 | 新股未上市 |
| 5 | 301291 | 明阳电气 | 24,886.06 | 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 | 685,489,551.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 108,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 121,500,000.00 |
| 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 | 671,989,551.00 |

§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：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

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

2023 年 7 月 21 日