

# 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 2023 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>79</b>
7.1 期末基金资产组合情况	79
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	80
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	81
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	84
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	86
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	86

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 .....	86
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 .....	86
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 .....	86
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	86
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	86
7.12 投资组合报告附注 .....	86
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>88</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	88
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	88
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	89
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	89
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>89</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>90</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	90
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 .....	90
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	90
10.4 基金投资策略的改变 .....	90
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	90
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	90
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	90
10.8 其他重大事件 .....	94
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>95</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	95
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>96</b>
12.1 备查文件目录 .....	96
12.2 存放地点 .....	96
12.3 查阅方式 .....	96

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	红利低波
场内简称	红利低波(扩位证券简称: 红利低波 ETF)
基金主代码	512890
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 19 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
报告期末基金份额总额	1,378,110,780.00 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	2019 年 1 月 18 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。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。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	中证红利低波动指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 采用完全复制的被动式投资策略: 一方面, 相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高; 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	王小飞
	联系电话	021-38601777	021-60637103
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	021-60637228
传真		021-38601799	021-60635778
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 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 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的基金管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	36,173,278.63
本期利润	-6,098,711.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0093
本期加权平均净值利润率	-1.02%
本期基金份额净值增长率	11.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	565,547,529.23
期末可供分配基金份额利润	0.4104
期末基金资产净值	1,254,602,920.05
期末基金份额净值	0.9104
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	82.08%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

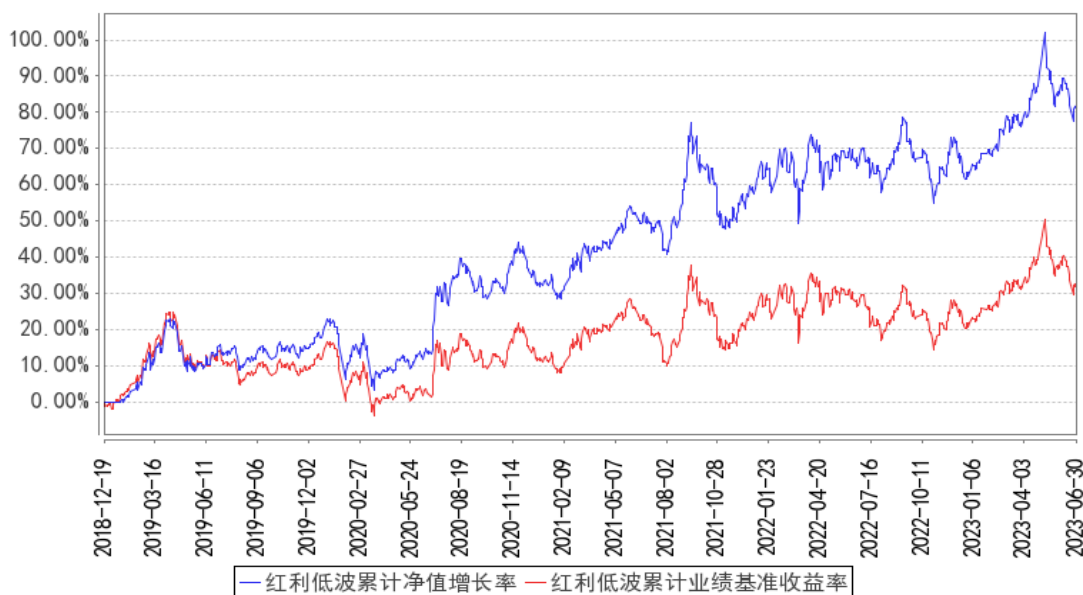
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	-1.31%	0.90%	-3.34%	0.94%	2.03%	-0.04%
过去三个月	2.51%	1.06%	-0.15%	1.09%	2.66%	-0.03%
过去六个月	11.43%	0.89%	8.51%	0.91%	2.92%	-0.02%
过去一年	7.24%	0.97%	2.03%	0.99%	5.21%	-0.02%
过去三年	58.97%	1.14%	29.47%	1.17%	29.50%	-0.03%
自基金合同生效至今	82.08%	1.12%	32.10%	1.15%	49.98%	-0.03%

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

红利低波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 2018 年 12 月 19 日至 2023 年 6 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币

市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、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、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资



资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、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)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、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(QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选6个月持有期混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞中证香港300金融服务交易型开放式指数证券投资基金(QDII),华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金,华泰柏瑞招享6个月持有期混合型证券投资基金,华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII),华泰柏瑞上证50指数增强型证券投资基金,华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金,华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金,华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金,华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金,华泰柏瑞致远混合型证券投资基金,华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至2023年6月30日,公司基金管理规模为3,348.66亿元。

#### 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		
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2018年12月19日	-	22年	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

				<p>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。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。</p>
--	--	--	--	--

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理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 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

2023 年上半年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、计算机、机械设备的表现相对较好，涨跌幅分别为 50.66%、42.75%、27.57% 和 13.44%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为 -0.75%、2.29%、5.10% 和 -5.61%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为 3.65% 和 -6.15%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了显著的超额收益。

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 0.032%，期间日跟踪误差为 0.072%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9104 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.43%，业绩比较基准收益率为 8.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年以来，在经济复苏预期波动下表现震荡加剧，红利策略表现出较强的防御性，成为市场“避风港”。展望后市，国内稳增长政策不断出台，主要集中于房地产、资本市场、民营经济、平台经济等领域，且与经济预期强相关行业的修复正在渐入佳境。红利系列指数在顺周期行业暴露较高，或再次成为攻守兼备的标的的重要切入点。同时，我们认为“中特估”行情下，高分红特点的央国企是一条重要且清晰的投资思路。因此，以“股息率”为筛选标准的红利策略在央国企行情下具备天然优势，具有估值重塑的投资机会。当前，华泰柏瑞红利系列产品的“央国企”权重占比均超 75%。我们认为“中特估”机会仍然是全年投资主线之一，可以加大高股息策略的配置权重，作为“杠铃配置”中的重要一头。从估值的角度看，大多数红利策略仍然处于历史 30%左右的估值分位数水平，属于合理偏低的位置，仍具有配置价值。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

#### 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，方可对超额收益进行分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,334,284.91	2,001,225.83
结算备付金		1,172,740.53	25,399.62
存出保证金		84,696.76	14,725.29
交易性金融资产	6.4.7.2	1,243,114,329.84	256,687,516.46
其中：股票投资		1,243,114,329.84	256,687,516.46
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		-	93,578.45
应收股利		518,432.10	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	22,015.09	-
资产总计		1,259,246,499.23	258,822,445.65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,973,278.11	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		505,609.43	108,885.95
应付托管费		101,121.90	21,777.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,063,569.74	417,149.94
负债合计		4,643,579.18	547,813.09
<b>净 资 产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	689,055,390.82	158,055,389.93
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	565,547,529.23	100,219,242.63
净资产合计		1,254,602,920.05	258,274,632.56
负债和净资产总计		1,259,246,499.23	258,822,445.65

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9104 元，基金份额总额 1,378,110,780.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,143,988.14	9,888,754.18
1. 利息收入		154,063.17	3,911.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,388.76	3,911.46
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		-	-
证券出借利息收入		141,674.41	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		36,533,748.24	7,686,204.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,974,602.56	1,899,977.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	363,395.07	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	30,195,750.61	5,786,227.01
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	-42,271,990.47	2,182,805.44
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	1,440,190.92	15,832.59
<b>减：二、营业总支出</b>		1,954,723.70	596,852.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,471,351.49	385,213.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	294,270.33	77,042.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		1.39	-
8. 其他费用	6.4.7.23	189,100.49	134,596.77



三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,098,711.84	9,291,901.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,098,711.84	9,291,901.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,098,711.84	9,291,901.53

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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（基金净值）	158,055,389.93	-	100,219,242.63	258,274,632.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	158,055,389.93	-	100,219,242.63	258,274,632.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	531,000,000.89	-	465,328,286.60	996,328,287.49
（一）、综合收益总额	-	-	-6,098,711.84	-6,098,711.84
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	531,000,000.89	-	471,426,998.44	1,002,426,999.33
其中：1. 基金申购款	830,000,000.74	-	727,023,649.29	1,557,023,650.03
2. 基金赎回款	-298,999,999.85	-	-255,596,650.85	-554,596,650.70
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	689,055,390.82	-	565,547,529.23	1,254,602,920.05
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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（基金净值）	51,055,389.99	-	30,168,488.39	81,223,878.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	51,055,389.99	-	30,168,488.39	81,223,878.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	101,500,000.01	-	76,299,734.06	177,799,734.07
（一）、综合收益总额	-	-	9,291,901.53	9,291,901.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	101,500,000.01	-	67,007,832.53	168,507,832.54
其中：1. 基金申购款	129,000,000.05	-	85,340,748.04	214,340,748.09
2. 基金赎回款	-27,500,000.04	-	-18,332,915.51	-45,832,915.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产(基金净值)	152,555,390.00	-	106,468,222.45	259,023,612.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证红利低波动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[2018]1645号《关于准予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注册的批复》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《华泰柏瑞中证红利低波动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 683,534,168.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0769 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2018 年 12 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 683,555,390.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 21,222.00 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《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招募说明书》和《华泰柏瑞基金管理有限公司关于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实施基金份额拆分业务及相关业务安排的公告》的有关规定,本基金于 2021 年 10 月 22 日进行了基金份额拆分,份额拆分比例为 1:2,并于 2021 年 10 月 22 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2019]10 号文审核同意,本基金 683,555,390.00 份基金份额于 2019 年 1 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、

可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证红利低波动指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了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(以下简称“华泰柏瑞中证红利低波 ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证红利低波 ETF 联接基金为交易型开放式基金，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 2023 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,334,284.91
等于：本金	14,333,072.86
加：应计利息	1,212.05
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	14,334,284.91

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,297,257,573.15	-	1,243,114,329.84	-54,143,243.31
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	1,297,257,573.15	-	1,243,114,329.84	-54,143,243.31

注：注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

### 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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 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 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	22,015.09
待摊费用	-
合计	22,015.09

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	145,627.05
其中：交易所市场	145,627.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	102,090.04
应退退补款	729,072.20
合计	1,063,569.74

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	316,110,780.00	158,055,389.93
本期申购	1,660,000,000.00	830,000,000.74
本期赎回（以“-”号填列）	-598,000,000.00	-298,999,999.85
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	1,378,110,780.00	689,055,390.82

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：本基金本报告期末未有其他综合收益。



## 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	120,042,291.09	-19,823,048.46	100,219,242.63
本期利润	36,173,278.63	-42,271,990.47	-6,098,711.84
本期基金份额交易产生的变动数	412,139,506.10	59,287,492.34	471,426,998.44
其中：基金申购款	647,315,325.25	79,708,324.04	727,023,649.29
基金赎回款	-235,175,819.15	-20,420,831.70	-255,596,650.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	568,355,075.82	-2,807,546.59	565,547,529.23

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	8,241.74
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	3,844.33
其他	302.69
合计	12,388.76

## 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,775,346.78
股票投资收益——赎回差价收入	7,749,949.34
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,974,602.56

## 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	142,373,980.23
减：卖出股票成本总额	143,804,859.39
减：交易费用	344,467.62
买卖股票差价收入	-1,775,346.78

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	554,596,650.70
减：现金支付赎回款总额	101,802,453.70
减：赎回股票成本总额	445,044,247.66
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,749,949.34

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	385.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	363,009.87
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	363,395.07

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,626,511.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,263,000.00
减：应计利息总额	396.80
减：交易费用	105.19
买卖债券差价收入	363,009.87

##### 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**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	30,195,750.61
其中：证券出借权益补偿收入	1,205,296.00

基金投资产生的股利收益	-
合计	30,195,750.61

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-42,271,990.47
股票投资	-42,271,990.47
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	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-42,271,990.47

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,440,190.92
合计	1,440,190.92

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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	102,090.04
银行划款手续费	230.00

合计	189,100.49
----	------------

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

#### 6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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”）	基金管理人的股东的子公司
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	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	14,133,205.38	2.78	1,900,117.23	2.68

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
华泰证券	1,997.51	1.26	1,814.77	1.25
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
华泰证券	263.11	1.42	201.17	1.48

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. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,471,351.49
其中：支付销售机构的客户维护费	9,657.38	2,939.10

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如

下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	294,270.33	77,042.66

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

##### 6.4.10.4.2 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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	202304100001056	安徽建工	2023 年 4 月 10 日	229,500.00	37,500	14	1.70	151.76	-	-
华泰证券	2023042400051149	安徽建工	2023 年 4 月 24 日	237,000.00	37,500	14	1.70	156.66	-	-
华泰证券	202305	安徽建	2023 年	244,500.	37,500	14	1.70	161.70	-	-

	080003 0073	工	5月8日	00								
华泰证券	202304 260000 1530	安徽建 工	2023年 4月26 日	77,875.0 0	12,500	28	1.70	103.04	-	-		
华泰证券	202305 220005 5950	安徽建 工	2023年 5月22 日	212,625. 00	37,500	14	1.70	140.56	-	-		
华泰证券	202306 050002 8234	安徽建 工	2023年 6月5日	213,375. 00	37,500	14	1.70	141.12	-	-		
华泰证券	202305 240001 4958	安徽建 工	2023年 5月24 日	68,375.0 0	12,500	28	1.70	90.44	-	-		
华泰证券	202306 190002 2652	安徽建 工	2023年 6月19 日	202,500. 00	37,500	14	1.70	105.16	198,00 0.00	105.16		
华泰证券	202306 210001 3694	安徽建 工	2023年 6月21 日	65,000.0 0	12,500	28	1.70	27.63	66,000 .00	27.63		
华泰证券	202304 100000 1058	宝钢股 份	2023年 4月10 日	364,635. 00	55,500	14	1.70	241.08	-	-		
华泰证券	202304 240005 7893	宝钢股 份	2023年 4月24 日	374,625. 00	55,500	14	1.70	247.66	-	-		
华泰证券	202305 080001 3835	宝钢股 份	2023年 5月8日	381,840. 00	55,500	14	1.70	252.42	-	-		
华泰证券	202304 260000 1512	宝钢股 份	2023年 4月26 日	121,545. 00	18,500	28	1.70	160.72	-	-		
华泰证券	202305 220005 1642	宝钢股 份	2023年 5月22 日	347,985. 00	55,500	14	1.70	230.02	-	-		
华泰证券	202306 050002 2380	宝钢股 份	2023年 6月5日	330,225. 00	55,500	14	1.70	218.26	-	-		
华泰证券	202305 240002 2962	宝钢股 份	2023年 5月24 日	110,815. 00	18,500	28	1.70	146.44	-	-		
华泰证券	202306 190002 2869	宝钢股 份	2023年 6月19 日	315,240. 00	55,500	14	1.70	163.79	311,91 0.00	163.79		



华泰证券	202306 210001 7570	宝钢股份	2023年 6月21 日	102,305. 00	18,500	28	1.70	43.47	103,97 0.00	43.47
华泰证券	202304 100000 0992	成都银行	2023年 4月10 日	163,560. 00	12,000	14	1.70	108.08	-	-
华泰证券	202304 240005 3659	成都银行	2023年 4月24 日	165,120. 00	12,000	14	1.70	109.20	-	-
华泰证券	202305 080001 5861	成都银行	2023年 5月8日	169,440. 00	12,000	14	1.70	112.00	-	-
华泰证券	202304 260000 1510	成都银行	2023年 4月26 日	53,480.0 0	4,000	28	1.70	70.84	-	-
华泰证券	202305 220003 4570	成都银行	2023年 5月22 日	160,560. 00	12,000	14	1.70	106.12	-	-
华泰证券	202306 050002 2009	成都银行	2023年 6月5日	151,800. 00	12,000	14	1.70	100.38	-	-
华泰证券	202305 240002 2944	成都银行	2023年 5月24 日	50,280.0 0	4,000	28	1.70	66.36	-	-
华泰证券	202306 190002 3151	成都银行	2023年 6月19 日	149,520. 00	12,000	14	1.70	77.66	146,52 0.00	77.66
华泰证券	202306 210001 6752	成都银行	2023年 6月21 日	49,000.0 0	4,000	28	1.70	20.79	48,840 .00	20.79
华泰证券	202304 100000 1007	凤凰传媒	2023年 4月10 日	356,070. 00	33,000	14	1.70	235.34	-	-
华泰证券	202304 240005 1147	凤凰传媒	2023年 4月24 日	399,960. 00	33,000	14	1.70	264.46	-	-
华泰证券	202305 080001 1773	凤凰传媒	2023年 5月8日	491,700. 00	33,000	14	1.70	325.08	-	-
华泰证券	202304 260000 1518	凤凰传媒	2023年 4月26 日	149,600. 00	11,000	28	1.70	197.68	-	-
华泰证券	202305 220005	凤凰传媒	2023年 5月22	411,840. 00	33,000	14	1.70	272.30	-	-

	4264		日								
华泰证券	2023060500023734	凤凰传媒	2023年6月5日	444,510.00	33,000	14	1.70	293.86	-	-	
华泰证券	2023052400025108	凤凰传媒	2023年5月24日	137,610.00	11,000	28	1.70	182.00	-	-	
华泰证券	2023061900021625	凤凰传媒	2023年6月19日	428,670.00	33,000	14	1.70	222.64	376,200.00	222.64	
华泰证券	2023062100017727	凤凰传媒	2023年6月21日	132,990.00	11,000	28	1.70	56.52	125,400.00	56.52	
华泰证券	2023041000000982	格力电器	2023年4月10日	396,375.00	10,500	14	1.70	262.08	-	-	
华泰证券	2023042400061483	格力电器	2023年4月24日	433,545.00	10,500	14	1.70	286.58	-	-	
华泰证券	2023050800019355	格力电器	2023年5月8日	363,405.00	10,500	14	1.70	240.24	-	-	
华泰证券	2023042600001474	格力电器	2023年4月26日	140,000.00	3,500	28	1.70	185.08	-	-	
华泰证券	2023052200055674	格力电器	2023年5月22日	369,600.00	10,500	14	1.70	244.30	-	-	
华泰证券	2023060500022666	格力电器	2023年6月5日	358,785.00	10,500	14	1.70	237.16	-	-	
华泰证券	2023052400015084	格力电器	2023年5月24日	120,715.00	3,500	28	1.70	159.60	-	-	
华泰证券	2023061900022256	格力电器	2023年6月19日	378,420.00	10,500	14	1.70	196.57	383,355.00	196.57	
华泰证券	2023062100018300	格力电器	2023年6月21日	126,560.00	3,500	28	1.70	53.82	127,785.00	53.82	
华泰证券	2023041000001002	工商银行	2023年4月10日	266,175.00	58,500	14	1.70	175.98	-	-	
华泰证券	202304	工商银	2023年	276,120.	58,500	14	1.70	182.56	-	-	

	240003 8671	行	4月24 日	00							
华泰证券	202305 080001 4791	工商银 行	2023年 5月8日	310,050. 00	58,500	14	1.70	204.96	-	-	
华泰证券	202304 260000 1516	工商银 行	2023年 4月26 日	92,625.0 0	19,500	28	1.70	122.36	-	-	
华泰证券	202305 220004 6680	工商银 行	2023年 5月22 日	296,595. 00	58,500	14	1.70	196.14	-	-	
华泰证券	202306 050002 3041	工商银 行	2023年 6月5日	290,160. 00	58,500	14	1.70	191.80	-	-	
华泰证券	202305 240002 5102	工商银 行	2023年 5月24 日	92,820.0 0	19,500	28	1.70	122.64	-	-	
华泰证券	202306 190002 0767	工商银 行	2023年 6月19 日	282,555. 00	58,500	14	1.70	146.74	281,97 0.00	146.74	
华泰证券	202306 210001 7451	工商银 行	2023年 6月21 日	94,575.0 0	19,500	28	1.70	40.23	93,990 .00	40.23	
华泰证券	202304 100000 1054	海螺水 泥	2023年 4月10 日	214,200. 00	7,500	14	1.70	141.68	-	-	
华泰证券	202304 240005 0083	海螺水 泥	2023年 4月24 日	203,250. 00	7,500	14	1.70	134.40	-	-	
华泰证券	202305 080005 7937	海螺水 泥	2023年 5月8日	205,725. 00	7,500	14	1.70	135.94	-	-	
华泰证券	202304 260000 1544	海螺水 泥	2023年 4月26 日	67,175.0 0	2,500	28	1.70	88.76	-	-	
华泰证券	202305 220004 6682	海螺水 泥	2023年 5月22 日	199,875. 00	7,500	14	1.70	132.16	-	-	
华泰证券	202306 050002 1148	海螺水 泥	2023年 6月5日	191,850. 00	7,500	14	1.70	126.84	-	-	
华泰证券	202305 240001 4978	海螺水 泥	2023年 5月24 日	64,850.0 0	2,500	28	1.70	85.68	-	-	

华泰证券	2023061900018421	海螺水泥	2023年6月19日	197,100.00	7,500	14	1.70	102.41	178,050.00	102.41
华泰证券	2023062100017258	海螺水泥	2023年6月21日	60,025.00	2,500	28	1.70	25.47	59,350.00	25.47
华泰证券	2023041000000988	航民股份	2023年4月10日	204,255.00	25,500	14	1.70	135.10	-	-
华泰证券	2023042400039539	航民股份	2023年4月24日	200,940.00	25,500	14	1.70	132.86	-	-
华泰证券	2023050800059039	航民股份	2023年5月8日	209,100.00	25,500	14	1.70	138.18	-	-
华泰证券	2023042600001502	航民股份	2023年4月26日	65,535.00	8,500	28	1.70	86.52	-	-
华泰证券	2023052200059950	航民股份	2023年5月22日	200,175.00	25,500	14	1.70	132.30	-	-
华泰证券	2023060500026977	航民股份	2023年6月5日	197,880.00	25,500	14	1.70	130.76	-	-
华泰证券	2023052400022940	航民股份	2023年5月24日	64,685.00	8,500	28	1.70	85.40	-	-
华泰证券	2023061900020788	航民股份	2023年6月19日	180,285.00	25,500	14	1.70	93.61	209,865.00	93.61
华泰证券	2023062100018399	航民股份	2023年6月21日	63,495.00	8,500	28	1.70	27.00	69,955.00	27.00
华泰证券	2023041000000974	华菱钢铁	2023年4月10日	215,670.00	39,000	14	1.70	142.52	-	-
华泰证券	2023042400037237	华菱钢铁	2023年4月24日	210,990.00	39,000	14	1.70	139.44	-	-
华泰证券	2023050800036415	华菱钢铁	2023年5月8日	202,410.00	39,000	14	1.70	133.84	-	-
华泰证券	202304260000	华菱钢铁	2023年4月26日	67,860.00	13,000	28	1.70	89.60	-	-

	1466		日									
华泰证券	202305 220006 1126	华菱钢 铁	2023年 5月22 日	192,270. 00	39,000	14	1.70	127.12		-	-	
华泰证券	202306 050002 6227	华菱钢 铁	2023年 6月5日	188,370. 00	39,000	14	1.70	124.60		-	-	
华泰证券	202305 240002 2964	华菱钢 铁	2023年 5月24 日	62,140.0 0	13,000	28	1.70	82.04		-	-	
华泰证券	202306 190002 2254	华菱钢 铁	2023年 6月19 日	198,510. 00	39,000	14	1.70	103.07	186,03 0.00		103.07	
华泰证券	202306 210001 7771	华菱钢 铁	2023年 6月21 日	64,480.0 0	13,000	28	1.70	27.36	62,010 .00		27.36	
华泰证券	202304 100000 1019	华夏银 行	2023年 4月10 日	249,240. 00	46,500	14	1.70	164.78		-	-	
华泰证券	202304 240005 8791	华夏银 行	2023年 4月24 日	266,445. 00	46,500	14	1.70	176.12		-	-	
华泰证券	202305 080004 8555	华夏银 行	2023年 5月8日	292,950. 00	46,500	14	1.70	193.62		-	-	
华泰证券	202304 260000 1522	华夏银 行	2023年 4月26 日	89,745.0 0	15,500	28	1.70	118.72		-	-	
华泰证券	202305 220004 3860	华夏银 行	2023年 5月22 日	280,395. 00	46,500	14	1.70	185.36		-	-	
华泰证券	202306 050002 0276	华夏银 行	2023年 6月5日	271,095. 00	46,500	14	1.70	179.20		-	-	
华泰证券	202305 240001 9280	华夏银 行	2023年 5月24 日	89,125.0 0	15,500	28	1.70	117.88		-	-	
华泰证券	202306 190002 0033	华夏银 行	2023年 6月19 日	271,095. 00	46,500	14	1.70	140.80	251,56 5.00		140.80	
华泰证券	202306 210001 7492	华夏银 行	2023年 6月21 日	83,390.0 0	15,500	28	1.70	35.46	83,855 .00		35.46	
华泰证券	202304	冀东水	2023年	245,430.	27,000	14	1.70	162.26		-	-	

	100000 0980	泥	4月10日	00							
华泰证券	202304 240006 1481	冀东水泥	2023年 4月24日	234,360.00	27,000	14	1.70	154.98	-	-	
华泰证券	202305 080004 4741	冀东水泥	2023年 5月8日	239,760.00	27,000	14	1.70	158.48	-	-	
华泰证券	202304 260000 1469	冀东水泥	2023年 4月26日	70,920.00	9,000	28	1.70	93.80	-	-	
华泰证券	202305 220004 2386	冀东水泥	2023年 5月22日	213,300.00	27,000	14	1.70	140.98	-	-	
华泰证券	202306 050002 0049	冀东水泥	2023年 6月5日	211,140.00	27,000	14	1.70	139.58	-	-	
华泰证券	202305 240002 2932	冀东水泥	2023年 5月24日	68,580.00	9,000	28	1.70	90.72	-	-	
华泰证券	202306 190001 7872	冀东水泥	2023年 6月19日	206,550.00	27,000	14	1.70	107.25	198,990.00	107.25	
华泰证券	202306 210001 6575	冀东水泥	2023年 6月21日	66,780.00	9,000	28	1.70	28.35	66,330.00	28.35	
华泰证券	202304 100000 1024	嘉化能源	2023年 4月10日	261,630.00	28,500	14	1.70	172.90	-	-	
华泰证券	202304 240006 1055	嘉化能源	2023年 4月24日	271,890.00	28,500	14	1.70	179.76	-	-	
华泰证券	202305 080002 3417	嘉化能源	2023年 5月8日	283,290.00	28,500	14	1.70	187.32	-	-	
华泰证券	202304 260000 1552	嘉化能源	2023年 4月26日	92,245.00	9,500	28	1.70	122.08	-	-	
华泰证券	202305 220005 4266	嘉化能源	2023年 5月22日	266,190.00	28,500	14	1.70	175.98	-	-	
华泰证券	202306 050002 7054	嘉化能源	2023年 6月5日	260,490.00	28,500	14	1.70	172.20	-	-	

华泰证券	202305 240001 4964	嘉化能源	2023年 5月24 日	91,200.0 0	9,500	28	1.70	120.68	-	-
华泰证券	202306 190002 2792	嘉化能源	2023年 6月19 日	252,225. 00	28,500	14	1.70	131.01	268,47 0.00	131.01
华泰证券	202306 210001 2841	嘉化能源	2023年 6月21 日	83,790.0 0	9,500	28	1.70	35.64	89,490 .00	35.64
华泰证券	202304 100000 1012	建设银行	2023年 4月10 日	263,175. 00	43,500	14	1.70	174.02	-	-
华泰证券	202304 240006 1053	建设银行	2023年 4月24 日	273,180. 00	43,500	14	1.70	180.60	-	-
华泰证券	202305 080002 5837	建设银行	2023年 5月8日	305,805. 00	43,500	14	1.70	202.16	-	-
华泰证券	202304 260000 1520	建设银行	2023年 4月26 日	92,075.0 0	14,500	28	1.70	121.80	-	-
华泰证券	202305 220004 3006	建设银行	2023年 5月22 日	291,015. 00	43,500	14	1.70	192.36	-	-
华泰证券	202306 050001 8906	建设银行	2023年 6月5日	282,315. 00	43,500	14	1.70	186.62	-	-
华泰证券	202305 240002 5110	建设银行	2023年 5月24 日	91,350.0 0	14,500	28	1.70	120.68	-	-
华泰证券	202306 190002 1294	建设银行	2023年 6月19 日	271,005. 00	43,500	14	1.70	140.80	272,31 0.00	140.80
华泰证券	202306 210001 7452	建设银行	2023年 6月21 日	90,190.0 0	14,500	28	1.70	38.34	90,770 .00	38.34
华泰证券	202304 100000 1041	江苏金租	2023年 4月10 日	277,605. 00	46,500	14	1.70	183.54	-	-
华泰证券	202304 240005 0481	江苏金租	2023年 4月24 日	300,390. 00	46,500	14	1.70	198.66	-	-
华泰证券	202305 080002	江苏金租	2023年 5月8日	317,130. 00	46,500	14	1.70	209.72	-	-

	0615											
华泰证券	202304 260000 1500	江苏金租	2023年 4月26 日	98,735.0 0	15,500	28	1.70	130.48			-	-
华泰证券	202305 220004 7244	江苏金租	2023年 5月22 日	296,205. 00	46,500	14	1.70	195.86			-	-
华泰证券	202306 050002 8152	江苏金租	2023年 6月5日	294,345. 00	46,500	14	1.70	194.60			-	-
华泰证券	202305 240002 5096	江苏金租	2023年 5月24 日	96,410.0 0	15,500	28	1.70	127.40			-	-
华泰证券	202306 190002 3351	江苏金租	2023年 6月19 日	286,905. 00	46,500	14	1.70	149.05	192,04 5.00		149.05	
华泰证券	202306 300000 1498	江苏金租	2023年 6月30 日	103,250. 00	25,000	14	3.20		103,25 0.00			-
华泰证券	202306 210001 7294	江苏金租	2023年 6月21 日	95,480.0 0	15,500	28	1.70	40.59	64,015 .00		40.59	
华泰证券	202304 100000 1010	交通银行	2023年 4月10 日	341,880. 00	66,000	14	1.70	225.96			-	-
华泰证券	202304 240006 3141	交通银行	2023年 4月24 日	363,660. 00	66,000	14	1.70	240.38			-	-
华泰证券	202305 080001 3211	交通银行	2023年 5月8日	417,120. 00	66,000	14	1.70	275.80			-	-
华泰证券	202304 260000 1524	交通银行	2023年 4月26 日	122,100. 00	22,000	28	1.70	161.56			-	-
华泰证券	202305 220004 7246	交通银行	2023年 5月22 日	384,120. 00	66,000	14	1.70	253.96			-	-
华泰证券	202306 050002 9405	交通银行	2023年 6月5日	387,420. 00	66,000	14	1.70	256.06			-	-
华泰证券	202305 240001 9282	交通银行	2023年 5月24 日	123,200. 00	22,000	28	1.70	162.96			-	-
华泰证券	202306	交通银	2023年	377,520.	66,000	14	1.70	196.13	382,80		196.13	



	190002 4655	行	6月19日	00						0.00	
华泰证券	202306 210001 8395	交通银行	2023年 6月21日	126,280.00	22,000	28	1.70	53.64	127,600.00	53.64	
华泰证券	202304 100000 0976	鲁西化工	2023年 4月10日	332,520.00	25,500	14	1.70	219.80			
华泰证券	202304 240003 2113	鲁西化工	2023年 4月24日	301,155.00	25,500	14	1.70	199.08			
华泰证券	202305 080002 7763	鲁西化工	2023年 5月8日	286,620.00	25,500	14	1.70	189.42			
华泰证券	202304 260000 1467	鲁西化工	2023年 4月26日	98,940.00	8,500	28	1.70	130.76			
华泰证券	202305 220005 3032	鲁西化工	2023年 5月22日	277,950.00	25,500	14	1.70	183.82			
华泰证券	202305 300001 6790	鲁西化工	2023年 5月30日	35,310.00	3,300	7	1.80	12.39			
华泰证券	202305 290000 1243	鲁西化工	2023年 5月29日	412,720.00	38,500	14	1.80	288.96			
华泰证券	202305 290000 1245	鲁西化工	2023年 5月29日	1,232,800.00	115,000	14	1.80	862.96			
华泰证券	202306 060001 7563	鲁西化工	2023年 6月6日	35,013.00	3,300	7	1.80	12.25			
华泰证券	202306 050002 0270	鲁西化工	2023年 6月5日	278,460.00	25,500	14	1.70	184.10			
华泰证券	202306 130002 2068	鲁西化工	2023年 6月13日	34,617.00	3,300	7	1.80	12.11			
华泰证券	202305 240002 2930	鲁西化工	2023年 5月24日	90,780.00	8,500	28	1.70	120.12			
华泰证券	202306 120002 2435	鲁西化工	2023年 6月12日	1,209,800.00	115,000	14	1.80	846.86			

华泰证券	202306 200000 9167	鲁西化 工	2023 年 6 月 20 日	34,221.0 0	3,300	7	1.80	11.97	-	-
华泰证券	202306 190002 2993	鲁西化 工	2023 年 6 月 19 日	266,220. 00	25,500	14	1.70	138.27	269,28 0.00	138.27
华泰证券	202306 270002 1538	鲁西化 工	2023 年 6 月 27 日	34,353.0 0	3,300	7	1.80	5.16	34,848 .00	5.16
华泰证券	202306 260005 0560	鲁西化 工	2023 年 6 月 26 日	1,152,30 0.00	115,000	14	1.80	230.48	1,214, 400.00	230.48
华泰证券	202306 210001 8177	鲁西化 工	2023 年 6 月 21 日	87,720.0 0	8,500	28	1.70	37.26	89,760 .00	37.26
华泰证券	202304 100000 1050	陆家嘴	2023 年 4 月 10 日	219,870. 00	21,000	14	1.70	145.32	-	-
华泰证券	202304 240003 9883	陆家嘴	2023 年 4 月 24 日	210,630. 00	21,000	14	1.70	139.30	-	-
华泰证券	202305 080002 3415	陆家嘴	2023 年 5 月 8 日	216,930. 00	21,000	14	1.70	143.36	-	-
华泰证券	202304 260000 1540	陆家嘴	2023 年 4 月 26 日	69,790.0 0	7,000	28	1.70	92.40	-	-
华泰证券	202305 220003 4568	陆家嘴	2023 年 5 月 22 日	214,200. 00	21,000	14	1.70	141.68	-	-
华泰证券	202306 050002 7095	陆家嘴	2023 年 6 月 5 日	218,400. 00	21,000	14	1.70	144.34	-	-
华泰证券	202305 240001 4974	陆家嘴	2023 年 5 月 24 日	70,420.0 0	7,000	28	1.70	93.24	-	-
华泰证券	202306 190001 8308	陆家嘴	2023 年 6 月 19 日	211,050. 00	21,000	14	1.70	109.67	207,27 0.00	109.67
华泰证券	202306 210001 6793	陆家嘴	2023 年 6 月 21 日	68,810.0 0	7,000	28	1.70	29.25	69,090 .00	29.25
华泰证券	202304 100000	南京高 科	2023 年 4 月 10 日	224,400. 00	33,000	14	1.70	148.40	-	-

	1018		日									
华泰证券	202304 240005 0909	南京高科	2023年 4月24 日	221,100. 00	33,000	14	1.70	146.16			-	-
华泰证券	202305 080001 5863	南京高科	2023年 5月8日	236,940. 00	33,000	14	1.70	156.66			-	-
华泰证券	202304 260000 1534	南京高科	2023年 4月26 日	73,150.0 0	11,000	28	1.70	96.60			-	-
华泰证券	202305 220005 6252	南京高科	2023年 5月22 日	225,720. 00	33,000	14	1.70	149.24			-	-
华泰证券	202306 050002 0348	南京高科	2023年 6月5日	221,430. 00	33,000	14	1.70	146.44			-	-
华泰证券	202305 240001 4968	南京高科	2023年 5月24 日	72,490.0 0	11,000	28	1.70	95.76			-	-
华泰证券	202306 190002 2617	南京高科	2023年 6月19 日	218,130. 00	33,000	14	1.70	113.30	218,13 0.00		113.30	
华泰证券	202306 210001 5305	南京高科	2023年 6月21 日	71,830.0 0	11,000	28	1.70	30.51	72,710 .00		30.51	
华泰证券	202304 100000 1006	南京银行	2023年 4月10 日	163,800. 00	18,000	14	1.70	108.36			-	-
华泰证券	202304 240002 3153	南京银行	2023年 4月24 日	165,240. 00	18,000	14	1.70	109.20			-	-
华泰证券	202305 080003 8911	南京银行	2023年 5月8日	172,800. 00	18,000	14	1.70	114.24			-	-
华泰证券	202304 260000 1480	南京银行	2023年 4月26 日	55,020.0 0	6,000	28	1.70	72.80			-	-
华泰证券	202305 220003 8230	南京银行	2023年 5月22 日	162,720. 00	18,000	14	1.70	107.52			-	-
华泰证券	202306 050002 9604	南京银行	2023年 6月5日	153,720. 00	18,000	14	1.70	101.64			-	-
华泰证券	202305	南京银	2023年	53,340.0	6,000	28	1.70	70.56			-	-

	240002 2926	行	5月24 日	0							
华泰证券	202306 190002 1714	南京银 行	2023年 6月19 日	155,700. 00	18,000	14	1.70	80.85	144,00 0.00	80.85	
华泰证券	202306 210001 7936	南京银 行	2023年 6月21 日	47,880.0 0	6,000	28	1.70	20.34	48,000 .00	20.34	
华泰证券	202304 100000 1044	宁夏建 材	2023年 4月10 日	256,905. 00	16,500	14	1.70	169.82			
华泰证券	202304 240003 6969	宁夏建 材	2023年 4月24 日	263,670. 00	16,500	14	1.70	174.30			
华泰证券	202305 080005 6285	宁夏建 材	2023年 5月8日	256,905. 00	16,500	14	1.70	169.82			
华泰证券	202304 260000 1536	宁夏建 材	2023年 4月26 日	85,085.0 0	5,500	28	1.70	112.56			
华泰证券	202305 220005 6254	宁夏建 材	2023年 5月22 日	242,055. 00	16,500	14	1.70	160.02			
华泰证券	202305 300001 6780	宁夏建 材	2023年 5月30 日	39,390.0 0	2,600	7	1.80	13.79			
华泰证券	202305 290000 1273	宁夏建 材	2023年 5月29 日	430,920. 00	28,000	14	1.80	301.70			
华泰证券	202305 290000 1278	宁夏建 材	2023年 5月29 日	2,708,64 0.00	176,000	14	1.80	1,896. 02			
华泰证券	202306 060001 4357	宁夏建 材	2023年 6月6日	39,572.0 0	2,600	7	1.80	13.86			
华泰证券	202306 050002 9131	宁夏建 材	2023年 6月5日	259,875. 00	16,500	14	1.70	171.78			
华泰证券	202306 130001 8320	宁夏建 材	2023年 6月13 日	44,746.0 0	2,600	7	1.80	15.68			
华泰证券	202305 240001 4970	宁夏建 材	2023年 5月24 日	79,365.0 0	5,500	28	1.70	105.00			

华泰证券	202306 120002 2453	宁夏建 材	2023 年 6 月 12 日	2,988,48 0.00	176,000	14	1.80	2,091. 88	-	-
华泰证券	202306 200000 9179	宁夏建 材	2023 年 6 月 20 日	42,874.0 0	2,600	7	1.80	14.98	-	-
华泰证券	202306 190002 2367	宁夏建 材	2023 年 6 月 19 日	275,880. 00	16,500	14	1.70	143.33	256,74 0.00	143.33
华泰证券	202306 270002 1365	宁夏建 材	2023 年 6 月 27 日	41,782.0 0	2,600	7	1.80	6.27	40,456 .00	6.27
华泰证券	202306 260005 1646	宁夏建 材	2023 年 6 月 26 日	2,816,00 0.00	176,000	14	1.80	563.20	2,738, 560.00	563.20
华泰证券	202306 210001 7028	宁夏建 材	2023 年 6 月 21 日	89,375.0 0	5,500	28	1.70	37.98	85,580 .00	37.98
华泰证券	202304 100000 0998	农业银 行	2023 年 4 月 10 日	309,075. 00	97,500	14	1.70	204.40	-	-
华泰证券	202304 240005 3579	农业银 行	2023 年 4 月 24 日	327,600. 00	97,500	14	1.70	216.58	-	-
华泰证券	202305 080003 7945	农业银 行	2023 年 5 月 8 日	379,275. 00	97,500	14	1.70	250.74	-	-
华泰证券	202304 260000 1490	农业银 行	2023 年 4 月 26 日	110,175. 00	32,500	28	1.70	145.60	-	-
华泰证券	202305 220005 9948	农业银 行	2023 年 5 月 22 日	351,975. 00	97,500	14	1.70	232.68	-	-
华泰证券	202306 050002 7921	农业银 行	2023 年 6 月 5 日	347,100. 00	97,500	14	1.70	229.46	-	-
华泰证券	202305 240002 2934	农业银 行	2023 年 5 月 24 日	110,825. 00	32,500	28	1.70	146.44	-	-
华泰证券	202306 190002 2783	农业银 行	2023 年 6 月 19 日	343,200. 00	97,500	14	1.70	178.31	344,17 5.00	178.31
华泰证券	202306 210001	农业银 行	2023 年 6 月 21 日	114,725. 00	32,500	28	1.70	48.78	114,72 5.00	48.78

	7630		日									
华泰证券	202304 100000 0996	厦门国 贸	2023年 4月10 日	315,750. 00	37,500	14	1.70	208.74			-	-
华泰证券	202304 240005 7895	厦门国 贸	2023年 4月24 日	340,875. 00	37,500	14	1.70	225.40			-	-
华泰证券	202305 080001 3587	厦门国 贸	2023年 5月8日	360,375. 00	37,500	14	1.70	238.28			-	-
华泰证券	202304 260000 1514	厦门国 贸	2023年 4月26 日	114,375. 00	12,500	28	1.70	151.20			-	-
华泰证券	202305 220005 1640	厦门国 贸	2023年 5月22 日	322,875. 00	37,500	14	1.70	213.50			-	-
华泰证券	202306 050002 4400	厦门国 贸	2023年 6月5日	343,125. 00	37,500	14	1.70	226.80			-	-
华泰证券	202305 240002 5100	厦门国 贸	2023年 5月24 日	109,750. 00	12,500	28	1.70	145.04			-	-
华泰证券	202306 190002 2274	厦门国 贸	2023年 6月19 日	327,000. 00	37,500	14	1.70	169.84	290,25 0.00		169.84	
华泰证券	202306 210001 8298	厦门国 贸	2023年 6月21 日	106,375. 00	12,500	28	1.70	45.18	96,750 .00		45.18	
华泰证券	202304 100000 1052	厦门象 屿	2023年 4月10 日	210,795. 00	19,500	14	1.70	139.30			-	-
华泰证券	202304 240005 5161	厦门象 屿	2023年 4月24 日	195,585. 00	19,500	14	1.70	129.36			-	-
华泰证券	202305 080003 0653	厦门象 屿	2023年 5月8日	200,070. 00	19,500	14	1.70	132.30			-	-
华泰证券	202304 260000 1528	厦门象 屿	2023年 4月26 日	67,210.0 0	6,500	28	1.70	88.76			-	-
华泰证券	202305 220003 5958	厦门象 屿	2023年 5月22 日	193,245. 00	19,500	14	1.70	127.82			-	-
华泰证券	202306	厦门象	2023年	186,810.	19,500	14	1.70	123.48			-	-

	050002 0164	屿	6月5日	00							
华泰证券	202305 240001 4956	厦门象 屿	2023年 5月24 日	63,895.0 0	6,500	28	1.70	84.56	-	-	
华泰证券	202306 190002 3594	厦门象 屿	2023年 6月19 日	172,965. 00	19,500	14	1.70	89.87	169,65 0.00	89.87	
华泰证券	202306 210001 7070	厦门象 屿	2023年 6月21 日	54,860.0 0	6,500	28	1.70	23.31	56,550 .00	23.31	
华泰证券	202304 100000 1062	山东高 速	2023年 4月10 日	325,380. 00	51,000	14	1.70	215.18	-	-	
华泰证券	202304 240003 9117	山东高 速	2023年 4月24 日	345,270. 00	51,000	14	1.70	228.20	-	-	
华泰证券	202305 080002 9711	山东高 速	2023年 5月8日	397,290. 00	51,000	14	1.70	262.64	-	-	
华泰证券	202304 260000 1532	山东高 速	2023年 4月26 日	116,960. 00	17,000	28	1.70	154.56	-	-	
华泰证券	202305 220004 8374	山东高 速	2023年 5月22 日	363,630. 00	51,000	14	1.70	240.38	-	-	
华泰证券	202306 050002 3456	山东高 速	2023年 6月5日	357,510. 00	51,000	14	1.70	236.32	-	-	
华泰证券	202305 240001 4960	山东高 速	2023年 5月24 日	118,320. 00	17,000	28	1.70	156.52	-	-	
华泰证券	202306 190002 4789	山东高 速	2023年 6月19 日	319,260. 00	51,000	14	1.70	165.88	324,87 0.00	165.88	
华泰证券	202306 210001 5514	山东高 速	2023年 6月21 日	105,400. 00	17,000	28	1.70	44.82	108,29 0.00	44.82	
华泰证券	202304 100000 1060	上海建 工	2023年 4月10 日	201,390. 00	73,500	14	1.70	133.14	-	-	
华泰证券	202304 240003 7845	上海建 工	2023年 4月24 日	207,270. 00	73,500	14	1.70	137.06	-	-	

华泰证券	2023050800023827	上海建工	2023年5月8日	217,560.00	73,500	14	1.70	143.78	-	-
华泰证券	2023042600001556	上海建工	2023年4月26日	68,600.00	24,500	28	1.70	90.72	-	-
华泰证券	2023052200050860	上海建工	2023年5月22日	192,570.00	73,500	14	1.70	127.26	-	-
华泰证券	2023060500023849	上海建工	2023年6月5日	194,775.00	73,500	14	1.70	128.80	-	-
华泰证券	2023052400014962	上海建工	2023年5月24日	63,210.00	24,500	28	1.70	83.44	-	-
华泰证券	2023061900023806	上海建工	2023年6月19日	195,510.00	73,500	14	1.70	101.53	197,715.00	101.53
华泰证券	2023062100016836	上海建工	2023年6月21日	63,945.00	24,500	28	1.70	27.18	65,905.00	27.18
华泰证券	2023041000001027	神马股份	2023年4月10日	258,390.00	33,000	14	1.70	170.80	-	-
华泰证券	2023042400034723	神马股份	2023年4月24日	246,180.00	33,000	14	1.70	162.82	-	-
华泰证券	2023050800025541	神马股份	2023年5月8日	247,500.00	33,000	14	1.70	163.66	-	-
华泰证券	2023042600001486	神马股份	2023年4月26日	82,060.00	11,000	28	1.70	108.64	-	-
华泰证券	2023052200033312	神马股份	2023年5月22日	240,900.00	33,000	14	1.70	159.32	-	-
华泰证券	2023060500025397	神马股份	2023年6月5日	229,350.00	33,000	14	1.70	151.62	-	-
华泰证券	2023052400022958	神马股份	2023年5月24日	79,530.00	11,000	28	1.70	105.28	-	-
华泰证券	202306190001	神马股份	2023年6月19日	222,420.00	33,000	14	1.70	115.50	234,630.00	115.50



	9809		日								
华泰证券	202306 210001 6753	神马股 份	2023年 6月21 日	73,590.0 0	11,000	28	1.70	31.32	78,210 .00	31.32	
华泰证券	202304 100000 0984	万年青	2023年 4月10 日	267,900. 00	30,000	14	1.70	177.10	-	-	
华泰证券	202304 240003 9115	万年青	2023年 4月24 日	259,800. 00	30,000	14	1.70	171.78	-	-	
华泰证券	202305 080002 7761	万年青	2023年 5月8日	266,400. 00	30,000	14	1.70	176.12	-	-	
华泰证券	202304 260000 1476	万年青	2023年 4月26 日	86,000.0 0	10,000	28	1.70	113.68	-	-	
华泰证券	202305 220003 4338	万年青	2023年 5月22 日	251,400. 00	30,000	14	1.70	166.18	-	-	
华泰证券	202306 050002 9085	万年青	2023年 6月5日	240,000. 00	30,000	14	1.70	158.62	-	-	
华泰证券	202305 240002 2946	万年青	2023年 5月24 日	81,900.0 0	10,000	28	1.70	108.36	-	-	
华泰证券	202306 190002 0361	万年青	2023年 6月19 日	234,000. 00	30,000	14	1.70	121.55	232,50 0.00	121.55	
华泰证券	202306 210001 6837	万年青	2023年 6月21 日	76,200.0 0	10,000	28	1.70	32.40	77,500 .00	32.40	
华泰证券	202304 100000 0978	威孚高 科	2023年 4月10 日	323,235. 00	16,500	14	1.70	213.64	-	-	
华泰证券	202304 240005 3003	威孚高 科	2023年 4月24 日	290,730. 00	16,500	14	1.70	192.22	-	-	
华泰证券	202305 080001 3837	威孚高 科	2023年 5月8日	273,735. 00	16,500	14	1.70	181.02	-	-	
华泰证券	202304 260000 1468	威孚高 科	2023年 4月26 日	95,150.0 0	5,500	28	1.70	125.72	-	-	
华泰证券	202305	威孚高	2023年	263,175.	16,500	14	1.70	174.02	-	-	

	2200057998	科	5月22日	00							
华泰证券	2023060500026769	威孚高科	2023年6月5日	251,130.00	16,500	14	1.70	166.04	-	-	
华泰证券	2023052400022922	威孚高科	2023年5月24日	85,855.00	5,500	28	1.70	113.40	-	-	
华泰证券	2023061900024005	威孚高科	2023年6月19日	257,895.00	16,500	14	1.70	133.98	259,875.00	133.98	
华泰证券	2023062100017025	威孚高科	2023年6月21日	85,360.00	5,500	28	1.70	36.27	86,625.00	36.27	
华泰证券	2023041000000972	伟星股份	2023年4月10日	180,570.00	19,500	14	1.70	119.42	-	-	
华泰证券	2023042400050905	伟星股份	2023年4月24日	175,890.00	19,500	14	1.70	116.34	-	-	
华泰证券	2023050800018533	伟星股份	2023年5月8日	176,280.00	19,500	14	1.70	116.48	-	-	
华泰证券	2023042600001464	伟星股份	2023年4月26日	59,930.00	6,500	28	1.70	79.24	-	-	
华泰证券	2023052200053428	伟星股份	2023年5月22日	180,375.00	19,500	14	1.70	119.28	-	-	
华泰证券	2023060500025588	伟星股份	2023年6月5日	174,525.00	19,500	14	1.70	115.36	-	-	
华泰证券	2023052400022924	伟星股份	2023年5月24日	59,670.00	6,500	28	1.70	78.96	-	-	
华泰证券	2023061900020982	伟星股份	2023年6月19日	180,765.00	19,500	14	1.70	93.94	182,520.00	93.94	
华泰证券	2023062100017770	伟星股份	2023年6月21日	59,800.00	6,500	28	1.70	25.38	60,840.00	25.38	
华泰证券	2023041000001021	新钢股份	2023年4月10日	287,730.00	69,000	14	1.70	190.26	-	-	

华泰证券	2023042400050081	新钢股份	2023年4月24日	276,690.00	69,000	14	1.70	182.98	-	-
华泰证券	2023050800013423	新钢股份	2023年5月8日	280,830.00	69,000	14	1.70	185.64	-	-
华泰证券	2023042600001484	新钢股份	2023年4月26日	90,390.00	23,000	28	1.70	119.56	-	-
华泰证券	2023052200049612	新钢股份	2023年5月22日	267,030.00	69,000	14	1.70	176.54	-	-
华泰证券	2023060500027465	新钢股份	2023年6月5日	265,650.00	69,000	14	1.70	175.56	-	-
华泰证券	2023052400022968	新钢股份	2023年5月24日	85,330.00	23,000	28	1.70	112.84	-	-
华泰证券	2023061900024618	新钢股份	2023年6月19日	265,650.00	69,000	14	1.70	137.94	255,990.00	137.94
华泰证券	2023062100015798	新钢股份	2023年6月21日	87,170.00	23,000	28	1.70	37.08	85,330.00	37.08
华泰证券	2023041000001013	兴业银行	2023年4月10日	179,025.00	10,500	14	1.70	118.30	-	-
华泰证券	2023042400058181	兴业银行	2023年4月24日	177,765.00	10,500	14	1.70	117.46	-	-
华泰证券	2023050800038913	兴业银行	2023年5月8日	185,115.00	10,500	14	1.70	122.36	-	-
华泰证券	2023042600001482	兴业银行	2023年4月26日	60,375.00	3,500	28	1.70	79.80	-	-
华泰证券	2023052200048674	兴业银行	2023年5月22日	179,340.00	10,500	14	1.70	118.58	-	-
华泰证券	2023060500028659	兴业银行	2023年6月5日	175,665.00	10,500	14	1.70	116.20	-	-
华泰证券	202305240002	兴业银行	2023年5月24日	58,520.00	3,500	28	1.70	77.28	-	-

	2928		日								
华泰证券	202306 190002 0242	兴业银行	2023年 6月19 日	165,795. 00	10,500	14	1.70	86.13	164,32 5.00	86.13	
华泰证券	202306 210001 6146	兴业银行	2023年 6月21 日	55,195.0 0	3,500	28	1.70	23.49	54,775 .00	23.49	
华泰证券	202304 100000 1034	雅戈尔	2023年 4月10 日	312,960. 00	48,000	14	1.70	206.92	-	-	
华泰证券	202304 240003 9541	雅戈尔	2023年 4月24 日	320,640. 00	48,000	14	1.70	211.96	-	-	
华泰证券	202305 080002 5835	雅戈尔	2023年 5月8日	337,440. 00	48,000	14	1.70	223.02	-	-	
华泰证券	202304 260000 1526	雅戈尔	2023年 4月26 日	106,880. 00	16,000	28	1.70	141.40	-	-	
华泰证券	202305 220004 3666	雅戈尔	2023年 5月22 日	332,160. 00	48,000	14	1.70	219.66	-	-	
华泰证券	202306 050002 8449	雅戈尔	2023年 6月5日	332,640. 00	48,000	14	1.70	219.94	-	-	
华泰证券	202305 240002 2960	雅戈尔	2023年 5月24 日	108,480. 00	16,000	28	1.70	143.36	-	-	
华泰证券	202306 190002 0245	雅戈尔	2023年 6月19 日	305,280. 00	48,000	14	1.70	158.62	302,88 0.00	158.62	
华泰证券	202306 210001 7728	雅戈尔	2023年 6月21 日	101,120. 00	16,000	28	1.70	43.02	100,96 0.00	43.02	
华泰证券	202304 100000 1030	兖矿能源	2023年 4月10 日	201,060. 00	6,000	14	1.70	132.86	-	-	
华泰证券	202304 240001 9519	兖矿能源	2023年 4月24 日	202,080. 00	6,000	14	1.70	133.56	-	-	
华泰证券	202305 080005 6287	兖矿能源	2023年 5月8日	211,200. 00	6,000	14	1.70	139.58	-	-	
华泰证券	202304	兖矿能源	2023年	68,160.0	2,000	28	1.70	90.16	-	-	

	260000 1554	源	4月26 日	0							
华泰证券	202305 220003 6362	充矿能 源	2023年 5月22 日	207,600. 00	6,000	14	1.70	137.20	-	-	
华泰证券	202306 050002 3758	充矿能 源	2023年 6月5日	167,220. 00	6,000	14	1.70	110.60	-	-	
华泰证券	202305 240001 4966	充矿能 源	2023年 5月24 日	67,040.0 0	2,000	28	1.70	88.76	-	-	
华泰证券	202306 190002 1602	充矿能 源	2023年 6月19 日	172,740. 00	6,000	14	1.70	89.76	179,52 0.00	89.76	
华泰证券	202306 210001 8425	充矿能 源	2023年 6月21 日	56,540.0 0	2,000	28	1.70	24.03	59,840 .00	24.03	
华泰证券	202304 100000 1038	邮储银 行	2023年 4月10 日	203,580. 00	43,500	14	1.70	134.54	-	-	
华泰证券	202304 240002 3641	邮储银 行	2023年 4月24 日	233,160. 00	43,500	14	1.70	154.14	-	-	
华泰证券	202305 080001 8535	邮储银 行	2023年 5月8日	257,955. 00	43,500	14	1.70	170.52	-	-	
华泰证券	202304 260000 1550	邮储银 行	2023年 4月26 日	79,170.0 0	14,500	28	1.70	104.72	-	-	
华泰证券	202305 220005 5676	邮储银 行	2023年 5月22 日	237,945. 00	43,500	14	1.70	157.36	-	-	
华泰证券	202306 050002 5277	邮储银 行	2023年 6月5日	228,810. 00	43,500	14	1.70	151.20	-	-	
华泰证券	202305 240001 4984	邮储银 行	2023年 5月24 日	75,110.0 0	14,500	28	1.70	99.40	-	-	
华泰证券	202306 190002 4811	邮储银 行	2023年 6月19 日	220,110. 00	43,500	14	1.70	114.29	212,71 5.00	114.29	
华泰证券	202306 210001 7814	邮储银 行	2023年 6月21 日	72,355.0 0	14,500	28	1.70	30.78	70,905 .00	30.78	

华泰证券	202304100000999	渝农商行	2023年4月10日	263,520.00	72,000	14	1.70	174.16	-	-
华泰证券	2023042400037847	渝农商行	2023年4月24日	271,440.00	72,000	14	1.70	179.48	-	-
华泰证券	2023050800014235	渝农商行	2023年5月8日	310,320.00	72,000	14	1.70	205.10	-	-
华泰证券	2023042600001498	渝农商行	2023年4月26日	91,440.00	24,000	28	1.70	120.96	-	-
华泰证券	2023052200058584	渝农商行	2023年5月22日	297,360.00	72,000	14	1.70	196.56	-	-
华泰证券	2023060500023653	渝农商行	2023年6月5日	282,960.00	72,000	14	1.70	187.04	-	-
华泰证券	2023052400022938	渝农商行	2023年5月24日	94,560.00	24,000	28	1.70	125.16	-	-
华泰证券	2023061900018430	渝农商行	2023年6月19日	277,920.00	72,000	14	1.70	144.32	258,480.00	144.32
华泰证券	2023062100018398	渝农商行	2023年6月21日	92,160.00	24,000	28	1.70	39.15	86,160.00	39.15
华泰证券	2023041000001036	长江传媒	2023年4月10日	324,720.00	49,500	14	1.70	214.62	-	-
华泰证券	2023042400039879	长江传媒	2023年4月24日	382,635.00	49,500	14	1.70	252.98	-	-
华泰证券	2023050800032797	长江传媒	2023年5月8日	628,155.00	49,500	14	1.70	415.24	-	-
华泰证券	2023042600001496	长江传媒	2023年4月26日	130,020.00	16,500	28	1.70	171.92	-	-
华泰证券	2023052200058586	长江传媒	2023年5月22日	466,290.00	49,500	14	1.70	308.28	-	-
华泰证券	202306050002	长江传媒	2023年6月5日	502,920.00	49,500	14	1.70	332.50	-	-

	8270										
华泰证券	202305 240002 5098	长江传 媒	2023年 5月24 日	153,615. 00	16,500	28	1.70	203.00	-	-	
华泰证券	202306 190002 2797	长江传 媒	2023年 6月19 日	462,330. 00	49,500	14	1.70	240.13	425,70 0.00	240.13	
华泰证券	202306 210001 7888	长江传 媒	2023年 6月21 日	145,035. 00	16,500	28	1.70	61.65	141,90 0.00	61.65	
华泰证券	202304 100000 1016	长沙银 行	2023年 4月10 日	194,055. 00	25,500	14	1.70	128.24	-	-	
华泰证券	202304 240003 8199	长沙银 行	2023年 4月24 日	204,255. 00	25,500	14	1.70	135.10	-	-	
华泰证券	202305 080003 1979	长沙银 行	2023年 5月8日	218,025. 00	25,500	14	1.70	144.20	-	-	
华泰证券	202304 260000 1538	长沙银 行	2023年 4月26 日	69,105.0 0	8,500	28	1.70	91.28	-	-	
华泰证券	202305 220005 9032	长沙银 行	2023年 5月22 日	216,750. 00	25,500	14	1.70	143.36	-	-	
华泰证券	202306 050002 6027	长沙银 行	2023年 6月5日	207,570. 00	25,500	14	1.70	137.20	-	-	
华泰证券	202305 240001 4972	长沙银 行	2023年 5月24 日	68,935.0 0	8,500	28	1.70	91.28	-	-	
华泰证券	202306 190002 2475	长沙银 行	2023年 6月19 日	200,430. 00	25,500	14	1.70	104.06	197,88 0.00	104.06	
华泰证券	202306 210001 8455	长沙银 行	2023年 6月21 日	65,705.0 0	8,500	28	1.70	27.90	65,960 .00	27.90	
华泰证券	202304 100000 1040	中国建 筑	2023年 4月10 日	203,610. 00	33,000	14	1.70	134.54	-	-	
华泰证券	202304 240002 7549	中国建 筑	2023年 4月24 日	205,920. 00	33,000	14	1.70	136.08	-	-	
华泰证券	202305	中国建	2023年	233,640.	33,000	14	1.70	154.42	-	-	

	080002 9713	筑	5月8日	00							
华泰证券	202304 260000 1542	中国建 筑	2023年 4月26 日	67,430.0 0	11,000	28	1.70	89.04	-	-	
华泰证券	202305 220005 6542	中国建 筑	2023年 5月22 日	203,280. 00	33,000	14	1.70	134.40	-	-	
华泰证券	202306 050002 6951	中国建 筑	2023年 6月5日	198,000. 00	33,000	14	1.70	130.90	-	-	
华泰证券	202305 240001 4976	中国建 筑	2023年 5月24 日	64,350.0 0	11,000	28	1.70	85.12	-	-	
华泰证券	202306 190002 2293	中国建 筑	2023年 6月19 日	195,030. 00	33,000	14	1.70	101.31	189,42 0.00	101.31	
华泰证券	202306 210001 8295	中国建 筑	2023年 6月21 日	64,570.0 0	11,000	28	1.70	27.45	63,140 .00	27.45	
华泰证券	202304 100000 1032	中国神 华	2023年 4月10 日	372,735. 00	13,500	14	1.70	246.40	-	-	
华泰证券	202304 240005 3029	中国神 华	2023年 4月24 日	390,285. 00	13,500	14	1.70	258.02	-	-	
华泰证券	202305 080002 9049	中国神 华	2023年 5月8日	428,355. 00	13,500	14	1.70	283.22	-	-	
华泰证券	202304 260000 1491	中国神 华	2023年 4月26 日	129,105. 00	4,500	28	1.70	170.80	-	-	
华泰证券	202305 220003 6202	中国神 华	2023年 5月22 日	416,205. 00	13,500	14	1.70	275.10	-	-	
华泰证券	202306 050002 3573	中国神 华	2023年 6月5日	385,560. 00	13,500	14	1.70	254.94	-	-	
华泰证券	202305 240002 5094	中国神 华	2023年 5月24 日	135,855. 00	4,500	28	1.70	179.76	-	-	
华泰证券	202306 190002 1877	中国神 华	2023年 6月19 日	402,570. 00	13,500	14	1.70	209.11	415,12 5.00	209.11	



华泰证券	202306 210001 8458	中国神 华	2023 年 6 月 21 日	134,145. 00	4,500	28	1.70	56.97	138,37 5.00	56.97
华泰证券	202304 100000 1046	中国石 化	2023 年 4 月 10 日	494,760. 00	84,000	14	1.70	327.04	-	-
华泰证券	202304 240005 0907	中国石 化	2023 年 4 月 24 日	530,880. 00	84,000	14	1.70	350.98	-	-
华泰证券	202305 080001 7337	中国石 化	2023 年 5 月 8 日	578,760. 00	84,000	14	1.70	382.62	-	-
华泰证券	202304 260000 1546	中国石 化	2023 年 4 月 26 日	182,280. 00	28,000	28	1.70	241.08	-	-
华泰证券	202305 220006 2560	中国石 化	2023 年 5 月 22 日	530,880. 00	84,000	14	1.70	350.98	-	-
华泰证券	202306 050002 5583	中国石 化	2023 年 6 月 5 日	551,880. 00	84,000	14	1.70	364.84	-	-
华泰证券	202305 240001 4980	中国石 化	2023 年 5 月 24 日	170,520. 00	28,000	28	1.70	225.40	-	-
华泰证券	202306 190002 2642	中国石 化	2023 年 6 月 19 日	544,320. 00	84,000	14	1.70	282.70	534,24 0.00	282.70
华泰证券	202306 210001 6529	中国石 化	2023 年 6 月 21 日	173,880. 00	28,000	28	1.70	73.89	178,08 0.00	73.89
华泰证券	202304 100000 0990	中国石 油	2023 年 4 月 10 日	271,320. 00	42,000	14	1.70	179.34	-	-
华泰证券	202304 240002 8333	中国石 油	2023 年 4 月 24 日	307,440. 00	42,000	14	1.70	203.28	-	-
华泰证券	202305 080001 5865	中国石 油	2023 年 5 月 8 日	360,360. 00	42,000	14	1.70	238.28	-	-
华泰证券	202304 260000 1506	中国石 油	2023 年 4 月 26 日	105,560. 00	14,000	28	1.70	139.44	-	-
华泰证券	202305 220003	中国石 油	2023 年 5 月 22	314,580. 00	42,000	14	1.70	208.04	-	-

	2742		日								
华泰证券	2023060500027469	中国石油	2023年6月5日	324,240.00	42,000	14	1.70	214.34	-	-	
华泰证券	2023052400022942	中国石油	2023年5月24日	101,080.00	14,000	28	1.70	133.56	-	-	
华泰证券	2023061900020048	中国石油	2023年6月19日	315,840.00	42,000	14	1.70	164.01	313,740.00	164.01	
华泰证券	2023062100017569	中国石油	2023年6月21日	105,280.00	14,000	28	1.70	44.73	104,580.00	44.73	
华泰证券	2023041000001047	中国银行	2023年4月10日	313,845.00	91,500	14	1.70	207.48	-	-	
华泰证券	2023042400059383	中国银行	2023年4月24日	331,230.00	91,500	14	1.70	218.96	-	-	
华泰证券	2023050800042713	中国银行	2023年5月8日	410,835.00	91,500	14	1.70	271.60	-	-	
华泰证券	2023042600001504	中国银行	2023年4月26日	111,630.00	30,500	28	1.70	147.56	-	-	
华泰证券	2023052200051120	中国银行	2023年5月22日	381,555.00	91,500	14	1.70	252.28	-	-	
华泰证券	2023060500025155	中国银行	2023年6月5日	364,170.00	91,500	14	1.70	240.80	-	-	
华泰证券	2023052400025106	中国银行	2023年5月24日	118,645.00	30,500	28	1.70	156.80	-	-	
华泰证券	2023061900022565	中国银行	2023年6月19日	356,850.00	91,500	14	1.70	185.35	357,765.00	185.35	
华泰证券	2023062100017818	中国银行	2023年6月21日	118,340.00	30,500	28	1.70	50.31	119,255.00	50.31	
华泰证券	2023041000000994	中南传媒	2023年4月10日	323,475.00	28,500	14	1.70	213.92	-	-	
华泰证券	202304	中南传	2023年	360,810.	28,500	14	1.70	238.56	-	-	

	240005 1151	媒	4月24 日	00							
华泰证券	202305 080001 9967	中南传 媒	2023年 5月8日	414,960. 00	28,500	14	1.70	274.40	-	-	
华泰证券	202304 260000 1508	中南传 媒	2023年 4月26 日	125,590. 00	9,500	28	1.70	166.04	-	-	
华泰证券	202305 220005 5028	中南传 媒	2023年 5月22 日	349,125. 00	28,500	14	1.70	230.86	-	-	
华泰证券	202306 050002 8829	中南传 媒	2023年 6月5日	386,460. 00	28,500	14	1.70	255.50	-	-	
华泰证券	202305 240002 5104	中南传 媒	2023年 5月24 日	117,990. 00	9,500	28	1.70	155.96	-	-	
华泰证券	202306 190001 8870	中南传 媒	2023年 6月19 日	374,490. 00	28,500	14	1.70	194.48	330,60 0.00	194.48	
华泰证券	202306 210001 7726	中南传 媒	2023年 6月21 日	117,610. 00	9,500	28	1.70	49.95	110,20 0.00	49.95	
华泰证券	202304 100000 0986	中南股 份	2023年 4月10 日	170,100. 00	63,000	14	1.70	112.42	-	-	
华泰证券	202304 240003 5763	中南股 份	2023年 4月24 日	165,060. 00	63,000	14	1.70	109.06	-	-	
华泰证券	202305 080001 7517	中南股 份	2023年 5月8日	179,550. 00	63,000	14	1.70	118.72	-	-	
华泰证券	202304 260000 1478	中南股 份	2023年 4月26 日	54,600.0 0	21,000	28	1.70	72.24	-	-	
华泰证券	202305 220005 6256	中南股 份	2023年 5月22 日	177,030. 00	63,000	14	1.70	117.04	-	-	
华泰证券	202305 300001 6778	中南股 份	2023年 5月30 日	7,952.00	2,800	7	1.80	2.80	-	-	
华泰证券	202305 290000 1239	中南股 份	2023年 5月29 日	301,350. 00	105,000	14	1.80	210.98	-	-	

华泰证券	202305 290000 1241	中南股份	2023年 5月29 日	2,003,26 0.00	698,000	14	1.80	1,402. 24	-	-
华泰证券	202306 060001 5964	中南股份	2023年 6月6日	7,896.00	2,800	7	1.80	2.73	-	-
华泰证券	202306 050001 8977	中南股份	2023年 6月5日	187,110. 00	63,000	14	1.70	123.76	-	-
华泰证券	202306 130002 1302	中南股份	2023年 6月13 日	7,868.00	2,800	7	1.80	2.73	-	-
华泰证券	202305 240002 2966	中南股份	2023年 5月24 日	56,700.0 0	21,000	28	1.70	75.04	-	-
华泰证券	202306 120002 2437	中南股份	2023年 6月12 日	1,961,38 0.00	698,000	14	1.80	1,372. 98	-	-
华泰证券	202306 200000 9169	中南股份	2023年 6月20 日	7,672.00	2,800	7	1.80	2.66	-	-
华泰证券	202306 190002 2245	中南股份	2023年 6月19 日	173,250. 00	63,000	14	1.70	89.98	175,14 0.00	89.98
华泰证券	202306 270002 0088	中南股份	2023年 6月27 日	7,756.00	2,800	7	1.80	1.17	7,784. 00	1.17
华泰证券	202306 260003 7924	中南股份	2023年 6月26 日	1,863,66 0.00	698,000	14	1.80	372.72	1,940, 440.00	372.72
华泰证券	202306 210001 7223	中南股份	2023年 6月21 日	57,960.0 0	21,000	28	1.70	24.66	58,380 .00	24.66
华泰证券	202304 100000 1026	中文传媒	2023年 4月10 日	322,320. 00	25,500	14	1.70	213.08	-	-
华泰证券	202304 240005 3581	中文传媒	2023年 4月24 日	410,805. 00	25,500	14	1.70	271.60	-	-
华泰证券	202305 080003 4905	中文传媒	2023年 5月8日	463,080. 00	25,500	14	1.70	306.18	-	-
华泰证券	202304 260000	中文传媒	2023年 4月26	148,750. 00	8,500	28	1.70	196.56	-	-

	1548		日									
华泰证券	202305 220005 0666	中文传 媒	2023年 5月22 日	389,130. 00	25,500	14	1.70	257.32		-	-	
华泰证券	202306 050002 7966	中文传 媒	2023年 6月5日	438,600. 00	25,500	14	1.70	289.94		-	-	
华泰证券	202305 240001 4982	中文传 媒	2023年 5月24 日	128,605. 00	8,500	28	1.70	169.96		-	-	
华泰证券	202306 190001 7893	中文传 媒	2023年 6月19 日	390,660. 00	25,500	14	1.70	202.95	339,66 0.00		202.95	
华泰证券	202306 210001 6278	中文传 媒	2023年 6月21 日	118,575. 00	8,500	28	1.70	50.40	113,22 0.00		50.40	
华泰证券	202304 100000 1004	中信银 行	2023年 4月10 日	267,795. 00	49,500	14	1.70	177.10		-	-	
华泰证券	202304 240003 9881	中信银 行	2023年 4月24 日	299,970. 00	49,500	14	1.70	198.38		-	-	
华泰证券	202305 080002 3413	中信银 行	2023年 5月8日	374,220. 00	49,500	14	1.70	247.38		-	-	
华泰证券	202304 260000 1494	中信银 行	2023年 4月26 日	105,270. 00	16,500	28	1.70	139.16		-	-	
华泰证券	202305 220004 2046	中信银 行	2023年 5月22 日	347,985. 00	49,500	14	1.70	230.02		-	-	
华泰证券	202306 050001 8094	中信银 行	2023年 6月5日	335,115. 00	49,500	14	1.70	221.48		-	-	
华泰证券	202305 240002 2936	中信银 行	2023年 5月24 日	107,085. 00	16,500	28	1.70	141.68		-	-	
华泰证券	202306 190002 0435	中信银 行	2023年 6月19 日	302,445. 00	49,500	14	1.70	157.08	296,01 0.00		157.08	
华泰证券	202306 210001 6838	中信银 行	2023年 6月21 日	99,330.0 0	16,500	28	1.70	42.21	98,670 .00		42.21	
上年度可比期间												

2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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：本报告期内与上年度可比期间，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	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	249,171,600.00	18.0807	68,719,400.00	21.7390
华泰证券股份有限公司	1,775,100.00	0.1288	3,382,300.00	1.0700

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国建设银行	14,334,284.91	8,241.74	2,113,933.36	2,527.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137.SH	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688469.SH	中芯集成	网下申购	40,708	231,628.52
华泰联合证券	688512.SH	慧智微	网下申购	6,019	125,917.48
华泰联合证券	688472.SH	阿特斯	网下申购	28,866	320,412.60
华泰联合证券	300804.SZ	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688429.SH	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
-	-	-	-	-	-

注：本基金上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	11.88	21.02	380	4,514.40	7,987.60	-
001324	长青	2023 年 5 月	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

	科技	月 12 日		期内							
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	20.68	25.49	116	2,398.88	2,956.84	-	
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.38	14.87	155	2,383.90	2,304.85	-	
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-	
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-	
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-	
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-	
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-	
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-	
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-	
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-	
301261	恒工	2023 年 6 月	1 个月内(含)	新股未上	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-	



	精密	月 29 日		市							
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-	
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	44.18	25.10	311	9,807.96	7,806.10	-	
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 锁定 期内	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-	
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-	
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股 锁定 期内	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股 锁定 期内	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-	
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	25.25	19.69	565	14,266.25	11,124.85	-	
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股 锁定 期内	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股 锁定 期内	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-	
301325	曼恩	2023 年 5 月	6 个月	新股 锁定	76.80	107.95	205	15,744.00	22,129.75	-	

	斯特	月 4 日		期内							
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股 锁定 期内	14.81	13.73	788	11,670.28	10,819.24	-	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股 锁定 期内	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-	
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股 锁定 期内	50.00	48.39	168	8,400.00	8,129.52	-	
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股 锁定 期内	71.88	92.60	111	7,978.68	10,278.60	-	
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股 锁定 期内	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股 锁定 期内	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股 锁定 期内	29.99	23.79	309	9,266.91	7,351.11	-	
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-	
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股 锁定 期内	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301428	世纪	2023 年 5	6 个月	新股 锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	

	恒通	月 10 日		期内							
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定 期内	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-	
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未上 市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-	
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定 期内	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-	
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股未上 市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-	
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定 期内	6.58	7.58	884	5,816.72	6,700.72	-	
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定 期内	10.36	11.84	292	3,025.12	3,457.28	-	
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定 期内	11.66	12.26	221	2,576.86	2,709.46	-	
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定 期内	25.98	24.53	96	2,494.08	2,354.88	-	
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定 期内	17.80	17.89	295	5,251.00	5,277.55	-	
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定 期内	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰	2023 年 4	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	

	股份	月 28 日		期内							
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定 期内	19.86	18.06	2,197	43,632.42	39,677.82	-	
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁定 期内	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-	
688352	顾中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定 期内	12.10	12.07	839	10,151.90	10,126.73	-	
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定 期内	23.60	64.67	333	7,858.80	21,535.11	-	
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定 期内	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-	
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定 期内	26.66	31.50	275	7,331.50	8,662.50	-	
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定 期内	37.88	29.49	2,297	87,010.36	67,738.53	-	
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定 期内	75.00	90.76	154	11,550.00	13,977.04	-	
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定 期内	5.69	5.41	4,071	23,163.99	22,024.11	-	
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定 期内	11.10	17.04	2,887	32,045.70	49,194.48	-	
688479	友车	2023 年 5 月	6 个月	新股锁定	33.99	29.49	252	8,565.48	7,431.48	-	

	科技	月 4 日		期内							
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	39.99	36.71	289	11,557.11	10,609.19	-	
688485	九州一轨	2023 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-	
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	245.56	122.11	73	12,032.44	8,914.03	-	
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	20.92	19.16	602	12,593.84	11,534.32	-	
688515	裕太微	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	92.00	162.75	1,494	137,448.00	243,148.50	-	
688522	纳睿雷达	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	46.68	51.50	1,686	78,702.48	86,829.00	-	
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	152.38	135.97	104	15,847.52	14,140.88	-	
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-	
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-	
688552	航天	2023 年 5	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	488	10,330.96	11,468.00	-	

	南湖	月 8 日		期内							
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	12.68	22.31	700	8,876.00	15,617.00	-	
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	125.80	118.03	92	11,573.60	10,858.76	-	
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 锁定 期内	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-	
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-	
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-	
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-	
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股 锁定 期内	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-	
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股 锁定 期内	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-	
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股 锁定 期内	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-	

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，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。

2、基金还可作为特定投资者，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。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、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设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 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：截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000401	冀东水泥	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	7.37	90,000	663,300
2	000581	威孚高科	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	15.75	55,000	866,250
3	000651	格力电器	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	36.51	35,000	1,277,850
4	000717	中南股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	2.78	910,800	2,532,024
5	000789	万年青	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	7.75	100,000	775,000
6	000830	鲁西化工	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	10.56	203,300	2,146,848
7	000932	华菱钢铁	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	4.77	130,000	620,100
8	002003	伟星股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	9.36	65,000	608,400
9	600015	华夏银	2023 年 7 月 3 日-2023 年	5.41	155,000	838,550

		行	7月19日			
10	600019	宝钢股份	2023年7月3日-2023年7月19日	5.62	185,000	1,039,700
11	600028	中国石化	2023年7月3日-2023年7月19日	6.36	280,000	1,780,800
12	600057	厦门象屿	2023年7月3日-2023年7月19日	8.70	65,000	565,500
13	600064	南京高科	2023年7月3日-2023年7月19日	6.61	110,000	727,100
14	600170	上海建工	2023年7月3日-2023年7月19日	2.69	245,000	659,050
15	600177	雅戈尔	2023年7月3日-2023年7月19日	6.31	160,000	1,009,600
16	600188	兖矿能源	2023年7月3日-2023年7月19日	29.92	20,000	598,400
17	600273	嘉化能源	2023年7月3日-2023年7月19日	9.42	95,000	894,900
18	600350	山东高速	2023年7月3日-2023年7月19日	6.37	170,000	1,082,900
19	600373	中文传媒	2023年7月3日-2023年7月19日	13.32	85,000	1,132,200
20	600449	宁夏建材	2023年7月3日-2023年7月19日	15.56	233,600	3,634,816
21	600502	安徽建工	2023年7月3日-2023年7月19日	5.28	125,000	660,000
22	600585	海螺水泥	2023年7月3日-2023年7月19日	23.74	25,000	593,500
23	600663	陆家嘴	2023年7月3日-2023年7月19日	9.87	70,000	690,900
24	600755	厦门国贸	2023年7月3日-2023年7月19日	7.74	125,000	967,500
25	600757	长江传媒	2023年7月3日-2023年7月19日	8.60	165,000	1,419,000
26	600782	新钢股份	2023年7月3日-2023年7月19日	3.71	230,000	853,300
27	600810	神马股份	2023年7月3日-2023年7月19日	7.11	110,000	782,100
28	600901	江苏金租	2023年7月3日-2023年7月19日	4.13	280,000	1,156,400
29	600919	江苏银行	2023年7月4日	7.35	63,000	463,050
30	600987	航民股份	2023年7月3日-2023年7月19日	8.23	85,000	699,550
31	601009	南京银	2023年7月3日-2023年	8.00	60,000	480,000



		行	7月19日			
32	601077	渝农商行	2023年7月3日-2023年7月19日	3.59	240,000	861,600
33	601088	中国神华	2023年7月3日-2023年7月19日	30.75	45,000	1,383,750
34	601098	中南传媒	2023年7月3日-2023年7月19日	11.60	95,000	1,102,000
35	601166	兴业银行	2023年7月3日-2023年7月19日	15.65	35,000	547,750
36	601288	农业银行	2023年7月3日-2023年7月19日	3.53	325,000	1,147,250
37	601328	交通银行	2023年7月3日-2023年7月19日	5.80	220,000	1,276,000
38	601398	工商银行	2023年7月3日-2023年7月19日	4.82	195,000	939,900
39	601577	长沙银行	2023年7月3日-2023年7月19日	7.76	85,000	659,600
40	601658	邮储银行	2023年7月3日-2023年7月19日	4.89	145,000	709,050
41	601668	中国建筑	2023年7月3日-2023年7月19日	5.74	110,000	631,400
42	601838	成都银行	2023年7月3日-2023年7月19日	12.21	40,000	488,400
43	601857	中国石油	2023年7月3日-2023年7月19日	7.47	140,000	1,045,800
44	601928	凤凰传媒	2023年7月3日-2023年7月19日	11.40	110,000	1,254,000
45	601939	建设银行	2023年7月3日-2023年7月19日	6.26	145,000	907,700
46	601988	中国银行	2023年7月3日-2023年7月19日	3.91	305,000	1,192,550
47	601998	中信银行	2023年7月3日-2023年7月19日	5.98	165,000	986,700
合计	-	-	-	-	7,130,700	47,352,038.00

#### 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中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2022 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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
银行存款	14,334,284.91	-	-	-	-	-	14,334,284.91
结算备付金	1,172,740.53	-	-	-	-	-	1,172,740.53
存出保证金	84,696.76	-	-	-	-	-	84,696.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,243,114,329.84	1,243,114,329.84
应收股利	-	-	-	-	-	518,432.10	518,432.10
其他资产	-	-	-	-	-	22,015.09	22,015.09
资产总计	15,591,722.20	-	-	-	-	-1,243,654,777.03	1,259,246,499.23
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	505,609.43	505,609.43
应付托管费	-	-	-	-	-	101,121.90	101,121.90
应付清算款	-	-	-	-	-	2,973,278.11	2,973,278.11
其他负债	-	-	-	-	-	1,063,569.74	1,063,569.74
负债总计	-	-	-	-	-	4,643,579.18	4,643,579.18
利率敏感度缺口	15,591,722.20	-	-	-	-	-1,239,011,197.85	1,254,602,920.05
上年度末 2022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							
银行存款	2,001,225.83	-	-	-	-	-	2,001,225.83
结算备付金	25,399.62	-	-	-	-	-	25,399.62
存出保证金	14,725.29	-	-	-	-	-	14,725.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	256,687,516.46	256,687,516.46
应收清算款	-	-	-	-	-	93,578.45	93,578.45
资产总计	2,041,350.74	-	-	-	-	256,781,094.91	258,822,445.65
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	108,885.95	108,885.95
应付托管费	-	-	-	-	-	21,777.20	21,777.20
其他负债	-	-	-	-	-	417,149.94	417,149.94
负债总计	-	-	-	-	-	547,813.09	547,813.09
利率敏感度缺口	2,041,350.74	-	-	-	-	256,233,281.82	258,274,632.56

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 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(2022 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,243,114,329.84	99.08	256,687,516.46	99.39
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	-	-	-	-
合计	1,243,114,329.84	99.08	256,687,516.46	99.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证红利低波动指数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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月 31日）
	中证红利低波动指 数上升5%	60,624,015.67	12,668,939.97
	中证红利低波动指 数下降5%	-60,624,015.67	-12,668,939.97

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,241,104,480.47	256,503,230.88
第二层次	726,804.90	-
第三层次	1,283,044.47	184,285.58
合计	1,243,114,329.84	256,687,516.46

#### 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 2023 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,243,114,329.84	98.72
	其中：股票	1,243,114,329.84	98.72
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	15,507,025.44	1.23
8	其他各项资产	625,143.95	0.05
9	合计	1,259,246,499.23	100.00

注：1. 上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

2. 报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 47,352,038.00 元，占

本基金期末资产净值的 3.77%。其中，报告期内本基金与关联方进行转融通证券出借业务的证券 157,163.00 手，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 22,803,358.90 元。

## 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	-	-
B	采矿业	159,971,754.20	12.75
C	制造业	376,080,862.92	29.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,737,150.00	2.21
E	建筑业	56,178,375.63	4.48
F	批发和零售业	23,173,560.00	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	29,807,141.00	2.38
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	349,475,066.86	27.86
K	房地产业	37,976,755.14	3.03
L	租赁和商务服务业	44,971,929.00	3.58
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	135,378,240.92	10.79
S	综合	-	-
	合计	1,240,750,835.67	98.90

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	-	-
C	制造业	2,096,558.51	0.17
D	电力、热力、燃气	35,447.47	0.00



	及水生产和供应业		
E	建筑业	5,084.97	0.00
F	批发和零售业	24,142.52	0.00
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	98,649.91	0.01
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	65,433.45	0.01
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	2,363,494.17	0.19

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	10,943,170	69,598,561.20	5.55
2	600757	长江传媒	4,501,500	38,712,900.00	3.09
3	601088	中国神华	1,243,900	38,249,925.00	3.05
4	601328	交通银行	5,990,800	34,746,640.00	2.77
5	601928	凤凰传媒	2,991,300	34,100,820.00	2.72
6	601857	中国石油	4,524,400	33,797,268.00	2.69
7	000651	格力电器	917,300	33,490,623.00	2.67
8	601988	中国银行	8,386,400	32,790,824.00	2.61
9	600373	中文传媒	2,383,201	31,744,237.32	2.53
10	601288	农业银行	8,909,200	31,449,476.00	2.51

11	601098	中南传媒	2,656,921	30,820,283.60	2.46
12	600350	山东高速	4,679,300	29,807,141.00	2.38
13	002818	富森美	2,249,300	29,758,239.00	2.37
14	600019	宝钢股份	5,047,793	28,368,596.66	2.26
15	600177	雅戈尔	4,434,600	27,982,326.00	2.23
16	600461	洪城环境	3,395,000	27,737,150.00	2.21
17	601998	中信银行	4,517,447	27,014,333.06	2.15
18	601398	工商银行	5,391,800	25,988,476.00	2.07
19	601939	建设银行	3,968,000	24,839,680.00	1.98
20	600273	嘉化能源	2,635,445	24,825,891.90	1.98
21	000830	鲁西化工	2,347,950	24,794,352.00	1.98
22	000581	威孚高科	1,569,900	24,725,925.00	1.97
23	600901	江苏租赁	5,938,440	24,525,757.20	1.95
24	600782	新钢股份	6,336,400	23,508,044.00	1.87
25	601077	渝农商行	6,486,300	23,285,817.00	1.86
26	600755	厦门国贸	2,994,000	23,173,560.00	1.85
27	600449	宁夏建材	1,478,900	23,011,684.00	1.83
28	600015	华夏银行	4,207,800	22,764,198.00	1.81
29	002443	金洲管道	3,230,000	21,511,800.00	1.71
30	600919	江苏银行	2,908,300	21,376,005.00	1.70
31	600810	神马股份	2,986,200	21,231,882.00	1.69
32	000789	万年青	2,707,700	20,984,675.00	1.67
33	600170	上海建工	7,725,807	20,782,420.83	1.66
34	600064	南京高科	2,954,274	19,527,751.14	1.56
35	601658	邮储银行	3,991,200	19,516,968.00	1.56
36	000401	冀东水泥	2,530,200	18,647,574.00	1.49
37	601577	长沙银行	2,377,900	18,452,504.00	1.47
38	600663	陆家嘴	1,869,200	18,449,004.00	1.47
39	600502	安徽建工	3,476,660	18,356,764.80	1.46
40	600188	兖矿能源	612,500	18,326,000.00	1.46
41	600585	海螺水泥	730,700	17,346,818.00	1.38
42	601668	中国建筑	2,968,500	17,039,190.00	1.36
43	000932	华菱钢铁	3,531,200	16,843,824.00	1.34
44	002003	伟星股份	1,783,546	16,693,990.56	1.33
45	000717	中南股份	5,805,900	16,140,402.00	1.29
46	601166	兴业银行	1,022,864	16,007,821.60	1.28
47	600987	航民股份	1,940,760	15,972,454.80	1.27
48	600057	厦门象屿	1,748,700	15,213,690.00	1.21
49	601009	南京银行	1,687,100	13,496,800.00	1.08
50	601838	成都银行	1,082,700	13,219,767.00	1.05

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.03
2	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
3	688515	裕太微	1,494	243,148.50	0.02
4	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
5	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
6	688522	纳睿雷达	1,686	86,829.00	0.01
7	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
8	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
9	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
10	688443	智翔金泰	2,297	67,738.53	0.01
11	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.00
12	688472	阿特斯	2,887	49,194.48	0.00
13	688249	晶合集成	2,197	39,677.82	0.00
14	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
15	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
16	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
17	301325	曼恩斯特	205	22,129.75	0.00
18	688469	中芯集成	4,071	22,024.11	0.00
19	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
20	688361	中科飞测	333	21,535.11	0.00
21	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
22	688562	航天软件	700	15,617.00	0.00
23	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
24	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
25	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
26	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
27	688531	日联科技	104	14,140.88	0.00
28	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
29	688458	美芯晟	154	13,977.04	0.00
30	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
31	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
32	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
33	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
34	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
35	688512	慧智微	602	11,534.32	0.00
36	688552	航天南湖	488	11,468.00	0.00
37	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
38	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
39	301305	朗坤环境	565	11,124.85	0.00
40	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00

41	688581	安杰思	92	10,858.76	0.00
42	301332	德尔玛	788	10,819.24	0.00
43	688484	南芯科技	289	10,609.19	0.00
44	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
45	301360	荣旗科技	111	10,278.60	0.00
46	688352	颀中科技	839	10,126.73	0.00
47	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
48	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
49	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
50	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
51	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
52	688507	索辰科技	73	8,914.03	0.00
53	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
54	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
55	688433	华曙高科	275	8,662.50	0.00
56	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
57	301357	北方长龙	168	8,129.52	0.00
58	001287	中电港	380	7,987.60	0.00
59	301281	科源制药	311	7,806.10	0.00
60	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
61	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
62	688479	友车科技	252	7,431.48	0.00
63	301386	未来电器	309	7,351.11	0.00
64	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
65	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
66	601061	中信金属	884	6,700.72	0.00
67	603135	中重科技	295	5,277.55	0.00
68	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
69	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
70	601065	江盐集团	292	3,457.28	0.00
71	001328	登康口腔	116	2,956.84	0.00
72	601133	柏诚股份	221	2,709.46	0.00
73	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
74	603125	常青科技	96	2,354.88	0.00
75	001360	南矿集团	155	2,304.85	0.00
76	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
77	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
78	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	42,954,436.83	16.63
2	002818	富森美	36,766,121.18	14.24
3	000830	鲁西化工	33,233,547.19	12.87
4	000581	威孚高科	31,571,322.93	12.22
5	000789	万年青	28,622,922.59	11.08
6	002443	金洲管道	26,374,161.80	10.21
7	000401	冀东水泥	25,471,800.82	9.86
8	600028	中国石化	24,194,832.70	9.37
9	000932	华菱钢铁	22,530,275.00	8.72
10	002003	伟星股份	20,185,696.42	7.82
11	000717	中南股份	20,086,709.00	7.78
12	600757	长江传媒	7,558,759.00	2.93
13	601857	中国石油	6,703,059.00	2.60
14	601928	凤凰传媒	3,378,947.00	1.31
15	600170	上海建工	3,240,983.00	1.25
16	600373	中文传媒	3,110,860.00	1.20
17	601098	中南传媒	2,097,583.00	0.81
18	600919	江苏银行	1,759,307.00	0.68
19	601939	建设银行	1,731,425.00	0.67
20	600188	兖矿能源	1,553,574.00	0.60

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	000651	格力电器	17,019,864.00	6.59
2	002818	富森美	13,145,564.20	5.09
3	000830	鲁西化工	11,900,888.99	4.61
4	000581	威孚高科	10,939,274.58	4.24
5	000789	万年青	10,572,375.70	4.09
6	002443	金洲管道	9,884,784.00	3.83
7	000401	冀东水泥	8,956,775.00	3.47
8	000932	华菱钢铁	8,409,944.00	3.26
9	002003	伟星股份	7,655,444.01	2.96
10	000717	中南股份	7,455,783.00	2.89
11	600755	厦门国贸	5,011,782.00	1.94
12	600987	航民股份	3,437,769.65	1.33
13	601928	凤凰传媒	1,074,883.00	0.42
14	600449	宁夏建材	869,500.00	0.34
15	601328	交通银行	831,076.00	0.32
16	600461	洪城环境	784,295.00	0.30

17	601288	农业银行	734,390.00	0.28
18	600019	宝钢股份	733,118.00	0.28
19	600350	山东高速	720,051.00	0.28
20	601088	中国神华	714,455.00	0.28

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	376,210,730.98
卖出股票收入（成交）总额	142,373,980.23

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，中国银行（601988）于 2023 年 2 月 16 日收到银保

监会下发的银保监罚决字[2023]5号，因信贷业务违规，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，编制或者提供虚假资料，故对总行罚款 1600 万元，对分支机构罚款 1680 万元，合计罚款 3280 万元。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其余前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	84,696.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	518,432.10
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	22,015.09
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	625,143.95

### 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

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	600028	中国石化	1,780,800.00	0.14	转融通证券出借
2	600757	长江传媒	1,419,000.00	0.11	转融通证券出借
3	601088	中国神华	1,383,750.00	0.11	转融通证券出借
4	000651	格力电器	1,277,850.00	0.10	转融通证券出借
5	601328	交通银行	1,276,000.00	0.10	转融通证券出借
6	601928	凤凰传媒	1,254,000.00	0.10	转融通证券出借
7	601988	中国银行	1,192,550.00	0.10	转融通证券出借
8	601288	农业银行	1,147,250.00	0.09	转融通证券出借
9	600373	中文传媒	1,132,200.00	0.09	转融通证券出借

10	601857	中国石油	1,045,800.00	0.08	转融通证券出借
----	--------	------	--------------	------	---------

### 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	301486	致尚科技	277,921.20	0.02	新股未上市
2	688515	裕太微	243,148.50	0.02	新股锁定期内
3	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股未上市
4	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.01	新股未上市
4	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定期内
5	301291	N 明阳电	37,422.18	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

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		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	
		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 (%)
8,327	165,499.07	866,701,978.00	62.89	262,237,202.00	19.03	249,171,600.00	18.08

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	方正证券股份有限公司	53,889,396.00	3.91
2	上海国际信托有限公司—上海信托添越睿银 1 号集合资金信托计划	48,171,400.00	3.50
3	UBS AG	46,200,000.00	3.35
4	BARCLAYS BANK PLC	34,000,000.00	2.47



5	中信证券—中信—中信证券基金精选集合资产管理计划	32,498,500.00	2.36
6	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	26,363,700.00	1.91
7	广发证券股份有限公司	25,645,700.00	1.86
8	泰康人寿保险股份有限公司—分红—团体分红—019L—FH001 沪	24,756,300.00	1.80
9	兴银理财有限责任公司—兴银理财兴承恒享4号开放式净值型理财产品	22,540,500.00	1.64
10	中信银行股份有限公司—华夏福源养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基	21,470,000.00	1.56

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	25,000.00	0.0018

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年12月19日）基金份额总额	683,555,390.00
本报告期期初基金份额总额	316,110,780.00
本报告期基金总申购份额	1,660,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	598,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,378,110,780.00

## § 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

2023 年 4 月 18 日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	1	383,716,591.24	75.48	54,222.33	34.08	-
华西证券	1	69,106,654.46	13.59	64,359.87	40.45	-
安信证券	1	41,380,397.89	8.14	38,537.92	24.22	-
华泰证券	4	14,133,205.3	2.78	1,997.51	1.26	-

		8				
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 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，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地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及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本报告期内，本基金新增租用财通证券、金元证券、东海证券、世纪证券、银泰证券、东莞证券、山西证券交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	2,626,511.86	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-

世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金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	2023 年 6 月 21 日
2	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	2023 年 6 月 16 日
3	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	2023 年 6 月 3 日
4	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	2023 年 5 月 9 日

5	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	2023 年 4 月 29 日
6	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	2023 年 4 月 19 日
7	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	2023 年 4 月 11 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 30 日
9	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	2023 年 3 月 22 日
10	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	2023 年 3 月 21 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	20230101-20230222;20230224-20230309;20230330-20230410;20230427-20230504;20230519-20230608;	68,719,400.00	278,463,200.00	98,011,000.00	249,171,600.00	18.08

#### 产品特有风险

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

基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层  
托管人住所

### 12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日