

华泰柏瑞中证 500 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作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
§ 5 托管人报告	14
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
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
§ 7 投资组合报告	58
7.1 期末基金资产组合情况	58
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75

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	75
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	75
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	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	76
§ 8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
8.2 期末上市基金前十名持有人	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
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	77
§ 9 开放式基金份额变动	78
§ 10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
10.4 基金投资策略的改变	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
10.8 其他重大事件	83
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§ 12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	85
12.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
场内简称	ETF500（扩位证券简称：中证 500 指数 ETF）
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	325,429,801.00 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	2015 年 6 月 12 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。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	葛海蛟

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	北京市西城区太平桥大街 17 号
	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,781,972.83
本期利润	24,433,158.87
加权平均基金份额本期利润	0.0757
本期加权平均净值利润率	4.59%
本期基金份额净值增长率	4.40%
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	-127,441,036.75
期末可供分配基金份额利润	-0.3916
期末基金资产净值	527,134,427.50
期末基金份额净值	1.6198
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	-17.90%

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。

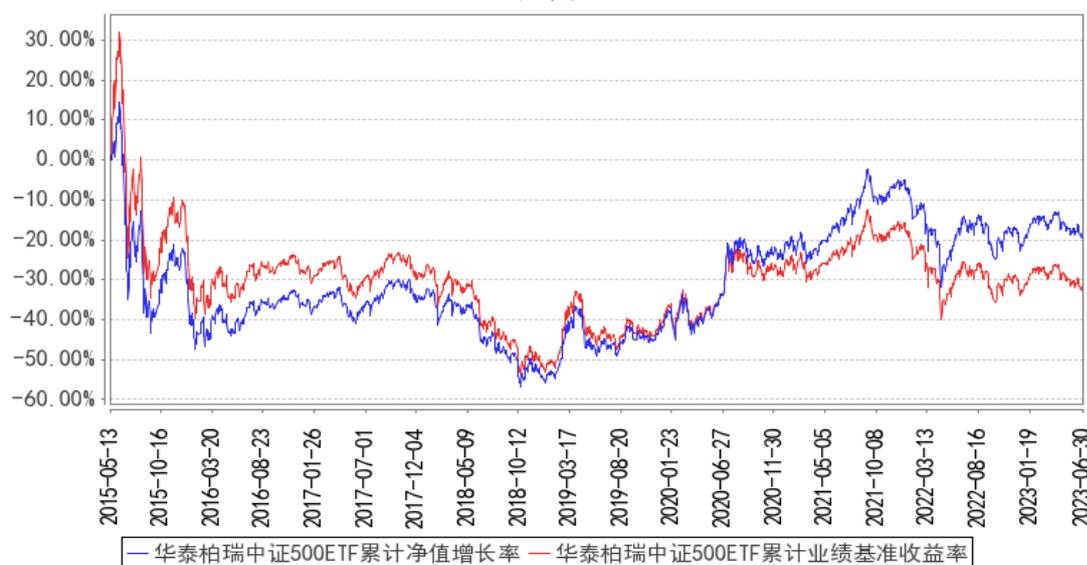
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.15%	0.94%	-0.81%	0.93%	0.96%	0.01%
过去三个月	-3.71%	0.82%	-5.38%	0.83%	1.67%	-0.01%
过去六个月	4.40%	0.78%	2.29%	0.79%	2.11%	-0.01%
过去一年	-3.36%	0.95%	-7.06%	0.96%	3.70%	-0.01%
过去三年	22.07%	1.18%	2.29%	1.19%	19.78%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-17.90%	1.61%	-31.41%	1.63%	13.51%	-0.02%

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

华泰柏瑞中证500ETF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 2015 年 5 月 13 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

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	2015年5月13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

				<p>至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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 0.023%，期间日跟踪误差为 0.037%，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 1.6198 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.40%，业绩比较基准收益率为 2.29%。

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，中国面临的内部和外部环境仍旧复杂多变，国内经济复苏斜率有所放缓，国内有效需求存在一定不足。在此背景下资本市场投资者预期也发生了较大的变化。展望后市，国内主要市场主体都处于资产负债表修复阶段，政策组合陆续出台，市场风险偏好有望得到一定提振。

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，基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，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；基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的 100%；基金收益分配每年至多 4 次。截止本报告期末，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,252,272.58	11,214,820.94
结算备付金		9,317,605.27	8,217,161.09
存出保证金		2,308,543.59	2,650,355.06
交易性金融资产	6.4.7.2	504,122,581.87	496,935,362.39
其中：股票投资		504,122,581.87	496,839,361.13
基金投资		-	-
债券投资		-	96,001.26
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		-	243,389.30
应收股利		100.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	10.14	1,036.11
资产总计		528,001,113.45	519,262,124.89
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	464.10
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		500,042.66	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		64,993.25	67,108.22
应付托管费		21,664.39	22,369.43
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	279,985.65	297,041.85
负债合计		866,685.95	386,983.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	654,575,464.25	672,678,229.14
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-127,441,036.75	-153,803,087.91
净资产合计		527,134,427.50	518,875,141.23
负债和净资产总计		528,001,113.45	519,262,124.89

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6198 元，基金份额总额 325,429,801.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 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
一、营业总收入		25,132,226.80	-62,385,807.39
1. 利息收入		101,689.00	142,898.02
其中：存款利息收入	6.4.7.13	90,555.08	86,919.81
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		11,133.92	55,978.21
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,189,673.55	-10,669,834.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,974,728.03	-13,848,210.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	72,043.78	91,590.83
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	-108,720.25	-2,663,706.04
股利收益	6.4.7.19	5,821,730.95	5,750,490.49
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	26,215,131.70	-52,392,540.39
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	5,079.65	533,669.84
减：二、营业总支出		699,067.93	706,240.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	396,172.40	400,794.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	132,057.39	133,598.19
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		840.30	0.47
8. 其他费用	6.4.7.23	169,997.84	171,846.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,433,158.87	-63,092,047.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,433,158.87	-63,092,047.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,433,158.87	-63,092,047.63

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 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）	672,678,229.14	-	-153,803,087.91	518,875,141.23
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）	672,678,229.14	-	-153,803,087.91	518,875,141.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,102,764.89	-	26,362,051.16	8,259,286.27
（一）、综合收益总额	-	-	24,433,158.87	24,433,158.87
（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）	-18,102,764.89	-	1,928,892.29	-16,173,872.60
其中：1. 基金申购款	45,256,912.24	-	-8,467,898.78	36,789,013.46
2. 基金赎回	-63,359,677.13	-	10,396,791.07	-52,962,886.06

回款				
(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)	654,575,464.25	-	-127,441,036.75	527,134,427.50
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)	600,267,169.58	-	-41,241,709.05	559,025,460.53
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)	600,267,169.58	-	-41,241,709.05	559,025,460.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	45,256,912.22	-	-66,328,663.78	-21,071,751.56
(一)、综合收益总额	-	-	-63,092,047.63	-63,092,047.63
(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)	45,256,912.22	-	-3,236,616.15	42,020,296.07
其中: 1. 基金申购款	236,341,652.79	-	-41,927,328.02	194,414,324.77
2. 基金赎回款	-191,084,740.57	-	38,690,711.87	-152,394,028.70
(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)	645,524,081.80	-	-107,570,372.83	537,953,708.97

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 500 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[2015]508 号《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》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 500 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 873,771,921.00 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(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,140.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于 2015 年 6 月 3 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.49716235,并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意,本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 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 500 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/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、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，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(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不得超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2019 年 10 月 16 日起，新增投资范围：本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 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 500 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	12,252,272.58
等于：本金	12,251,220.33
加：应计利息	1,052.25
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	12,252,272.58

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	539,409,520.86	-	504,122,581.87	-35,286,938.99
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		539,409,520.86	-	504,122,581.87	-35,286,938.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	19,166,640.00	-	-	
其中：股指期货投资	19,166,640.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	19,166,640.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2309	中证 500 2309	16.00	19,104,000.00	-62,640.00
合计				-62,640.00
减：可抵销期货暂收款				-62,640.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	10.14
待摊费用	-
合计	10.14

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	111,491.02
其中：交易所市场	111,491.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	79,234.48
合计	279,985.65

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	334,429,801.00	672,678,229.14
本期申购	22,500,000.00	45,256,912.24
本期赎回（以“-”号填列）	-31,500,000.00	-63,359,677.13
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	325,429,801.00	654,575,464.25

注：投资者申购和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	93,749,152.46	-247,552,240.37	-153,803,087.91
本期利润	-1,781,972.83	26,215,131.70	24,433,158.87
本期基金份额交易产生的变动数	-2,461,481.64	4,390,373.93	1,928,892.29
其中：基金申购款	6,414,550.65	-14,882,449.43	-8,467,898.78
基金赎回款	-8,876,032.29	19,272,823.36	10,396,791.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	89,505,697.99	-216,946,734.74	-127,441,036.75

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	18,895.17
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	71,505.52
其他	154.39
合计	90,555.08

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	-6,391,580.60
股票投资收益——赎回差价收入	-583,147.43
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	-6,974,728.03

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	96,051,526.57
减：卖出股票成本总额	102,210,198.75
减：交易费用	232,908.42
买卖股票差价收入	-6,391,580.60

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	52,962,886.06
减：现金支付赎回款总额	27,679,507.06
减：赎回股票成本总额	25,866,526.43
减：交易费用	-
赎回差价收入	-583,147.43

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	49.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	71,994.38
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	72,043.78

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	331,060.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	259,000.00
减：应计利息总额	52.44
减：交易费用	13.25
买卖债券差价收入	71,994.38

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-108,720.25

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	5,821,730.95
其中：证券出借权益补偿收入	23,852.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,821,730.95

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	25,439,891.70
股票投资	25,439,891.70
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	775,240.00
权证投资	-
期货投资	775,240.00
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	26,215,131.70

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	5,079.65
合计	5,079.65

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	79,234.48
银行划款手续费	1,343.82
存托服务费	159.39
合计	169,997.84

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、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞中证 500 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	-	-	1,454,461.83	0.41

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 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
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 总额的比例 (%)
华泰证券	190.97	0.17	-	-

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

2. 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	396,172.40	400,794.76
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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	132,057.39	133,598.19

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额

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	交易金额	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	41,530,647.00	48,124.30	192,400.00	1,040.00

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	202305300016762	鞍钢股份	2023 年 5 月 30 日	2,800.00	1,000.00	7	1.8000	0.98	-	-
华泰证券	202305290001247	鞍钢股份	2023 年 5 月 29 日	98,000.00	35,000.00	14	1.8000	68.60	-	-
华泰证券	202306060016712	鞍钢股份	2023 年 6 月 6 日	2,850.00	1,000.00	7	1.8000	0.98	-	-
华泰证券	2023061300021858	鞍钢股份	2023 年 6 月 13 日	2,850.00	1,000.00	7	1.8000	0.98	-	-
华泰证券	202306200009159	鞍钢股份	2023 年 6 月 20 日	2,790.00	1,000.00	7	1.8000	0.98	-	-
华泰证券	202306270002022	鞍钢股份	2023 年 6 月 27 日	2,760.00	1,000.00	7	1.8000	0.42	2,780.00	0.42
华泰证券	202305300016768	电投能源	2023 年 5 月 30 日	13,980.00	1,000.00	7	1.8000	4.90	-	-
华泰证券	202305290001253	电投能源	2023 年 5 月 29 日	184,080.00	13,000.00	14	1.8000	128.80	-	-
华泰证券	202306060001	电投能源	2023 年 6 月 6 日	13,270.00	1,000.00	7	1.8000	4.62	-	-

	4462										
华泰证券	202306 130001 9356	电投能源	2023年 6月13 日	13,320.0 0	1,000.00	7	1.800 0	4.69	-	-	
华泰证券	202306 200000 9165	电投能源	2023年 6月20 日	13,080.0 0	1,000.00	7	1.800 0	4.55	-	-	
华泰证券	202306 270002 0957	电投能源	2023年 6月27 日	13,100.0 0	1,000.00	7	1.800 0	1.98	13,220 .00	1.98	
华泰证券	202305 300001 6764	湖北能源	2023年 5月30 日	4,780.00	1,000.00	7	1.800 0	1.68	-	-	
华泰证券	202305 290000 1249	湖北能源	2023年 5月29 日	139,780. 00	29,000.0 0	14	1.800 0	97.86	-	-	
华泰证券	202306 060001 7139	湖北能源	2023年 6月6日	4,600.00	1,000.00	7	1.800 0	1.61	-	-	
华泰证券	202306 130001 9358	湖北能源	2023年 6月13 日	4,450.00	1,000.00	7	1.800 0	1.54	-	-	
华泰证券	202306 200000 9161	湖北能源	2023年 6月20 日	4,380.00	1,000.00	7	1.800 0	1.54	-	-	
华泰证券	202306 270002 0405	湖北能源	2023年 6月27 日	4,530.00	1,000.00	7	1.800 0	0.69	4,560. 00	0.69	
华泰证券	202305 300001 6774	马钢股份	2023年 5月30 日	2,690.00	1,000.00	7	1.800 0	0.91	-	-	
华泰证券	202305 290000 1309	马钢股份	2023年 5月29 日	95,200.0 0	35,000.0 0	14	1.800 0	66.64	-	-	
华泰证券	202306 060001 7784	马钢股份	2023年 6月6日	2,660.00	1,000.00	7	1.800 0	0.91	-	-	
华泰证券	202306 130001 9757	马钢股份	2023年 6月13 日	2,620.00	1,000.00	7	1.800 0	0.91	-	-	
华泰证券	202306 200000 9188	马钢股份	2023年 6月20 日	2,580.00	1,000.00	7	1.800 0	0.91	-	-	
华泰证券	202306	马钢股	2023年	2,570.00	1,000.00	7	1.800	0.39	2,570.	0.39	

	270002 1311	份	6月27 日				0		00	
华泰证券	202305 300001 6782	三友化 工	2023年 5月30 日	5,360.00	1,000.00	7	1.800 0	1.89	-	-
华泰证券	202305 290000 1294	三友化 工	2023年 5月29 日	98,280.0 0	18,000.0 0	14	1.800 0	68.74	-	-
华泰证券	202306 060001 7034	三友化 工	2023年 6月6日	5,390.00	1,000.00	7	1.800 0	1.89	-	-
华泰证券	202306 130001 9240	三友化 工	2023年 6月13 日	5,320.00	1,000.00	7	1.800 0	1.89	-	-
华泰证券	202306 200000 9251	三友化 工	2023年 6月20 日	5,330.00	1,000.00	7	1.800 0	1.89	-	-
华泰证券	202306 270002 1537	三友化 工	2023年 6月27 日	5,380.00	1,000.00	7	1.800 0	0.81	5,450. 00	0.81
华泰证券	202305 300001 6772	天地科 技	2023年 5月30 日	5,480.00	1,000.00	7	1.800 0	1.89	-	-
华泰证券	202305 290000 1275	天地科 技	2023年 5月29 日	131,280. 00	24,000.0 0	14	1.800 0	91.84	-	-
华泰证券	202306 060001 7458	天地科 技	2023年 6月6日	5,330.00	1,000.00	7	1.800 0	1.89	-	-
华泰证券	202306 130002 1757	天地科 技	2023年 6月13 日	5,410.00	1,000.00	7	1.800 0	1.89	-	-
华泰证券	202306 200000 9220	天地科 技	2023年 6月20 日	5,620.00	1,000.00	7	1.800 0	1.96	-	-
华泰证券	202306 270001 9939	天地科 技	2023年 6月27 日	5,690.00	1,000.00	7	1.800 0	0.84	5,830. 00	0.84
华泰证券	202305 300001 6784	五矿资 本	2023年 5月30 日	5,610.00	1,000.00	7	1.800 0	1.96	-	-
华泰证券	202305 290000 1303	五矿资 本	2023年 5月29 日	185,130. 00	33,000.0 0	14	1.800 0	129.64	-	-

华泰证券	202306060016175	五矿资本	2023年6月6日	5,590.00	1,000.00	7	1.8000	1.96	-	-
华泰证券	2023061300018509	五矿资本	2023年6月13日	5,480.00	1,000.00	7	1.8000	1.89	-	-
华泰证券	2023062000009259	五矿资本	2023年6月20日	5,450.00	1,000.00	7	1.8000	1.89	-	-
华泰证券	2023062700020784	五矿资本	2023年6月27日	5,330.00	1,000.00	7	1.8000	0.81	5,380.00	0.81
华泰证券	2023053000016766	新兴铸管	2023年5月30日	4,260.00	1,000.00	7	1.8000	1.47	-	-
华泰证券	2023052900001251	新兴铸管	2023年5月29日	147,700.00	35,000.00	14	1.8000	103.46	-	-
华泰证券	2023060600014251	新兴铸管	2023年6月6日	4,210.00	1,000.00	7	1.8000	1.47	-	-
华泰证券	2023061300021642	新兴铸管	2023年6月13日	4,130.00	1,000.00	7	1.8000	1.47	-	-
华泰证券	2023062000009163	新兴铸管	2023年6月20日	4,060.00	1,000.00	7	1.8000	1.40	-	-
华泰证券	2023062700021866	新兴铸管	2023年6月27日	4,110.00	1,000.00	7	1.8000	0.63	4,080.00	0.63
华泰证券	2023053000016788	中材国际	2023年5月30日	13,180.00	1,000.00	7	1.8000	4.62	-	-
华泰证券	2023052900001281	中材国际	2023年5月29日	189,150.00	15,000.00	14	1.8000	132.44	-	-
华泰证券	2023060600014016	中材国际	2023年6月6日	11,950.00	1,000.00	7	1.8000	4.20	-	-
华泰证券	2023061300019656	中材国际	2023年6月13日	11,820.00	1,000.00	7	1.8000	4.13	-	-
华泰证券	202306200000	中材国际	2023年6月20日	12,410.00	1,000.00	7	1.8000	4.34	-	-

	9265		日								
华泰证券	202306 270002 0666	中材国际	2023年 6月27 日	12,930.0 0	1,000.00	7	1.800 0	1.95	12,750 .00	1.95	
华泰证券	202305 300001 6786	中国外运	2023年 5月30 日	4,720.00	1,000.00	7	1.800 0	1.68	-	-	
华泰证券	202305 290000 1262	中国外运	2023年 5月29 日	108,560. 00	23,000.0 0	14	1.800 0	76.02	-	-	
华泰证券	202306 060001 6287	中国外运	2023年 6月6日	4,650.00	1,000.00	7	1.800 0	1.61	-	-	
华泰证券	202306 130001 9759	中国外运	2023年 6月13 日	4,750.00	1,000.00	7	1.800 0	1.68	-	-	
华泰证券	202306 200000 9180	中国外运	2023年 6月20 日	4,560.00	1,000.00	7	1.800 0	1.61	-	-	
华泰证券	202306 270002 1133	中国外运	2023年 6月27 日	4,550.00	1,000.00	7	1.800 0	0.69	4,660. 00	0.69	
华泰证券	202305 300001 6776	中航产融	2023年 5月30 日	3,930.00	1,000.00	7	1.800 0	1.40	-	-	
华泰证券	202305 290000 1318	中航产融	2023年 5月29 日	290,325. 00	73,500.0 0	14	1.800 0	203.28	-	-	
华泰证券	202306 060001 5429	中航产融	2023年 6月6日	3,890.00	1,000.00	7	1.800 0	1.33	-	-	
华泰证券	202306 130002 0170	中航产融	2023年 6月13 日	3,870.00	1,000.00	7	1.800 0	1.33	-	-	
华泰证券	202306 200000 9200	中航产融	2023年 6月20 日	4,010.00	1,000.00	7	1.800 0	1.40	-	-	
华泰证券	202306 270001 9573	中航产融	2023年 6月27 日	3,820.00	1,000.00	7	1.800 0	0.57	3,830. 00	0.57	
华泰证券	202305 300001 6770	中远海发	2023年 5月30 日	2,520.00	1,000.00	7	1.800 0	0.91	-	-	
华泰证券	202305	中远海	2023年	147,320.	58,000.0	14	1.800	103.18	-	-	

	290000 1288	发	5月29 日	00	0		0				
华泰证券	202306 060001 4041	中远海 发	2023年 6月6日	2,480.00	1,000.00	7	1.800 0	0.84	-	-	
华泰证券	202306 130001 8715	中远海 发	2023年 6月13 日	2,500.00	1,000.00	7	1.800 0	0.91	-	-	
华泰证券	202306 200000 9241	中远海 发	2023年 6月20 日	2,470.00	1,000.00	7	1.800 0	0.84	-	-	
华泰证券	202306 270002 1080	中远海 发	2023年 6月27 日	2,460.00	1,000.00	7	1.800 0	0.36	2,470. 00	0.36	
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	
华泰证券	202201 040001 8903	迈克生 物	2022年 1月18 日	177,780. 00	6,000	14	3.40	235.06	-	-	
华泰证券	202201 040002 3065	利亚德	2022年 1月18 日	126,260. 00	11,800	14	3.40	166.94	-	-	
华泰证券	202201 040002 3071	东方国 信	2022年 1月18 日	133,800. 00	12,000	14	3.40	176.91	-	-	
华泰证券	202201 040002 3099	易华录	2022年 1月18 日	79,580.0 0	2,300	14	3.40	105.22	-	-	
华泰证券	202201 040002 3101	三聚环 保	2022年 1月18 日	65,440.0 0	8,000	14	3.40	86.53	-	-	
华泰证券	202201 040002 3109	普利制 药	2022年 1月18 日	218,000. 00	4,000	14	3.40	288.24	-	-	
华泰证券	202201 040002 3113	昆仑万 维	2022年 1月18 日	306,020. 00	13,000	14	3.40	404.63	-	-	
华泰证券	202201 050000	捷成股 份	2022年 1月19	81,500.0 0	12,500	14	3.40	107.76	-	-	

	9089		日								
华泰证券	202201 050000 9091	长信科 技	2022年 1月19 日	379,431. 00	29,900	14	3.40	501.69	-	-	
华泰证券	202201 050000 9093	蓝色光 标	2022年 1月19 日	397,120. 00	32,000	14	3.40	525.08	-	-	
华泰证券	202201 060001 0075	昆仑万 维	2022年 1月20 日	26,530.0 0	1,000	14	3.40	35.08	-	-	
华泰证券	202201 140002 4104	利亚德	2022年 1月28 日	32,730.0 0	3,000	14	3.40	43.28	-	-	
华泰证券	202201 040002 3067	光威复 材	2022年 2月7日	423,750. 00	5,000	28	3.40	1,360. 71	-	-	
华泰证券	202201 040002 3093	景嘉微	2022年 2月7日	302,880. 00	2,000	28	3.40	972.58	-	-	
华泰证券	202201 040002 3121	北京君 正	2022年 2月7日	382,500. 00	3,000	28	3.40	1,228. 25	-	-	
华泰证券	202201 180002 3956	东方国 信	2022年 2月7日	155,160. 00	12,000	14	3.40	293.08	-	-	
华泰证券	202201 180002 3958	三聚环 保	2022年 2月7日	65,520.0 0	8,000	14	3.40	123.76	-	-	
华泰证券	202201 180002 3960	昆仑万 维	2022年 2月7日	293,150. 00	13,000	14	3.40	553.73	-	-	
华泰证券	202201 180002 3964	利亚德	2022年 2月7日	129,210. 00	11,800	14	3.40	244.06	-	-	
华泰证券	202201 180002 3978	普利制 药	2022年 2月7日	202,440. 00	4,000	14	3.40	382.39	-	-	
华泰证券	202201 180002 3984	易华录	2022年 2月7日	81,167.0 0	2,300	14	3.40	153.32	-	-	
华泰证券	202201 180002 3986	迈克生 物	2022年 2月7日	188,820. 00	6,000	14	3.40	356.66	-	-	
华泰证券	202201	蓝色光	2022年	350,400.	32,000	14	3.40	628.77	-	-	

	190000 9903	标	2月7日	00							
华泰证券	202201 190000 9913	捷成股 份	2022年 2月7日	102,000. 00	12,500	14	3.40	183.03	-	-	
华泰证券	202201 190000 9917	长信科 技	2022年 2月7日	348,036. 00	29,900	14	3.40	624.53	-	-	
华泰证券	202201 200000 8880	昆仑万 维	2022年 2月7日	21,710.0 0	1,000	14	3.40	36.91	-	-	
华泰证券	202201 280001 8814	利亚德	2022年 2月11 日	27,210.0 0	3,000	14	3.40	35.98	-	-	
华泰证券	202201 180002 6128	华宇软 件	2022年 2月15 日	169,780. 00	13,000	28	3.40	448.97	-	-	
华泰证券	202202 070004 3935	三聚环 保	2022年 2月21 日	64,800.0 0	8,000	14	3.40	85.68	-	-	
华泰证券	202202 070004 3999	利亚德	2022年 2月21 日	107,734. 00	11,800	14	3.40	142.45	-	-	
华泰证券	202202 070004 9253	昆仑万 维	2022年 2月21 日	18,250.0 0	1,000	14	3.40	24.13	-	-	
华泰证券	202202 070004 9259	昆仑万 维	2022年 2月21 日	237,250. 00	13,000	14	3.40	313.70	-	-	
华泰证券	202202 070004 9269	长信科 技	2022年 2月21 日	295,711. 00	29,900	14	3.40	391.00	-	-	
华泰证券	202202 070004 9279	捷成股 份	2022年 2月21 日	77,500.0 0	12,500	14	3.40	102.47	-	-	
华泰证券	202202 070004 9283	迈克生 物	2022年 2月21 日	160,980. 00	6,000	14	3.40	212.85	-	-	
华泰证券	202202 070005 4843	蓝色光 标	2022年 2月21 日	273,600. 00	32,000	14	3.40	361.76	-	-	
华泰证券	202202 070005 4875	东方国 信	2022年 2月21 日	132,120. 00	12,000	14	3.40	174.69	-	-	

华泰证券	202202 070005 4885	易华录	2022 年 2 月 21 日	60,375.0 0	2,300	14	3.40	79.83	-	-
华泰证券	202202 070004 3911	景嘉微	2022 年 3 月 7 日	227,060. 00	2,000	28	3.40	600.45	-	-
华泰证券	202202 070004 3915	北京君 正	2022 年 3 月 7 日	328,020. 00	3,000	28	3.40	867.43	-	-
华泰证券	202202 070005 4825	光威复 材	2022 年 3 月 7 日	354,950. 00	5,000	28	3.40	938.65	-	-
华泰证券	202202 210003 5697	蓝色光 标	2022 年 3 月 7 日	261,440. 00	32,000	14	3.40	345.68	-	-
华泰证券	202202 210003 5723	三聚环 保	2022 年 3 月 7 日	69,520.0 0	8,000	14	3.40	91.92	-	-
华泰证券	202202 210003 5729	长信科 技	2022 年 3 月 7 日	296,608. 00	29,900	14	3.40	392.18	-	-
华泰证券	202202 210003 5741	迈克生 物	2022 年 3 月 7 日	163,620. 00	6,000	14	3.40	216.34	-	-
华泰证券	202202 210003 5763	易华录	2022 年 3 月 7 日	70,219.0 0	2,300	14	3.40	92.85	-	-
华泰证券	202202 210004 7309	东方国 信	2022 年 3 月 7 日	173,400. 00	12,000	14	3.40	229.27	-	-
华泰证券	202202 210004 7327	利亚德	2022 年 3 月 7 日	107,144. 00	11,800	14	3.40	141.67	-	-
华泰证券	202202 210004 7347	捷成股 份	2022 年 3 月 7 日	82,625.0 0	12,500	14	3.40	109.25	-	-
华泰证券	202202 150000 7003	华宇软 件	2022 年 3 月 15 日	150,280. 00	13,000	28	3.40	397.41	-	-
华泰证券	202203 070003 7840	易华录	2022 年 3 月 21 日	60,421.0 0	2,300	14	3.40	79.89	-	-
华泰证券	202203 070003	东方国 信	2022 年 3 月 21	151,560. 00	12,000	14	3.40	200.40	-	-

	7844		日							
华泰证券	202203 070003 7848	长信科 技	2022年 3月21 日	264,914. 00	29,900	14	3.40	350.28	-	-
华泰证券	202203 070004 4340	捷成股 份	2022年 3月21 日	72,625.0 0	12,500	14	3.40	96.03	-	-
华泰证券	202203 070004 4344	蓝色光 标	2022年 3月21 日	244,160. 00	32,000	14	3.40	322.83	-	-
华泰证券	202203 070003 7854	北京君 正	2022年 4月6日	312,000. 00	3,000	28	3.40	884.00	-	-
华泰证券	202203 210003 2913	蓝色光 标	2022年 4月6日	261,120. 00	32,000	14	3.40	394.58	-	-

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500交易型 开放式指数 证券投资基金 联接基金	150,812,089.00	46.3424	155,921,989.00	46.6232
华泰证券股 份有限公司	748,871.00	0.2301	2,968,892.00	0.8877

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
中国银行	12,252,272.58	18,895.17	11,172,607.51	18,074.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	59,337	337,627.53
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	20,311	225,452.10
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	113066	平煤转债	网上配售	1,290	129,000.00
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
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	3,261	185,485.68
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	600938	中国海油	网上申购	3,000	32,400.00
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64

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	2023	6 个月	新股	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

	联锻造	年 5 月 15 日		锁定期内						
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	691	8,209.08	14,524.82	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
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	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡	2023	6 个月	新股	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

	南科技	年 6 月 16 日		锁定期内						
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	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
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	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	38.13	31.03	692	26,385.96	21,472.76	-
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	-
301301	川	2022	6 个月	新股	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-

	宁生物	2023年12月20日		锁定期内						
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
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	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定期内	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
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	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	76.80	107.95	296	22,732.80	31,953.20	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	14.81	13.73	1,111	16,453.91	15,254.03	-
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	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	73.45	46.64	223	16,379.35	10,400.72	-
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	2023	6个月	新股	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

	方长龙	年 4 月 11 日		锁定期内						
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	23.77	42.89	680	16,163.60	29,165.20	-
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	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
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	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	53.27	40.20	353	18,804.31	14,190.60	-
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	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世	2023	6 个月	新股	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-

	纪恒通	年 5 月 10 日		锁定期内						
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	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	19.99	16.90	674	13,473.26	11,390.60	-
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	3,681	212,246.46	212,246.46	-
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	-
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	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	6.58	7.58	1,602	10,541.16	12,143.16	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	10.36	11.84	511	5,293.96	6,050.24	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	11.66	12.26	502	5,853.32	6,154.52	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	17.80	17.89	534	9,505.20	9,553.26	-
603137	恒	2023	6 个月	新股	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-

	尚节能	年 4 月 10 日		锁定期内						
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	18.06	3,172	62,995.92	57,286.32	-
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	1,527	18,476.70	18,430.89	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	23.60	64.67	475	11,210.00	30,718.25	-
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	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	37.88	29.49	1,075	40,721.00	31,701.75	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	75.00	90.76	218	16,350.00	19,785.68	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	5.69	5.41	5,934	33,764.46	32,102.94	-
688472	阿	2023	6 个月	新股	11.10	17.04	2,032	22,555.20	34,625.28	-

	特斯	年 6 月 2 日		锁定期内						
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	39.99	36.71	518	20,714.82	19,015.78	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	245.56	122.11	129	21,363.72	15,752.19	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
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	185	28,190.30	25,154.45	-
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	365	15,939.55	19,363.25	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	21.17	23.50	676	14,310.92	15,886.00	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688581	安	2023	6 个月	新股	125.80	118.03	131	16,479.80	15,461.93	-

	杰思	年 5 月 12 日		锁定期内						
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	26.74	40.68	559	14,947.66	22,740.12	-
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	143	18,000.84	12,410.97	-
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	51,900	306,195.95	361,743.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：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	000778	新兴铸管	2023年7月4日	4.08	1,000	4,080.00
2	000883	湖北能源	2023年7月4日	4.56	1,000	4,560.00
3	000898	鞍钢股份	2023年7月4日	2.78	1,000	2,780.00
4	002128	电投能源	2023年7月4日	13.22	1,000	13,220.00
5	600390	五矿资本	2023年7月4日	5.38	1,000	5,380.00
6	600409	三友化工	2023年7月4日	5.45	1,000	5,450.00
7	600582	天地科	2023年7月4日	5.83	1,000	5,830.00

		技				
8	600705	中航产融	2023 年 7 月 4 日	3.83	1,000	3,830.00
9	600808	马钢股份	2023 年 7 月 4 日	2.57	1,000	2,570.00
10	600970	中材国际	2023 年 7 月 4 日	12.75	1,000	12,750.00
11	601598	中国外运	2023 年 7 月 4 日	4.66	1,000	4,660.00
12	601866	中远海发	2023 年 7 月 4 日	2.47	1,000	2,470.00
合计	-	-	-	-	12,000	67,580.00

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：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%)。

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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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	12,252,272.58	-	-	-	-	-	12,252,272.58
结算备付金	9,317,605.27	-	-	-	-	-	9,317,605.27
存出保证金	2,308,543.59	-	-	-	-	-	2,308,543.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-504,122,581.87	504,122,581.87
应收股利	-	-	-	-	-	100.00	100.00
其他资产	-	-	-	-	-	10.14	10.14
资产总计	23,878,421.44	-	-	-	-	-504,122,692.01	528,001,113.45
负债							
应付管理人报	-	-	-	-	-	64,993.25	64,993.25

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	21,664.39	21,664.39
应付清算款	-	-	-	-	-	500,042.66	500,042.66
其他负债	-	-	-	-	-	279,985.65	279,985.65
负债总计	-	-	-	-	-	866,685.95	866,685.95
利率敏感度缺口	23,878,421.44	-	-	-	-	-503,256,006.06	527,134,427.50
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	11,214,820.94	-	-	-	-	-	11,214,820.94
结算备付金	8,217,161.09	-	-	-	-	-	8,217,161.09
存出保证金	18,623.86	-	-	-	-	2,631,731.20	2,650,355.06
交易性金融资产	-	-	-	-96,001.26	496,839,361.13	496,935,362.39	
应收清算款	-	-	-	-	-	243,389.30	243,389.30
其他资产	-	-	-	-	-	1,036.11	1,036.11
资产总计	19,450,605.89	-	-	-96,001.26	499,715,517.74	519,262,124.89	
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	464.10	464.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,108.22	67,108.22
应付托管费	-	-	-	-	-	22,369.43	22,369.43
应交税费	-	-	-	-	-	0.06	0.06
其他负债	-	-	-	-	-	297,041.85	297,041.85
负债总计	-	-	-	-	-	386,983.66	386,983.66
利率敏感度缺口	19,450,605.89	-	-	-96,001.26	499,328,534.08	518,875,141.23	

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：0.02%)，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	504,122,581.87	95.63	496,839,361.13	95.75
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	-	-	-464.10	-
合计	504,122,581.87	95.63	496,838,897.03	95.75

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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 500 指数上升 5%	25,934,005.96	25,687,271.22
中证 500 指数下降	-25,934,005.96	-25,687,271.22	

	5%		
--	----	--	--

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	502,019,402.99	492,167,404.96
第二层次	1,022,873.16	1,968,646.26
第三层次	1,080,305.72	2,799,311.17
合计	504,122,581.87	496,935,362.39

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	504,122,581.87	95.48
	其中：股票	504,122,581.87	95.48
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	21,569,877.85	4.09
8	其他各项资产	2,308,653.73	0.44
9	合计	528,001,113.45	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 67,580.00 元，占本基金期末资产净值的 0.01%。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 4,515 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 67,330.00 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	3,538,454.04	0.67
B	采矿业	18,584,381.52	3.53
C	制造业	315,178,007.39	59.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,409,845.92	3.30
E	建筑业	5,610,024.38	1.06
F	批发和零售业	16,073,768.10	3.05
G	交通运输、仓储和	7,585,988.17	1.44

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	945,605.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,235,014.99	7.63
J	金融业	43,230,330.22	8.20
K	房地产业	6,831,831.03	1.30
L	租赁和商务服务业	6,187,972.84	1.17
M	科学研究和技术服务业	5,606,348.30	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	2,802,960.50	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,533,872.11	0.48
R	文化、体育和娱乐业	7,132,588.93	1.35
S	综合	2,659,357.51	0.50
	合计	502,146,350.95	95.26

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	1,719,800.95	0.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	8,530.03	0.00
F	批发和零售业	51,021.23	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,427.33	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,976,230.92	0.37

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	47,800	7,048,110.00	1.34
2	688256	寒武纪	15,535	2,920,580.00	0.55
3	000988	华工科技	74,755	2,841,437.55	0.54
4	002340	格林美	381,524	2,636,330.84	0.50
5	002384	东山精密	101,700	2,634,030.00	0.50
6	002422	科伦药业	87,500	2,597,000.00	0.49
7	600372	中航电子	166,658	2,529,868.44	0.48
8	300418	昆仑万维	62,207	2,505,697.96	0.48
9	300012	华测检测	125,100	2,439,450.00	0.46
10	600157	永泰能源	1,651,100	2,344,562.00	0.44
11	300724	捷佳伟创	20,700	2,325,645.00	0.44
12	600079	人福医药	85,000	2,289,900.00	0.43
13	600489	中金黄金	216,200	2,233,346.00	0.42
14	300003	乐普医疗	97,900	2,213,519.00	0.42
15	688777	中控技术	35,078	2,202,196.84	0.42
16	002738	中矿资源	42,500	2,164,950.00	0.41
17	600487	亨通光电	146,700	2,150,622.00	0.41
18	002028	思源电气	45,616	2,131,179.52	0.40
19	600536	中国软件	44,813	2,100,833.44	0.40
20	601058	赛轮轮胎	182,100	2,074,119.00	0.39
21	002463	沪电股份	98,800	2,068,872.00	0.39
22	601555	东吴证券	297,730	2,066,246.20	0.39
23	600765	中航重机	76,586	2,030,294.86	0.39
24	300037	新宙邦	38,840	2,015,407.60	0.38
25	000066	中国长城	143,900	1,990,137.00	0.38
26	600885	宏发股份	62,084	1,977,375.40	0.38
27	000807	云铝股份	154,711	1,969,471.03	0.37

28	600482	中国动力	80,300	1,882,232.00	0.36
29	000009	中国宝安	153,383	1,851,332.81	0.35
30	688099	晶晨股份	21,748	1,833,791.36	0.35
31	300146	汤臣倍健	75,900	1,820,082.00	0.35
32	000423	东阿阿胶	34,000	1,817,300.00	0.34
33	600352	浙江龙盛	193,500	1,809,225.00	0.34
34	300058	蓝色光标	185,152	1,790,419.84	0.34
35	002966	苏州银行	272,500	1,784,875.00	0.34
36	002156	通富微电	78,800	1,780,880.00	0.34
37	002185	华天科技	190,600	1,753,520.00	0.33
38	601108	财通证券	241,600	1,749,184.00	0.33
39	600415	小商品城	203,900	1,739,267.00	0.33
40	002625	光启技术	112,100	1,710,646.00	0.32
41	002624	完美世界	101,000	1,705,890.00	0.32
42	600027	华电国际	253,000	1,692,570.00	0.32
43	300144	宋城演艺	136,100	1,687,640.00	0.32
44	600109	国金证券	193,800	1,680,246.00	0.32
45	000783	长江证券	287,700	1,668,660.00	0.32
46	600988	赤峰黄金	123,700	1,665,002.00	0.32
47	600161	天坛生物	61,300	1,664,295.00	0.32
48	601233	桐昆股份	125,500	1,662,875.00	0.32
49	601077	渝农商行	460,100	1,651,759.00	0.31
50	002008	大族激光	62,600	1,640,120.00	0.31
51	300568	星源材质	95,300	1,638,207.00	0.31
52	600298	安琪酵母	45,200	1,636,692.00	0.31
53	300285	国瓷材料	59,700	1,635,780.00	0.31
54	600418	江淮汽车	129,900	1,635,441.00	0.31
55	600096	云天化	95,500	1,630,185.00	0.31
56	002385	大北农	246,100	1,624,260.00	0.31
57	002223	鱼跃医疗	44,755	1,610,732.45	0.31
58	603444	吉比特	3,277	1,609,367.47	0.31
59	000630	铜陵有色	547,600	1,582,564.00	0.30
60	002407	多氟多	79,660	1,582,047.60	0.30
61	603882	金域医学	20,900	1,577,950.00	0.30
62	600862	中航高科	61,889	1,566,410.59	0.30
63	300390	天华新能	43,520	1,558,016.00	0.30
64	002409	雅克科技	21,200	1,545,056.00	0.29
65	300024	机器人	92,200	1,536,974.00	0.29
66	601162	天风证券	515,200	1,535,296.00	0.29
67	603688	石英股份	13,400	1,525,456.00	0.29
68	002497	雅化集团	85,700	1,523,746.00	0.29
69	000933	神火股份	117,100	1,522,300.00	0.29
70	300474	景嘉微	16,900	1,520,831.00	0.29

71	002240	盛新锂能	47,500	1,513,825.00	0.29
72	300073	当升科技	30,000	1,509,900.00	0.29
73	600705	中航产融	393,800	1,508,254.00	0.29
74	300395	菲利华	30,600	1,505,520.00	0.29
75	300604	长川科技	31,600	1,500,684.00	0.28
76	601168	西部矿业	141,703	1,489,298.53	0.28
77	605358	立昂微	40,192	1,476,252.16	0.28
78	002439	启明星辰	49,600	1,476,096.00	0.28
79	000932	华菱钢铁	306,660	1,462,768.20	0.28
80	603596	伯特利	18,400	1,458,384.00	0.28
81	600066	宇通客车	98,300	1,448,942.00	0.27
82	000975	银泰黄金	123,840	1,448,928.00	0.27
83	002600	领益智造	209,300	1,446,263.00	0.27
84	300136	信维通信	72,000	1,445,760.00	0.27
85	600060	海信视像	58,382	1,444,954.50	0.27
86	002797	第一创业	249,900	1,429,428.00	0.27
87	002138	顺络电子	59,700	1,427,427.00	0.27
88	002568	百润股份	39,100	1,421,285.00	0.27
89	002465	海格通信	137,077	1,417,376.18	0.27
90	603816	顾家家居	36,700	1,400,105.00	0.27
91	000021	深科技	69,665	1,392,603.35	0.26
92	603939	益丰药房	37,560	1,389,720.00	0.26
93	002850	科达利	10,500	1,388,625.00	0.26
94	600839	四川长虹	274,480	1,386,124.00	0.26
95	600563	法拉电子	10,078	1,383,709.40	0.26
96	600160	巨化股份	100,392	1,383,401.76	0.26
97	601128	常熟银行	202,805	1,383,130.10	0.26
98	300253	卫宁健康	127,700	1,381,714.00	0.26
99	300832	新产业	23,400	1,380,600.00	0.26
100	000591	太阳能	203,400	1,379,052.00	0.26
101	600879	航天电子	161,754	1,373,291.46	0.26
102	688567	孚能科技	63,375	1,368,266.25	0.26
103	600873	梅花生物	153,200	1,368,076.00	0.26
104	000683	远兴能源	188,500	1,355,315.00	0.26
105	601990	南京证券	164,400	1,344,792.00	0.26
106	600392	盛和资源	104,261	1,341,839.07	0.25
107	002368	太极股份	32,425	1,334,937.25	0.25
108	002078	太阳纸业	124,674	1,332,765.06	0.25
109	300699	光威复材	43,200	1,332,720.00	0.25
110	600497	驰宏锌锗	264,946	1,330,028.92	0.25
111	688521	芯原股份	18,468	1,328,218.56	0.25
112	603589	口子窖	26,800	1,322,580.00	0.25
113	300866	安克创新	15,100	1,321,250.00	0.25

114	601696	中银证券	123,900	1,320,774.00	0.25
115	000729	燕京啤酒	104,810	1,306,980.70	0.25
116	300118	东方日升	50,900	1,304,567.00	0.25
117	688390	固德威	7,812	1,303,510.32	0.25
118	600177	雅戈尔	206,400	1,302,384.00	0.25
119	002025	航天电器	20,400	1,301,520.00	0.25
120	600516	方大炭素	209,500	1,298,900.00	0.25
121	000831	中国稀土	43,800	1,296,480.00	0.25
122	002294	信立泰	41,500	1,294,385.00	0.25
123	300017	网宿科技	181,200	1,288,332.00	0.24
124	600141	兴发集团	57,911	1,286,782.42	0.24
125	600642	申能股份	182,463	1,275,416.37	0.24
126	000728	国元证券	194,600	1,268,792.00	0.24
127	002673	西部证券	199,300	1,265,555.00	0.24
128	002430	杭氧股份	36,600	1,257,576.00	0.24
129	600699	均胜电子	71,240	1,256,673.60	0.24
130	000629	钒钛股份	319,700	1,250,027.00	0.24
131	600170	上海建工	462,300	1,243,587.00	0.24
132	002532	天山铝业	207,500	1,242,925.00	0.24
133	600118	中国卫星	44,000	1,241,240.00	0.24
134	600325	华发股份	125,902	1,240,134.70	0.24
135	002273	水晶光电	103,378	1,234,333.32	0.23
136	002195	二三四五	425,520	1,229,752.80	0.23
137	002268	电科网安	44,049	1,227,645.63	0.23
138	601966	玲珑轮胎	54,900	1,219,878.00	0.23
139	002739	万达电影	97,200	1,218,888.00	0.23
140	600153	建发股份	111,700	1,218,647.00	0.23
141	002372	伟星新材	59,220	1,216,378.80	0.23
142	600166	福田汽车	356,902	1,213,466.80	0.23
143	600521	华海药业	65,800	1,211,378.00	0.23
144	000400	许继电气	52,540	1,211,047.00	0.23
145	600143	金发科技	138,300	1,207,359.00	0.23
146	600486	扬农化工	13,800	1,206,396.00	0.23
147	600549	厦门钨业	63,319	1,204,960.57	0.23
148	300595	欧普康视	39,900	1,204,581.00	0.23
149	603000	人民网	41,170	1,202,164.00	0.23
150	000998	隆平高科	78,300	1,201,905.00	0.23
151	600399	抚顺特钢	117,300	1,196,460.00	0.23
152	688002	睿创微纳	26,668	1,194,726.40	0.23
153	000738	航发控制	48,900	1,193,160.00	0.23
154	600637	东方明珠	152,300	1,190,986.00	0.23
155	689009	九号公司	31,996	1,179,052.60	0.22
156	002065	东华软件	166,800	1,177,608.00	0.22

157	688220	翱捷科技	15,575	1,174,199.25	0.22
158	002444	巨星科技	53,633	1,173,490.04	0.22
159	300487	蓝晓科技	18,750	1,170,375.00	0.22
160	600859	王府井	59,129	1,170,162.91	0.22
161	600481	双良节能	83,455	1,166,700.90	0.22
162	000997	新大陆	61,422	1,160,875.80	0.22
163	601577	长沙银行	149,500	1,160,120.00	0.22
164	601198	东兴证券	144,200	1,156,484.00	0.22
165	002131	利欧股份	501,984	1,154,563.20	0.22
166	300438	鹏辉能源	24,000	1,152,960.00	0.22
167	600499	科达制造	101,400	1,151,904.00	0.22
168	300383	光环新网	106,900	1,149,175.00	0.22
169	002353	杰瑞股份	45,716	1,148,843.08	0.22
170	688169	石头科技	3,570	1,144,827.60	0.22
171	600704	物产中大	230,600	1,139,164.00	0.22
172	000960	锡业股份	73,100	1,136,705.00	0.22
173	300682	朗新科技	48,800	1,136,064.00	0.22
174	600271	航天信息	82,700	1,132,163.00	0.21
175	600021	上海电力	104,745	1,128,103.65	0.21
176	300001	特锐德	54,150	1,125,237.00	0.21
177	000519	中兵红箭	62,186	1,124,944.74	0.21
178	002373	千方科技	82,265	1,122,094.60	0.21
179	601997	贵阳银行	217,400	1,121,784.00	0.21
180	688009	中国通号	192,201	1,114,765.80	0.21
181	603077	和邦生物	457,285	1,111,202.55	0.21
182	000623	吉林敖东	69,200	1,109,968.00	0.21
183	300676	华大基因	18,500	1,109,815.00	0.21
184	000703	恒逸石化	163,500	1,108,530.00	0.21
185	002056	横店东磁	60,543	1,102,488.03	0.21
186	300088	长信科技	182,535	1,100,686.05	0.21
187	002507	涪陵榨菜	60,100	1,100,431.00	0.21
188	600380	健康元	86,052	1,093,720.92	0.21
189	600511	国药股份	27,995	1,087,605.75	0.21
190	603233	大参林	38,708	1,084,211.08	0.21
191	002152	广电运通	92,369	1,082,564.68	0.21
192	000513	丽珠集团	27,806	1,081,931.46	0.21
193	600498	烽火通信	53,000	1,079,610.00	0.20
194	600867	通化东宝	103,300	1,078,452.00	0.20
195	002281	光迅科技	29,045	1,077,279.05	0.20
196	600529	山东药玻	39,500	1,075,190.00	0.20
197	600998	九州通	103,406	1,073,354.28	0.20
198	688301	奕瑞科技	3,783	1,068,432.69	0.20
199	600546	山煤国际	73,700	1,066,439.00	0.20

200	002203	海亮股份	88,600	1,064,086.00	0.20
201	002299	圣农发展	55,542	1,063,629.30	0.20
202	600348	华阳股份	134,131	1,060,976.21	0.20
203	601016	节能风电	288,800	1,059,896.00	0.20
204	000636	风华高科	68,874	1,056,527.16	0.20
205	603338	浙江鼎力	18,800	1,052,988.00	0.20
206	688072	拓荆科技	2,465	1,050,016.05	0.20
207	603517	绝味食品	28,200	1,047,630.00	0.20
208	002595	豪迈科技	29,800	1,046,874.00	0.20
209	600739	辽宁成大	79,600	1,046,740.00	0.20
210	603712	七一二	34,400	1,039,224.00	0.20
211	601636	旗滨集团	119,700	1,031,814.00	0.20
212	002192	融捷股份	15,400	1,029,182.00	0.20
213	603737	三棵树	15,680	1,025,785.60	0.19
214	002080	中材科技	49,900	1,023,948.00	0.19
215	002531	天顺风能	67,000	1,020,410.00	0.19
216	002506	协鑫集成	347,900	1,019,347.00	0.19
217	603927	中科软	26,420	1,018,755.20	0.19
218	002432	九安医疗	28,800	1,014,048.00	0.19
219	603885	吉祥航空	65,675	1,013,365.25	0.19
220	600863	内蒙华电	242,600	1,006,790.00	0.19
221	688772	珠海冠宇	49,925	1,005,988.75	0.19
222	600970	中材国际	78,560	1,001,640.00	0.19
223	600580	卧龙电驱	68,425	999,689.25	0.19
224	600655	豫园股份	145,000	994,700.00	0.19
225	002092	中泰化学	154,024	993,454.80	0.19
226	300182	捷成股份	156,793	989,363.83	0.19
227	000878	云南铜业	89,414	988,024.70	0.19
228	688385	复旦微电	19,687	986,318.70	0.19
229	300212	易华录	29,620	984,272.60	0.19
230	600820	隧道股份	163,600	983,236.00	0.19
231	300296	利亚德	150,400	982,112.00	0.19
232	002683	广东宏大	33,300	980,352.00	0.19
233	600528	中铁工业	99,100	979,108.00	0.19
234	600909	华安证券	209,490	978,318.30	0.19
235	002939	长城证券	120,000	975,600.00	0.19
236	002926	华西证券	117,100	973,101.00	0.18
237	600535	天士力	66,900	970,719.00	0.18
238	300244	迪安诊断	37,297	955,922.11	0.18
239	000893	亚钾国际	41,500	952,010.00	0.18
240	600329	达仁堂	21,200	951,668.00	0.18
241	300748	金力永磁	31,800	951,456.00	0.18
242	000547	航天发展	95,125	951,250.00	0.18

243	000750	国海证券	283,242	948,860.70	0.18
244	600258	首旅酒店	49,900	945,605.00	0.18
245	000039	中集集团	136,976	943,764.64	0.18
246	603160	汇顶科技	20,400	943,500.00	0.18
247	002557	洽洽食品	22,700	943,185.00	0.18
248	600008	首创环保	327,400	942,912.00	0.18
249	600416	湘电股份	49,100	937,319.00	0.18
250	603156	养元饮品	37,700	931,190.00	0.18
251	688516	奥特维	4,930	928,812.00	0.18
252	000970	中科三环	72,338	927,373.16	0.18
253	002429	兆驰股份	168,300	925,650.00	0.18
254	000060	中金岭南	194,500	923,875.00	0.18
255	603456	九洲药业	33,500	917,230.00	0.17
256	601991	大唐发电	276,400	914,884.00	0.17
257	000830	鲁西化工	85,733	905,340.48	0.17
258	603893	瑞芯微	12,400	903,340.00	0.17
259	600369	西南证券	247,000	901,550.00	0.17
260	603658	安图生物	17,400	900,102.00	0.17
261	600390	五矿资本	167,200	899,536.00	0.17
262	600435	北方导航	77,945	895,588.05	0.17
263	300558	贝达药业	18,600	893,358.00	0.17
264	002500	山西证券	160,097	893,341.26	0.17
265	002508	老板电器	35,300	892,737.00	0.17
266	002128	电投能源	66,729	882,157.38	0.17
267	600398	海澜之家	127,900	879,952.00	0.17
268	002936	郑州银行	382,205	879,071.50	0.17
269	600038	中直股份	22,000	876,040.00	0.17
270	601880	辽港股份	559,736	873,188.16	0.17
271	300009	安科生物	87,060	870,600.00	0.17
272	300070	碧水源	161,600	866,176.00	0.16
273	601717	郑煤机	68,702	855,339.90	0.16
274	002153	石基信息	60,932	853,048.00	0.16
275	600848	上海临港	71,200	850,840.00	0.16
276	600985	淮北矿业	73,800	850,176.00	0.16
277	300026	红日药业	156,341	847,368.22	0.16
278	603858	步长制药	40,998	844,148.82	0.16
279	000050	深天马 A	91,400	839,052.00	0.16
280	300529	健帆生物	36,100	836,798.00	0.16
281	002572	索菲亚	47,500	827,450.00	0.16
282	601179	中国西电	152,451	824,759.91	0.16
283	603127	昭衍新药	20,080	821,272.00	0.16
284	002244	滨江集团	92,492	815,779.44	0.15
285	300373	扬杰科技	20,090	815,051.30	0.15

286	601456	国联证券	88,800	808,080.00	0.15
287	600673	东阳光	112,070	808,024.70	0.15
288	002408	齐翔腾达	126,794	807,677.78	0.15
289	688779	长远锂科	71,540	806,255.80	0.15
290	601958	金钼股份	72,000	802,800.00	0.15
291	002266	浙富控股	194,281	802,380.53	0.15
292	003035	南网能源	112,300	799,576.00	0.15
293	600566	济川药业	27,500	798,600.00	0.15
294	002019	亿帆医药	54,683	798,371.80	0.15
295	600827	百联股份	59,700	798,189.00	0.15
296	600895	张江高科	57,276	797,281.92	0.15
297	600667	太极实业	109,600	795,696.00	0.15
298	688188	柏楚电子	4,203	792,517.68	0.15
299	000155	川能动力	54,900	790,560.00	0.15
300	603267	鸿远电子	12,100	790,130.00	0.15
301	688116	天奈科技	17,240	788,730.00	0.15
302	688538	和辉光电	309,712	786,668.48	0.15
303	002958	青农商行	289,100	786,352.00	0.15
304	300357	我武生物	23,300	783,579.00	0.15
305	600208	新湖中宝	314,700	780,456.00	0.15
306	688200	华峰测控	5,100	780,300.00	0.15
307	601000	唐山港	220,243	777,457.79	0.15
308	601666	平煤股份	102,800	775,112.00	0.15
309	000739	普洛药业	43,600	773,464.00	0.15
310	600282	南钢股份	229,154	772,248.98	0.15
311	600171	上海贝岭	42,203	770,204.75	0.15
312	600755	厦门国贸	99,115	767,150.10	0.15
313	000887	中鼎股份	58,521	766,039.89	0.15
314	600378	昊华科技	20,300	764,092.00	0.14
315	002155	湖南黄金	62,572	763,378.40	0.14
316	002670	国盛金控	85,976	754,869.28	0.14
317	600959	江苏有线	223,038	753,868.44	0.14
318	600316	洪都航空	32,053	751,642.85	0.14
319	300677	英科医疗	34,160	751,520.00	0.14
320	300115	长盈精密	62,535	744,791.85	0.14
321	601231	环旭电子	49,300	737,528.00	0.14
322	300888	稳健医疗	17,620	734,225.40	0.14
323	600315	上海家化	25,198	730,993.98	0.14
324	002487	大金重工	23,700	730,908.00	0.14
325	601866	中远海发	294,251	726,799.97	0.14
326	600517	国网英大	127,500	726,750.00	0.14
327	000778	新兴铸管	177,989	726,195.12	0.14
328	603218	日月股份	38,200	725,418.00	0.14

329	002030	达安基因	72,712	724,938.64	0.14
330	000598	兴蓉环境	133,172	723,123.96	0.14
331	600131	国网信通	35,800	722,802.00	0.14
332	600056	中国医药	55,413	719,260.74	0.14
333	300363	博腾股份	24,300	719,037.00	0.14
334	600582	天地科技	123,100	717,673.00	0.14
335	603026	胜华新材	12,100	716,925.00	0.14
336	000987	越秀资本	111,870	710,374.50	0.13
337	002221	东华能源	81,744	707,085.60	0.13
338	002249	大洋电机	124,031	706,976.70	0.13
339	300251	光线传媒	87,300	706,257.00	0.13
340	600598	北大荒	52,910	705,290.30	0.13
341	000027	深圳能源	106,076	699,040.84	0.13
342	601005	重庆钢铁	498,300	697,620.00	0.13
343	002326	永太科技	45,434	694,685.86	0.13
344	000709	河钢股份	307,300	694,498.00	0.13
345	002518	科士达	17,300	692,173.00	0.13
346	600906	财达证券	96,100	691,920.00	0.13
347	002183	怡亚通	135,150	689,265.00	0.13
348	601106	中国一重	203,900	685,104.00	0.13
349	002690	美亚光电	26,325	677,868.75	0.13
350	002831	裕同科技	27,741	676,602.99	0.13
351	601992	金隅集团	309,900	675,582.00	0.13
352	600718	东软集团	62,886	670,364.76	0.13
353	600373	中文传媒	50,200	668,664.00	0.13
354	000883	湖北能源	146,500	668,040.00	0.13
355	601665	齐鲁银行	170,300	667,576.00	0.13
356	002511	中顺洁柔	59,300	661,195.00	0.13
357	000825	太钢不锈	170,400	659,448.00	0.13
358	603568	伟明环保	37,647	659,198.97	0.13
359	601778	晶科科技	132,700	655,538.00	0.12
360	300776	帝尔激光	10,080	654,192.00	0.12
361	002985	北摩高科	14,743	650,461.16	0.12
362	603883	老百姓	21,741	648,968.85	0.12
363	601928	凤凰传媒	56,800	647,520.00	0.12
364	603228	景旺电子	25,140	644,841.00	0.12
365	600663	陆家嘴	65,191	643,435.17	0.12
366	600737	中粮糖业	79,193	637,503.65	0.12
367	600967	内蒙一机	63,064	636,946.40	0.12
368	603225	新凤鸣	56,878	628,501.90	0.12
369	600297	广汇汽车	301,400	626,912.00	0.12
370	600155	华创阳安	100,574	625,570.28	0.12
371	600801	华新水泥	50,425	622,748.75	0.12

372	300861	美畅股份	14,300	620,191.00	0.12
373	688778	厦钨新能	12,525	619,987.50	0.12
374	603529	爱玛科技	19,200	618,624.00	0.12
375	601098	中南传媒	53,213	617,270.80	0.12
376	300482	万孚生物	23,120	615,685.60	0.12
377	002468	申通快递	56,700	613,494.00	0.12
378	688082	盛美上海	5,525	609,960.00	0.12
379	688208	道通科技	20,054	607,836.74	0.12
380	002745	木林森	65,914	606,408.80	0.12
381	000012	南玻 A	101,633	605,732.68	0.11
382	001227	兰州银行	211,000	603,460.00	0.11
383	002032	苏泊尔	12,000	600,000.00	0.11
384	603866	桃李面包	59,256	599,670.72	0.11
385	000156	华数传媒	68,619	596,985.30	0.11
386	600871	石化油服	301,200	596,376.00	0.11
387	600500	中化国际	106,325	591,167.00	0.11
388	000581	威孚高科	37,113	584,529.75	0.11
389	688690	纳微科技	14,995	582,555.75	0.11
390	000401	冀东水泥	78,733	580,262.21	0.11
391	002867	周大生	32,500	577,850.00	0.11
392	301029	怡合达	12,920	577,265.60	0.11
393	002250	联化科技	54,687	572,026.02	0.11
394	600556	天下秀	80,400	570,036.00	0.11
395	601118	海南橡胶	126,703	567,629.44	0.11
396	601611	中国核建	67,100	566,995.00	0.11
397	688029	南微医学	6,947	566,597.32	0.11
398	600022	山东钢铁	395,780	562,007.60	0.11
399	000930	中粮科技	69,052	559,321.20	0.11
400	000785	居然之家	144,900	552,069.00	0.10
401	002010	传化智联	103,700	551,684.00	0.10
402	300850	新强联	14,700	549,486.00	0.10
403	002423	中粮资本	68,200	545,600.00	0.10
404	688006	杭可科技	17,885	544,955.95	0.10
405	601598	中国外运	116,700	543,822.00	0.10
406	601608	中信重工	128,400	540,564.00	0.10
407	600259	广晟有色	14,956	540,509.84	0.10
408	600062	华润双鹤	30,957	539,270.94	0.10
409	002505	鹏都农牧	283,311	535,457.79	0.10
410	688281	华秦科技	2,635	533,587.50	0.10
411	000559	万向钱潮	97,801	533,015.45	0.10
412	002081	金螳螂	117,900	531,729.00	0.10
413	600597	光明乳业	51,030	530,712.00	0.10
414	000089	深圳机场	75,848	527,143.60	0.10

415	600782	新钢股份	141,600	525,336.00	0.10
416	002791	坚朗五金	8,100	524,151.00	0.10
417	300618	寒锐钴业	16,100	521,801.00	0.10
418	603826	坤彩科技	10,400	520,000.00	0.10
419	000958	电投产融	119,700	518,301.00	0.10
420	600901	江苏金租	123,760	511,128.80	0.10
421	603638	艾迪精密	24,860	510,127.20	0.10
422	600707	彩虹股份	106,200	505,512.00	0.10
423	600339	中油工程	123,900	504,273.00	0.10
424	000937	冀中能源	78,448	500,498.24	0.09
425	600409	三友化工	91,700	499,765.00	0.09
426	600095	湘财股份	63,500	495,300.00	0.09
427	000898	鞍钢股份	177,300	492,894.00	0.09
428	601187	厦门银行	97,700	490,454.00	0.09
429	688276	百克生物	7,820	489,532.00	0.09
430	002761	浙江建投	32,091	487,141.38	0.09
431	603707	健友股份	35,943	485,230.50	0.09
432	000537	广宇发展	41,400	483,138.00	0.09
433	601718	际华集团	162,500	482,625.00	0.09
434	000415	渤海租赁	229,100	481,110.00	0.09
435	600507	方大特钢	103,501	479,209.63	0.09
436	688520	神州细胞	8,415	477,467.10	0.09
437	000967	盈峰环境	94,100	475,205.00	0.09
438	001914	招商积余	31,400	472,570.00	0.09
439	600167	联美控股	67,730	472,078.10	0.09
440	601568	北元集团	88,240	465,024.80	0.09
441	600968	海油发展	150,400	461,728.00	0.09
442	000563	陕国投 A	151,346	461,605.30	0.09
443	600808	马钢股份	178,635	459,091.95	0.09
444	601156	东航物流	35,300	458,900.00	0.09
445	002925	盈趣科技	23,200	450,080.00	0.09
446	300257	开山股份	29,403	446,043.51	0.08
447	002705	新宝股份	24,500	441,735.00	0.08
448	600195	中牧股份	37,794	441,433.92	0.08
449	603650	彤程新材	13,276	435,452.80	0.08
450	600126	杭钢股份	99,938	433,730.92	0.08
451	688052	纳芯微	2,720	430,766.40	0.08
452	300442	润泽科技	14,000	430,640.00	0.08
453	600764	中国海防	15,800	430,076.00	0.08
454	603379	三美股份	18,080	425,060.80	0.08
455	002608	江苏国信	56,000	423,920.00	0.08
456	688107	安路科技	7,565	419,025.35	0.08
457	688185	康希诺	5,130	418,095.00	0.08

458	000959	首钢股份	115,700	404,950.00	0.08
459	688234	天岳先进	5,440	402,233.60	0.08
460	000402	金融街	88,500	400,020.00	0.08
461	002653	海思科	16,400	387,040.00	0.07
462	601828	美凯龙	80,200	384,158.00	0.07
463	002110	三钢闽光	90,700	382,754.00	0.07
464	001203	大中矿业	33,500	372,185.00	0.07
465	002563	森马服饰	59,800	371,956.00	0.07
466	688819	天能股份	10,066	370,831.44	0.07
467	688289	圣湘生物	21,728	365,899.52	0.07
468	601298	青岛港	51,900	361,743.00	0.07
469	603786	科博达	5,500	361,350.00	0.07
470	601228	广州港	111,800	361,114.00	0.07
471	600377	宁沪高速	36,700	360,761.00	0.07
472	603056	德邦股份	22,870	352,655.40	0.07
473	600927	永安期货	21,600	351,216.00	0.07
474	600623	华谊集团	55,900	348,257.00	0.07
475	000031	大悦城	95,130	348,175.80	0.07
476	600928	西安银行	98,700	347,424.00	0.07
477	603317	天味食品	23,711	346,417.71	0.07
478	601869	长飞光纤	9,042	334,644.42	0.06
479	600350	山东高速	50,000	318,500.00	0.06
480	002399	海普瑞	27,700	317,719.00	0.06
481	601136	首创证券	22,300	315,991.00	0.06
482	601139	深圳燃气	42,600	310,554.00	0.06
483	000869	张裕 A	10,100	309,666.00	0.06
484	601969	海南矿业	45,300	298,074.00	0.06
485	001872	招商港口	17,200	297,044.00	0.06
486	600995	南网储能	26,100	287,361.00	0.05
487	002945	华林证券	20,000	273,600.00	0.05
488	000553	安道麦 A	32,300	272,612.00	0.05
489	600299	安迪苏	29,800	237,506.00	0.05
490	601158	重庆水务	42,700	237,412.00	0.05
491	688105	诺唯赞	7,565	230,656.85	0.04
492	603868	飞科电器	3,566	224,978.94	0.04
493	603355	莱克电气	8,524	216,594.84	0.04
494	688248	南网科技	5,355	205,578.45	0.04
495	600032	浙江新能	16,000	200,960.00	0.04
496	600956	新天绿能	22,600	197,072.00	0.04
497	300741	华宝股份	9,125	195,457.50	0.04
498	688295	中复神鹰	5,100	187,068.00	0.04
499	002901	大博医疗	4,300	133,644.00	0.03

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	6,912	224,244.76	0.04
2	301486	致尚科技	3,681	212,246.46	0.04
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
5	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
6	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
7	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
8	688249	晶合集成	3,172	57,286.32	0.01
9	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
10	688472	阿特斯	2,032	34,625.28	0.01
11	688469	中芯集成	5,934	32,102.94	0.01
12	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
13	301325	曼恩斯特	296	31,953.20	0.01
14	688443	智翔金泰	1,075	31,701.75	0.01
15	688361	中科飞测	475	30,718.25	0.01
16	301358	湖南裕能	680	29,165.20	0.01
17	688531	日联科技	185	25,154.45	0.00
18	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
19	688582	芯动联科	559	22,740.12	0.00
20	688458	美芯晟	218	19,785.68	0.00
21	688543	国科军工	365	19,363.25	0.00
22	688484	南芯科技	518	19,015.78	0.00
23	688352	颀中科技	1,527	18,430.89	0.00
24	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
25	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
26	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
27	688552	航天南湖	676	15,886.00	0.00
28	688507	索辰科技	129	15,752.19	0.00
29	688581	安杰思	131	15,461.93	0.00
30	301332	德尔玛	1,111	15,254.03	0.00
31	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
32	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
33	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
34	001287	中电港	691	14,524.82	0.00
35	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
36	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
37	301397	溯联股份	353	14,190.60	0.00
38	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
39	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
40	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00

41	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
42	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
43	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
44	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
45	688623	双元科技	143	12,410.97	0.00
46	601061	中信金属	1,602	12,143.16	0.00
47	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
48	301439	泓淋电力	674	11,390.60	0.00
49	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
50	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
51	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
52	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
53	301345	涛涛车业	223	10,400.72	0.00
54	301360	荣旗科技	111	10,278.60	0.00
55	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
56	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
57	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
58	603135	中重科技	534	9,553.26	0.00
59	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
60	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
61	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
62	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
63	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
64	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
65	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
66	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
67	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
68	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
69	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
70	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
71	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
72	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
73	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
74	601133	柏诚股份	502	6,154.52	0.00
75	601065	江盐集团	511	6,050.24	0.00
76	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
77	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
78	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
79	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
80	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
81	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
82	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
83	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

84	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	002463	沪电股份	2,065,234.00	0.40
2	000066	中国长城	1,975,214.00	0.38
3	600372	中航电子	1,730,717.12	0.33
4	000423	东阿阿胶	1,722,928.00	0.33
5	002240	盛新锂能	1,619,574.00	0.31
6	000933	神火股份	1,618,150.00	0.31
7	603882	金域医学	1,524,237.00	0.29
8	002008	大族激光	1,521,934.00	0.29
9	300395	菲利华	1,334,620.00	0.26
10	002600	领益智造	1,327,223.00	0.26
11	688220	翱捷科技	1,275,405.09	0.25
12	300118	东方日升	1,180,669.00	0.23
13	601966	玲珑轮胎	1,175,210.00	0.23
14	688169	石头科技	1,173,193.98	0.23
15	300487	蓝晓科技	1,169,300.00	0.23
16	002432	九安医疗	1,154,440.00	0.22
17	300595	欧普康视	1,146,394.00	0.22
18	300438	鹏辉能源	1,090,743.00	0.21
19	688072	拓荆科技	1,028,249.65	0.20
20	600481	双良节能	1,005,149.60	0.19

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	688122	西部超导	2,110,859.75	0.41
2	603345	安井食品	2,093,305.00	0.40
3	000999	华润三九	2,011,035.60	0.39
4	601607	上海医药	1,955,687.00	0.38
5	002603	以岭药业	1,903,193.49	0.37
6	603605	珀莱雅	1,750,285.48	0.34
7	300168	万达信息	1,617,583.00	0.31
8	603606	东方电缆	1,547,272.00	0.30
9	601699	潞安环能	1,539,401.00	0.30

10	601872	招商轮船	1,505,210.00	0.29
11	603613	国联股份	1,458,732.20	0.28
12	600026	中远海能	1,296,237.13	0.25
13	688063	派能科技	1,247,690.30	0.24
14	002212	天融信	1,049,717.80	0.20
15	601333	广深铁路	1,039,558.00	0.20
16	002396	星网锐捷	859,184.00	0.17
17	600728	佳都科技	849,711.00	0.16
18	600201	生物股份	849,157.96	0.16
19	300418	昆仑万维	765,951.00	0.15
20	688515	裕太微	752,856.00	0.15

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	92,335,844.22
卖出股票收入（成交）总额	96,051,526.57

注：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

报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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。

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	2,308,543.59
2	应收清算款	-
3	应收股利	100.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	10.14
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,308,653.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	212,246.46	0.04	新股未上市
2	301292	海科新源	116,421.76	0.02	新股未上市
3	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.02	新股未上市
3	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定期内
4	301202	朗威股份	79,009.20	0.01	新股未上市
5	301291	明阳电气	21,472.76	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 500 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 (%)
9,093	35,789.05	10,811,814.00	3.32	163,805,898.00	50.34	150,812,089.00	46.34

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	赵熙逸	35,715,378.00	10.97
2	方正证券股份有限公司	3,309,777.00	1.02
3	广发证券股份有限公司	2,348,553.00	0.72
4	中信证券股份有限公司	1,946,278.00	0.60
5	王春燕	1,500,000.00	0.46
6	乔夏	1,000,000.00	0.31
7	李焱	944,100.00	0.29
8	熊杰	917,500.00	0.28
9	陈轶珺	905,100.00	0.28
10	赵烨	856,500.00	0.26

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	10,000.00	0.0031

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（2015 年 5 月 13 日） 基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	334,429,801.00
本报告期基金总申购份额	22,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	31,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	325,429,801.00

§ 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

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
银河证券	5	64,134,497.09	36.38	59,086.91	49.87	-
中信建投	2	57,042,060.83	32.35	8,060.95	6.80	-
国金证券	1	52,412,542.65	29.73	48,811.50	41.19	-
东吴证券	2	2,717,726.78	1.54	2,531.32	2.14	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中银国际	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，基金租用券商交易单元新增财通证券和东北证券。

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(%)
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建	331,060.07	100.00	-	-	-	-

投						
国金证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
北京高 华	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证	-	-	-	-	-	-

券						
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

券						
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

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 14 日
8	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
9	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
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 22 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 21 日
12	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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 18 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 23 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
--	--------------------	--	--

§ 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	20230101-20230630;	155,921,989.00	453,000.00	5,562,900.00	150,812,089.00	46.34

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