

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 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 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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	79
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	79
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	83
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
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	84

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	85
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	85
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	85
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	85
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
7.12 投资组合报告附注	85
§8 基金份额持有人信息	86
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
8.2 期末上市基金前十名持有人	86
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	87
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	87
§9 开放式基金份额变动	87
§10 重大事件揭示	88
10.1 基金份额持有人大会决议	88
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	88
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
10.4 基金投资策略的改变	88
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	88
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	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	88
10.8 其他重大事件	92
§11 影响投资者决策的其他重要信息	93
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	93
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	94
§12 备查文件目录	94
12.1 备查文件目录	94
12.2 存放地点	94
12.3 查阅方式	94

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	科创板 ETF
场内简称	科创板(扩位证券简称:科创板 ETF)
基金主代码	588090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 28 日
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	3,787,472,758.00 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	2020 年 11 月 16 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；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证科创板 50 成份指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.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	北京市西城区闹市口大街 1 号院

	大五道口广场 1 号 17 层	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	上海证券报
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

§ 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	-120,958,595.20
本期利润	191,610,599.33
加权平均基金份额本期利润	0.0558
本期加权平均净值利润率	5.23%
本期基金份额净值增长率	4.66%
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	-1,487,798,154.52
期末可供分配基金份额利润	-0.3928
期末基金资产净值	3,936,465,034.76
期末基金份额净值	1.0393
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	-27.43%

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。

4、本基金于 2020 年 11 月 9 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.69829249。期末还原后基金份额累计净值=(期末基金份额净值+基金份额累计分红金额)×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买科创板 ETF 后的实际份额净值变动情况。

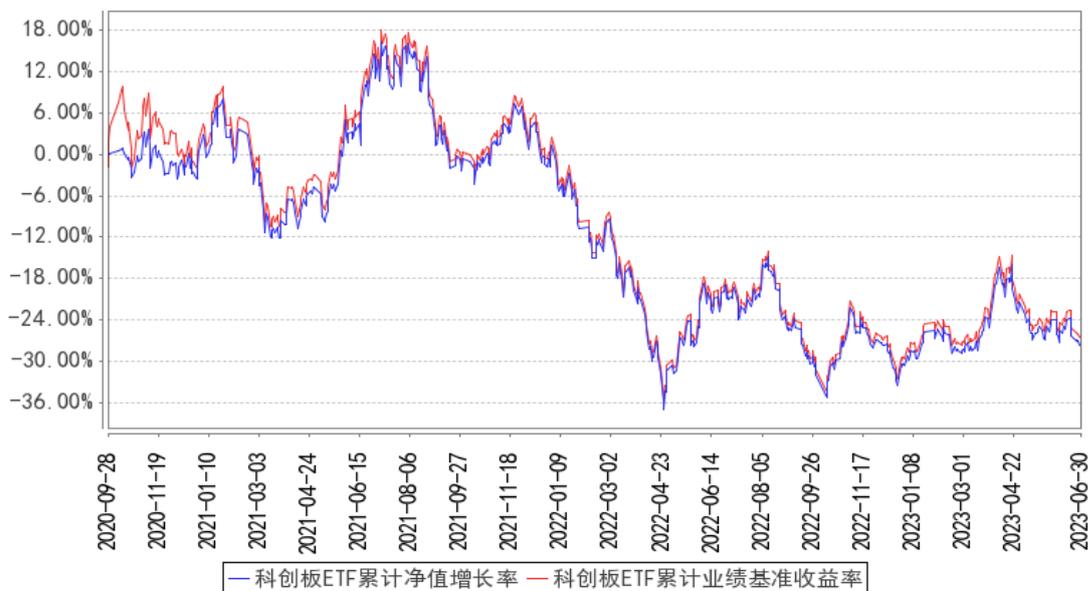
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-4.62%	1.29%	-4.63%	1.31%	0.01%	-0.02%
过去三个月	-6.84%	1.56%	-7.06%	1.57%	0.22%	-0.01%
过去六个月	4.66%	1.36%	4.71%	1.37%	-0.05%	-0.01%
过去一年	-9.48%	1.40%	-9.09%	1.40%	-0.39%	0.00%
自基金合同生效起至今	-27.43%	1.55%	-26.31%	1.59%	-1.12%	-0.04%

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

科创板ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2020 年 9 月 28 日至 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	2020年9月28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

				<p>3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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 0.013%，期间日跟踪误差为 0.029%，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 1.0393 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.66%，业绩比较基准收益率为 4.71%。

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，前期市场已经注入较多悲观预期，甚至是一些较为长期的经济需转型的问题，放大了短期经济下行的压力，究其原因还是在于重新开放后对于中国经济增长中枢的判断。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，市场风险偏好显著提振。建议关注政策友好期带来的顺周期行情。

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

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

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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的真实、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：华泰柏瑞上证科创板 50 成份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	8,922,932.52	18,208,559.64
结算备付金		1,182,175.01	1,134,273.81
存出保证金		31,967.29	13,974.20
交易性金融资产	6.4.7.2	3,928,513,321.51	3,529,224,926.48
其中：股票投资		3,928,513,321.51	3,529,224,926.48
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		835,613.53	987,908.31
应收股利		45,000.00	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	289,395.21	99,539.25
资产总计		3,939,820,405.07	3,549,669,181.69
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		11,687.41	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		72,976.14	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,605,535.95	1,511,384.54
应付托管费		321,107.18	302,276.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,344,063.63	1,256,849.96
负债合计		3,355,370.31	3,070,511.62
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	5,424,263,189.28	5,115,203,277.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,487,798,154.52	-1,568,604,607.32
净资产合计		3,936,465,034.76	3,546,598,670.07
负债和净资产总计		3,939,820,405.07	3,549,669,181.69

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0393 元，基金份额总额 3,787,472,758.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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		203,251,042.17	-614,171,776.28
1. 利息收入		3,271,746.74	1,871,891.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,521.83	39,885.31
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		3,239,224.91	1,832,006.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-112,973,669.32	-323,780,658.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-131,344,636.88	-332,054,881.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,886,605.31	786,288.64
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	14,484,362.25	7,487,934.22
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	312,569,194.53	-292,011,556.74
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	383,770.22	-251,452.83
减：二、营业总支出		11,640,442.84	9,162,099.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,086,387.70	7,120,458.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,817,277.55	1,424,091.70
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		14.67	3.77
8. 其他费用	6.4.7.23	736,762.92	617,545.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		191,610,599.33	-623,333,876.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		191,610,599.33	-623,333,876.00
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		191,610,599.33	-623,333,876.00

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	5,115,203,277. 39	-	-1,568,604,607 .32	3,546,598,670.0 7
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）	5,115,203,277. 39	-	-1,568,604,607 .32	3,546,598,670.0 7
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	309,059,911.89	-	80,806,452.80	389,866,364.69
（一）、综合收益总额	-	-	191,610,599.33	191,610,599.33
（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）	309,059,911.89	-	-110,804,146.5 3	198,255,765.36
其中：1. 基金申购款	1,940,002,578. 47	-	-496,212,526.8 0	1,443,790,051.6 7
2. 基金赎回款	-1,630,942,666 .58	-	385,408,380.27	-1,245,534,286. 31
（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）	5,424,263,189.28	-	-1,487,798,154.52	3,936,465,034.76
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）	2,914,547,761.48	-	37,940,294.95	2,952,488,056.43
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）	2,914,547,761.48	-	37,940,294.95	2,952,488,056.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,091,018,724.44	-	-832,542,799.91	258,475,924.53
（一）、综合收益总额	-	-	-623,333,876.00	-623,333,876.00
（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）	1,091,018,724.44	-	-209,208,923.91	881,809,800.53
其中：1. 基金申购款	2,625,147,442.98	-	-527,757,879.28	2,097,389,563.70
2. 基金赎回款	-1,534,128,718.54	-	318,548,955.37	-1,215,579,763.17
（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)	4,005,566,485.92	-	-794,602,504.96	3,210,963,980.96

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

华泰柏瑞上证科创板 50 成份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[2020]第 2188 号《关于准予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注册的批复》注册,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《华泰柏瑞上证科创板 50 成份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 5,498,735,457.00 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(2020)第 0852 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2020 年 9 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,498,735,457.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]364 号核准,本基金 3,839,472,758.00 份基金份额于 2020 年 11 月 16 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《华泰柏瑞上证科创板 50 成份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或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、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、金融衍生工具

(包括股指期货、股票期权、国债期货等)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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%。本基金力争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。本基金的业绩比较基准为上证科创板 50 成份指数收益率。

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》、《华泰柏瑞上证科创板 50 成份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	8,922,932.52
等于：本金	8,922,176.70
加：应计利息	755.82
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	8,922,932.52

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	4,112,301,889.00	-	3,928,513,321.51	-183,788,567.49
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	4,112,301,889.00	-	3,928,513,321.51	-183,788,567.49

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	213,778.97

待摊费用	75,616.24
合计	289,395.21

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	689,784.39
其中：交易所市场	689,784.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
应付指数使用费	545,183.30
合计	1,344,063.63

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	3,571,672,758.00	5,115,203,277.39
本期申购	1,354,600,000.00	1,940,002,578.47
本期赎回（以“-”号填列）	-1,138,800,000.00	-1,630,942,666.58
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	3,787,472,758.00	5,424,263,189.28

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	-267,890,866.65	-1,300,713,740.67	-1,568,604,607.32
本期利润	-120,958,595.20	312,569,194.53	191,610,599.33
本期基金份额交易产生的变动数	-20,026,634.51	-90,777,512.02	-110,804,146.53
其中：基金申购款	-129,202,388.74	-367,010,138.06	-496,212,526.80
基金赎回款	109,175,754.23	276,232,626.04	385,408,380.27

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-408,876,096.36	-1,078,922,058.16	-1,487,798,154.52

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		16,533.89
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		15,779.91
其他		208.03
合计		32,521.83

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		-114,289,089.50
股票投资收益——赎回差价收入		-17,055,547.38
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		-131,344,636.88

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		562,724,295.62
减：卖出股票成本总额		675,278,147.89
减：交易费用		1,735,237.23
买卖股票差价收入		-114,289,089.50

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		1,245,534,286.31
减：现金支付赎回款总额		2,673,329.31
减：赎回股票成本总额		1,259,916,504.38
减：交易费用		-
赎回差价收入		-17,055,547.38

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	4,072.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,882,533.27
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	3,886,605.31

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	25,888,763.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,001,000.00
减：应计利息总额	4,194.20
减：交易费用	1,035.80
买卖债券差价收入	3,882,533.27

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	14,484,362.25
其中：证券出借权益补偿收入	493,276.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,484,362.25

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	312,569,194.53
股票投资	312,569,194.53
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	312,569,194.53

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	383,770.22
合计	383,770.22

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	545,183.30
注册登记费	74,383.76
银行划款手续费	392.87
存托服务费	7,707.05
合计	736,762.92

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、基金销售机构
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、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“科创 50ETF 联接”）	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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	9,086,387.70	7,120,458.54
其中：支付销售机构的客户维护费	101,312.68	86,342.99

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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	1,817,277.55	1,424,091.70

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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

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

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

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：）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

						天)					
华泰证券	2023010300026131	天合光能	2023年1月3日	6,640,000.00	100,000	14	3.40	8,779.54	-	-	
华泰证券	2023010300026163	澜起科技	2023年1月3日	5,633,100.00	90,000	14	3.40	7,448.28	-	-	
华泰证券	2023010300027979	固德威	2023年1月3日	14,907,600.00	45,000	14	3.20	18,551.68	-	-	
华泰证券	2023010300028089	诺唯赞	2023年1月3日	1,105,200.00	20,000	14	3.40	1,461.32	-	-	
华泰证券	2023010300028091	大全能源	2023年1月3日	5,784,000.00	120,000	14	3.40	7,647.78	-	-	
华泰证券	2023010400018536	华熙生物	2023年1月4日	12,987,000.00	100,000	14	3.40	17,171.70	-	-	
华泰证券	2023010500017567	石头科技	2023年1月5日	2,755,100.00	10,000	14	3.40	3,642.80	-	-	
华泰证券	2023011000000721	天奈科技	2023年1月10日	10,458,500.00	130,000	14	3.20	18,592.80	-	-	
华泰证券	2023011200015779	澜起科技	2023年1月12日	6,343,000.00	100,000	14	3.40	10,783.08	-	-	
华泰证券	2023011300009686	大全能源	2023年1月13日	2,393,000.00	50,000	14	3.40	3,842.17	-	-	
华泰证券	2023011300010490	澜起科技	2023年1月13日	3,075,000.00	50,000	14	3.40	4,937.14	-	-	
华泰证券	2023011600000281	固德威	2023年1月16日	13,702,000.00	40,000	14	3.20	17,051.44	-	-	
华泰证券	2023011700022133	澜起科技	2023年1月17日	5,592,600.00	90,000	14	3.40	7,394.66	-	-	
华泰证券	2023011700022247	诺唯赞	2023年1月17日	1,219,600.00	20,000	14	3.40	1,612.52	-	-	
华泰证券	202301	大全能	2023年	5,912,40	120,000	14	3.40	7,817.	-	-	

	170002 3759	源	1月17日	0.00				46		
华泰证券	202301 170002 3839	天合光能	2023年 1月17日	7,064,000.00	100,000	14	3.40	9,340.24	-	-
华泰证券	202301 180000 0207	固德威	2023年 1月18日	5,232,150.00	15,000	14	3.20	6,511.12	-	-
华泰证券	202301 180001 3001	华熙生物	2023年 1月18日	13,150,000.00	100,000	14	3.40	17,387.16	-	-
华泰证券	202301 190001 5654	石头科技	2023年 1月19日	3,010,100.00	10,000	14	3.40	3,980.06	-	-
华泰证券	202301 300007 0625	大全能源	2023年 1月30日	2,461,500.00	50,000	14	3.40	3,254.72	-	-
华泰证券	202301 300007 2057	澜起科技	2023年 1月30日	2,992,000.00	50,000	14	3.40	3,956.12	-	-
华泰证券	202301 300007 4225	澜起科技	2023年 1月30日	5,984,000.00	100,000	14	3.40	7,912.24	-	-
华泰证券	202301 300007 6953	固德威	2023年 1月30日	15,840,800.00	40,000	14	3.20	19,712.98	-	-
华泰证券	202301 300008 0887	天奈科技	2023年 1月30日	11,076,000.00	130,000	14	3.20	13,783.42	-	-
华泰证券	202301 310002 6975	诺唯赞	2023年 1月31日	1,204,000.00	20,000	14	3.40	1,591.94	-	-
华泰证券	202301 310002 6979	天合光能	2023年 1月31日	7,137,000.00	100,000	14	3.40	9,436.70	-	-
华泰证券	202301 310002 6997	大全能源	2023年 1月31日	5,876,400.00	120,000	14	3.40	7,769.86	-	-
华泰证券	202301 310002 7091	澜起科技	2023年 1月31日	4,986,900.00	90,000	14	3.40	6,593.86	-	-
华泰证券	202302 010001 6616	固德威	2023年 2月1日	6,054,000.00	15,000	14	3.20	7,533.82	-	-

华泰证券	202302 010001 9574	华熙生 物	2023年 2月1日	12,762,0 00.00	100,000	14	3.40	16,874 .20	-	-
华泰证券	202302 020001 2463	石头科 技	2023年 2月2日	3,284,50 0.00	10,000	14	3.40	4,342. 80	-	-
华泰证券	202302 130007 8092	天奈科 技	2023年 2月13 日	10,472,8 00.00	130,000	14	3.20	13,032 .88	-	-
华泰证券	202302 130007 8188	澜起科 技	2023年 2月13 日	3,142,50 0.00	50,000	14	3.40	4,155. 06	-	-
华泰证券	202302 130007 8202	澜起科 技	2023年 2月13 日	6,285,00 0.00	100,000	14	3.40	8,310. 12	-	-
华泰证券	202302 130007 9488	固德威	2023年 2月13 日	15,240,0 00.00	40,000	14	3.20	18,965 .38	-	-
华泰证券	202302 130008 2872	大全能 源	2023年 2月13 日	2,391,00 0.00	50,000	14	3.40	3,161. 48	-	-
华泰证券	202302 140000 0791	澜起科 技	2023年 2月14 日	1,570,00 0.00	25,000	14	3.40	2,075. 92	-	-
华泰证券	202302 140000 0795	晶晨股 份	2023年 2月14 日	4,381,52 0.00	52,000	14	3.20	5,452. 58	-	-
华泰证券	202302 140002 3931	大全能 源	2023年 2月14 日	5,724,00 0.00	120,000	14	3.40	7,568. 40	-	-
华泰证券	202302 140002 3979	诺唯赞	2023年 2月14 日	1,173,20 0.00	20,000	14	3.40	1,551. 20	-	-
华泰证券	202302 140002 4015	澜起科 技	2023年 2月14 日	5,652,00 0.00	90,000	14	3.40	7,473. 20	-	-
华泰证券	202302 150001 7476	华熙生 物	2023年 2月15 日	12,677,0 00.00	100,000	14	3.40	16,761 .78	-	-
华泰证券	202302 150001 7502	固德威	2023年 2月15 日	5,580,00 0.00	15,000	14	3.20	6,944. 00	-	-
华泰证券	202302 160001	石头科 技	2023年 2月16	3,235,50 0.00	10,000	14	3.40	4,278. 12	-	-

	3675		日								
华泰证券	202302 270000 0581	澜起科 技	2023年 2月27 日	5,800,00 0.00	100,000	14	3.40	7,668. 92	-	-	
华泰证券	202302 270006 5900	澜起科 技	2023年 2月27 日	2,900,00 0.00	50,000	14	3.40	3,834. 46	-	-	
华泰证券	202302 270006 5966	固德威	2023年 2月27 日	15,342,4 00.00	40,000	14	3.20	19,092 .78	-	-	
华泰证券	202302 270006 5994	大全能 源	2023年 2月27 日	2,364,50 0.00	50,000	14	3.40	3,126. 34	-	-	
华泰证券	202302 270006 7800	天奈科 技	2023年 2月27 日	9,283,30 0.00	130,000	14	3.20	11,552 .52	-	-	
华泰证券	202302 270006 7856	澜起科 技	2023年 2月27 日	5,800,00 0.00	100,000	14	3.40	7,668. 92	-	-	
华泰证券	202302 280002 1442	晶晨股 份	2023年 2月28 日	4,139,72 0.00	52,000	14	3.20	5,151. 72	-	-	
华泰证券	202302 280002 4126	澜起科 技	2023年 2月28 日	1,444,25 0.00	25,000	14	3.40	1,909. 60	-	-	
华泰证券	202303 010001 4255	华熙生 物	2023年 3月1日	12,605,0 00.00	100,000	14	3.40	16,666 .58	-	-	
华泰证券	202303 010001 8211	固德威	2023年 3月1日	5,510,70 0.00	15,000	14	3.20	6,857. 76	-	-	
华泰证券	202303 020001 1729	石头科 技	2023年 3月2日	3,771,00 0.00	10,000	14	3.40	4,986. 10	-	-	
华泰证券	202303 130006 3012	澜起科 技	2023年 3月13 日	2,776,00 0.00	50,000	14	3.40	3,670. 52	-	-	
华泰证券	202303 130006 6358	澜起科 技	2023年 3月13 日	5,552,00 0.00	100,000	14	3.40	7,341. 04	-	-	
华泰证券	202303 130006 9706	天奈科 技	2023年 3月13 日	8,786,70 0.00	130,000	14	3.20	10,934 .56	-	-	
华泰证券	202303	澜起科	2023年	5,552,00	100,000	14	3.40	7,341.	-	-	

	130006 9722	技	3月13 日	0.00				04		
华泰证券	202303 130007 0212	大全能 源	2023年 3月13 日	2,404,50 0.00	50,000	14	3.40	3,179. 26	-	-
华泰证券	202303 140001 9704	澜起科 技	2023年 3月14 日	1,399,75 0.00	25,000	14	3.40	1,850. 80	-	-
华泰证券	202303 150001 5703	固德威	2023年 3月15 日	5,027,85 0.00	15,000	14	3.20	6,256. 88	-	-
华泰证券	202303 150001 8471	华熙生 物	2023年 3月15 日	11,165,0 00.00	100,000	14	3.40	14,762 .58	-	-
华泰证券	202303 230000 0082	寒武纪	2023年 3月23 日	501,000. 00	3,000	14	3.40	662.48	-	-
华泰证券	202303 270007 1313	澜起科 技	2023年 3月27 日	6,859,00 0.00	100,000	14	3.40	9,069. 06	-	-
华泰证券	202303 270007 1351	大全能 源	2023年 3月27 日	2,445,50 0.00	50,000	14	3.40	3,233. 44	-	-
华泰证券	202303 270007 1969	天奈科 技	2023年 3月27 日	9,128,60 0.00	130,000	14	3.20	11,360 .02	-	-
华泰证券	202303 270007 3307	澜起科 技	2023年 3月27 日	3,429,50 0.00	50,000	14	3.40	4,534. 60	-	-
华泰证券	202303 270007 3373	澜起科 技	2023年 3月27 日	6,859,00 0.00	100,000	14	3.40	9,069. 06	-	-
华泰证券	202303 280002 2281	澜起科 技	2023年 3月28 日	1,612,00 0.00	25,000	14	3.40	2,131. 36	-	-
华泰证券	202303 290001 6922	华熙生 物	2023年 3月29 日	11,195,0 00.00	100,000	14	3.40	6,343. 86	-	-
华泰证券	202304 040000 0658	澜起科 技	2023年 4月4日	1,480,00 0.00	20,000	14	3.20	1,841. 84	-	-
华泰证券	202304 040000 4804	华熙生 物	2023年 3月29 日	11,195,0 00.00	100,000	8	3.40	2,114. 62	-	-

华泰证券	202304 060001 2940	寒武纪	2023年 4月6日	624,000. 00	3,000	14	3.40	825.02	-	-
华泰证券	202304 100005 9437	澜起科 技	2023年 4月10 日	3,585,00 0.00	50,000	14	3.40	4,740. 12	-	-
华泰证券	202304 100006 1807	天奈科 技	2023年 4月10 日	8,820,50 0.00	130,000	14	3.20	10,976 .56	-	-
华泰证券	202304 100006 4821	澜起科 技	2023年 4月10 日	7,170,00 0.00	100,000	14	3.40	9,480. 38	-	-
华泰证券	202304 100006 4885	澜起科 技	2023年 4月10 日	7,170,00 0.00	100,000	14	3.40	9,480. 38	-	-
华泰证券	202304 100006 4887	大全能 源	2023年 4月10 日	2,454,00 0.00	50,000	14	3.40	3,244. 78	-	-
华泰证券	202304 110002 0472	澜起科 技	2023年 4月11 日	1,815,00 0.00	25,000	14	3.40	2,399. 88	-	-
华泰证券	202304 180000 7357	澜起科 技	2023年 4月18 日	1,413,60 0.00	20,000	14	3.20	2,010. 40	-	-
华泰证券	202304 200000 9831	寒武纪	2023年 4月20 日	798,480. 00	3,000	14	3.40	1,055. 74	-	-
华泰证券	202304 210000 2789	中控技 术	2023年 4月21 日	1,880,00 0.00	20,000	14	3.20	2,339. 54	-	-
华泰证券	202304 240001 8497	天奈科 技	2023年 4月24 日	6,991,40 0.00	130,000	14	3.20	8,700. 44	-	-
华泰证券	202304 240002 1649	澜起科 技	2023年 4月24 日	6,920,00 0.00	100,000	14	3.40	9,149. 84	-	-
华泰证券	202304 250000 1374	澜起科 技	2023年 4月25 日	10,312,5 00.00	150,000	14	3.20	12,833 .38	-	-
华泰证券	202304 250005 5173	澜起科 技	2023年 4月25 日	1,718,75 0.00	25,000	14	3.40	2,272. 62	-	-
华泰证券	202305 040002	寒武纪	2023年 5月4日	698,400. 00	3,000	14	3.40	923.44	-	-

	1461										
华泰证券	202305 040003 1865	澜起科 技	2023年 5月4日	1,187,00 0.00	20,000	14	3.20	1,477. 14			
华泰证券	202305 050001 3573	中控技 术	2023年 5月5日	1,917,80 0.00	20,000	14	3.20	2,386. 58			
华泰证券	202305 080001 6663	澜起科 技	2023年 5月8日	5,941,00 0.00	100,000	14	3.40	7,855. 26			
华泰证券	202305 080005 4451	天奈科 技	2023年 5月8日	6,734,00 0.00	130,000	14	3.20	8,380. 12			
华泰证券	202305 090001 0385	澜起科 技	2023年 5月9日	1,446,75 0.00	25,000	14	3.40	1,912. 96			
华泰证券	202305 090001 0403	澜起科 技	2023年 5月9日	8,680,50 0.00	150,000	14	3.20	10,802 .40			
华泰证券	202305 180001 7432	寒武纪	2023年 5月18 日	590,430. 00	3,000	14	3.40	780.64			
华泰证券	202305 180001 7510	澜起科 技	2023年 5月18 日	1,160,00 0.00	20,000	14	3.20	1,443. 54			
华泰证券	202305 190000 2879	晶晨股 份	2023年 5月19 日	8,576,00 0.00	100,000	14	3.20	10,672 .34			
华泰证券	202305 190000 2881	固德威	2023年 5月19 日	936,288. 00	3,600	28	3.20	2,330. 44			
华泰证券	202305 190001 0123	中控技 术	2023年 5月19 日	1,990,80 0.00	20,000	14	3.20	2,477. 44			
华泰证券	202305 220002 6876	澜起科 技	2023年 5月22 日	5,941,00 0.00	100,000	14	3.40	7,855. 26			
华泰证券	202305 220002 9408	天奈科 技	2023年 5月22 日	6,523,40 0.00	130,000	14	3.20	8,118. 04			
华泰证券	202305 230000 5736	澜起科 技	2023年 5月23 日	8,655,00 0.00	150,000	14	3.20	10,770 .62			
华泰证券	202305	澜起科	2023年	1,442,50	25,000	14	3.40	1,907.			

	230000 7960	技	5月23日	0.00					36		
华泰证券	202305 290000 1263	中国通 号	2023年 5月29 日	304,500. 00	52,500	14	1.80	213.22		-	-
华泰证券	202305 290000 1269	中国通 号	2023年 5月29 日	3,576,86 0.00	616,700	14	1.80	2,503. 76		-	-
华泰证券	202305 300001 6248	固德威	2023年 5月30 日	11,625,0 00.00	50,000	14	3.20	14,466 .62		-	-
华泰证券	202305 300001 6252	中国通 号	2023年 5月30 日	92,976.0 0	15,600	7	1.80	32.55		-	-
华泰证券	202306 010002 3528	寒武纪	2023年 6月1日	711,030. 00	3,000	14	3.40	940.10		-	-
华泰证券	202306 010002 4653	澜起科 技	2023年 6月1日	1,242,00 0.00	20,000	14	3.20	1,545. 60		-	-
华泰证券	202306 020001 2404	晶晨股 份	2023年 6月2日	9,179,00 0.00	100,000	14	3.20	11,422 .74		-	-
华泰证券	202306 020001 4326	中控技 术	2023年 6月2日	2,062,00 0.00	20,000	14	3.20	2,566. 06		-	-
华泰证券	202306 050000 1032	澜起科 技	2023年 6月5日	6,028,00 0.00	100,000	14	3.40	7,970. 34		-	-
华泰证券	202306 060001 4913	澜起科 技	2023年 6月6日	1,477,25 0.00	25,000	14	3.40	1,953. 28		-	-
华泰证券	202306 060001 6925	中国通 号	2023年 6月6日	89,076.0 0	15,600	7	1.80	31.15		-	-
华泰证券	202306 060001 7196	澜起科 技	2023年 6月6日	8,863,50 0.00	150,000	14	3.20	11,030 .18		-	-
华泰证券	202306 120002 2459	中国通 号	2023年 6月12 日	3,589,19 4.00	616,700	14	1.80	2,512. 44		-	-
华泰证券	202306 120002 2471	固德威	2023年 6月12 日	3,088,80 0.00	20,000	14	3.40	4,084. 08		-	-

华泰证券	202306 130002 1678	中国通 号	2023年 6月13 日	89,388.0 0	15,600	7	1.80	31.29	-	-
华泰证券	202306 130002 1797	固德威	2023年 6月13 日	7,524,00 0.00	50,000	14	3.20	9,363. 20	-	-
华泰证券	202306 150003 5826	寒武纪	2023年 6月15 日	633,000. 00	3,000	14	3.40	836.92	-	-
华泰证券	202306 150003 7595	澜起科 技	2023年 6月15 日	1,229,80 0.00	20,000	14	3.20	1,530. 48	-	-
华泰证券	202306 160001 8389	晶晨股 份	2023年 6月16 日	9,115,00 0.00	100,000	14	3.20	11,343 .08	-	-
华泰证券	202306 160002 0733	固德威	2023年 6月16 日	619,560. 00	3,600	28	3.20	770.98	600,69 6.00	770.98
华泰证券	202306 160002 2220	中控技 术	2023年 6月16 日	1,846,20 0.00	20,000	14	3.20	2,297. 54	-	-
华泰证券	202306 190002 0215	澜起科 技	2023年 6月19 日	6,211,00 0.00	100,000	14	3.40	6,452. 49	5,742, 000.00	6,452.4 9
华泰证券	202306 200001 0304	中国通 号	2023年 6月20 日	88,764.0 0	15,600	7	1.80	31.08	-	-
华泰证券	202306 200003 1638	澜起科 技	2023年 6月20 日	9,060,00 0.00	150,000	14	3.20	8,053. 30	8,613, 000.00	8,053.3 0
华泰证券	202306 200003 2811	澜起科 技	2023年 6月20 日	1,510,00 0.00	25,000	14	3.40	1,426. 10	1,435, 500.00	1,426.1 0
华泰证券	202306 260003 6299	中国通 号	2023年 6月26 日	3,472,02 1.00	616,700	14	1.80	694.40	3,576, 860.00	694.40
华泰证券	202306 260004 7092	固德威	2023年 6月26 日	3,361,60 0.00	20,000	14	3.40	1,269. 92	3,337, 200.00	1,269.9 2
华泰证券	202306 270002 0027	固德威	2023年 6月27 日	8,440,00 0.00	50,000	14	3.20	2,250. 66	8,343, 000.00	2,250.6 6
华泰证券	202306 270002	中国通 号	2023年 6月27 日	90,480.0 0	15,600	7	1.80	13.56	90,480 .00	13.56

	0089		日								
华泰证券	202306 290004 1555	澜起科技	2023年 6月29 日	1,113,40 0.00	20,000	14	3.20	98.97	1,148, 400.00	98.97	
华泰证券	202306 290004 4973	寒武纪	2023年 6月29 日	579,000. 00	3,000	14	3.40	54.68	564,00 0.00	54.68	
华泰证券	202306 300001 5535	中控技术	2023年 6月30 日	1,255,60 0.00	20,000	14	3.20	-	1,255, 600.00	-	
华泰证券	202306 300001 5872	晶晨股份	2023年 6月30 日	8,432,00 0.00	100,000	14	3.20	-	8,432, 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	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 040000 0464	中芯国际	2022年 1月4日	1,891,78 4.00	35,600	14	2.00	1,471. 39	-	-	
华泰证券	202201 040002 0257	康希诺	2022年 1月4日	1,112,00 0.00	4,000	14	3.40	1,470. 31	-	-	
华泰证券	202201 040002 3063	传音控 股	2022年 1月4日	433,323. 00	2,700	14	3.40	572.95	-	-	
华泰证券	202201 040002 3073	中微公 司	2022年 1月4日	2,402,20 0.00	20,000	14	3.40	3,176. 24	-	-	
华泰证券	202201 040002 3079	康希诺	2022年 1月4日	1,473,40 0.00	5,300	14	3.40	1,948. 16	-	-	
华泰证券	202201 040002 3083	恒玄科 技	2022年 1月4日	731,760. 00	2,400	14	3.40	967.55	-	-	
华泰证券	202201 040002 3085	金山办 公	2022年 1月4日	12,361,0 74.00	47,900	14	3.40	16,344 .09	-	-	
华泰证券	202201 050000 0799	传音控 股	2022年 1月5日	4,008,12 0.00	25,400	14	3.40	5,299. 63	-	-	

华泰证券	202201 050000 0801	华熙生 物	2022年 1月5日	2,960,00 0.00	20,000	14	3.40	3,913. 78	-	-
华泰证券	202201 050000 0803	天奈科 技	2022年 1月5日	1,884,39 0.00	13,800	14	3.40	2,491. 58	-	-
华泰证券	202201 050000 0805	圣湘生 物	2022年 1月5日	331,375. 00	5,500	14	3.40	438.15	-	-
华泰证券	202201 050000 0807	嘉元科 技	2022年 1月5日	412,685. 00	3,500	14	3.40	545.66	-	-
华泰证券	202201 050000 0809	心脉医 疗	2022年 1月5日	1,891,20 0.00	8,000	14	3.40	2,500. 59	-	-
华泰证券	202201 050000 0811	道通科 技	2022年 1月5日	268,380. 00	3,600	14	3.40	354.86	-	-
华泰证券	202201 050000 0813	昊海生 科	2022年 1月5日	1,128,67 3.00	9,100	14	3.40	1,492. 36	-	-
华泰证券	202201 050000 0815	泽璟制 药	2022年 1月5日	1,203,72 0.00	21,000	14	3.40	1,591. 59	-	-
华泰证券	202201 050000 0817	南微医 学	2022年 1月5日	299,250. 00	1,500	14	3.40	395.68	-	-
华泰证券	202201 050000 9063	道通科 技	2022年 1月5日	462,210. 00	6,200	14	3.40	611.14	-	-
华泰证券	202201 050000 9097	昊海生 科	2022年 1月5日	223,254. 00	1,800	14	3.40	295.19	-	-
华泰证券	202201 050000 9099	君实生 物	2022年 1月5日	343,085. 00	5,900	14	3.40	453.63	-	-
华泰证券	202201 050000 9105	昊海生 科	2022年 1月5日	260,463. 00	2,100	14	3.40	344.39	-	-
华泰证券	202201 050000 9107	海尔生 物	2022年 1月5日	1,009,18 4.00	12,200	14	3.40	1,334. 37	-	-
华泰证券	202201 050000	中微公 司	2022年 1月5日	2,378,00 0.00	20,000	14	3.40	3,144. 24	-	-

	9109										
华泰证券	202201 050000 9115	华兴源 创	2022 年 1 月 5 日	365,000. 00	10,000	14	3.40	482.61	-	-	
华泰证券	202201 050000 9117	传音控 股	2022 年 1 月 5 日	473,400. 00	3,000	14	3.40	625.94	-	-	
华泰证券	202201 050000 9119	传音控 股	2022 年 1 月 5 日	2,114,52 0.00	13,400	14	3.40	2,795. 87	-	-	
华泰证券	202201 050000 9125	西部超 导	2022 年 1 月 5 日	87,000.0 0	1,000	14	3.40	115.03	-	-	
华泰证券	202201 060001 0073	君实生 物	2022 年 1 月 6 日	476,112. 00	8,400	14	3.40	629.53	-	-	
华泰证券	202201 060001 0079	九号公 司	2022 年 1 月 6 日	148,852. 00	2,200	14	3.40	196.82	-	-	
华泰证券	202201 060001 0083	康希诺	2022 年 1 月 6 日	2,860,00 0.00	10,000	14	3.40	3,781. 56	-	-	
华泰证券	202201 060001 0087	微芯生 物	2022 年 1 月 6 日	1,034,35 8.00	29,800	14	3.40	1,367. 65	-	-	
华泰证券	202201 070000 0653	派能科 技	2022 年 1 月 7 日	201,756. 00	1,200	14	3.40	266.77	-	-	
华泰证券	202201 070000 9905	晶丰明 源	2022 年 1 月 7 日	1,404,00 0.00	5,000	14	3.40	1,856. 40	-	-	
华泰证券	202201 100001 1419	天奈科 技	2022 年 1 月 10 日	387,520. 00	2,800	14	3.40	512.39	-	-	
华泰证券	202201 100001 1423	嘉元科 技	2022 年 1 月 10 日	2,335,40 0.00	20,000	14	3.40	3,087. 92	-	-	
华泰证券	202201 100001 1427	传音控 股	2022 年 1 月 10 日	1,596,00 0.00	10,500	14	3.40	2,110. 27	-	-	
华泰证券	202201 100001 1433	固德威	2022 年 1 月 10 日	2,299,38 0.00	6,000	14	3.40	3,040. 29	-	-	
华泰证券	202201	天合光	2022 年	646,100.	10,000	14	3.40	854.29	-	-	

	100001 1755	能	1月10日	00							
华泰证券	202201 110001 1743	圣湘生物	2022年 1月11日	198,300.00	3,000	14	3.40	262.20	-	-	
华泰证券	202201 110001 3267	恒玄科技	2022年 1月11日	275,050.00	1,000	14	3.40	363.68	-	-	
华泰证券	202201 110001 3277	寒武纪	2022年 1月11日	1,736,600.00	19,000	14	3.40	2,296.17	-	-	
华泰证券	202201 110001 3279	传音控股	2022年 1月11日	2,816,000.00	20,000	14	3.40	3,723.38	-	-	
华泰证券	202201 120000 0561	圣湘生物	2022年 1月12日	2,054,085.00	29,500	14	3.40	2,715.96	-	-	
华泰证券	202201 120001 6595	博瑞医药	2022年 1月12日	2,477,520.00	72,000	14	3.40	3,275.83	-	-	
华泰证券	202201 120001 6597	海尔生物	2022年 1月12日	2,515,200.00	30,000	14	3.40	3,325.65	-	-	
华泰证券	202201 130000 0682	寒武纪	2022年 1月13日	279,300.00	3,000	14	3.40	369.30	-	-	
华泰证券	202201 130000 0684	天奈科技	2022年 1月13日	881,450.00	6,100	14	3.40	1,165.47	-	-	
华泰证券	202201 130000 0688	金山办公	2022年 1月13日	2,540,100.00	10,000	14	3.60	3,556.14	-	-	
华泰证券	202201 130001 0148	金山办公	2022年 1月13日	7,620,300.00	30,000	14	3.40	10,075.73	-	-	
华泰证券	202201 130001 0158	凯赛生物	2022年 1月13日	452,172.00	2,800	14	3.40	597.87	-	-	
华泰证券	202201 130001 0160	固德威	2022年 1月13日	2,376,500.00	7,000	14	3.40	3,142.26	-	-	
华泰证券	202201 140000 0569	中国通号	2022年 1月14日	4,089,305.00	819,500	14	2.00	3,180.57	-	-	

华泰证券	202201 140002 4084	天合光 能	2022年 1月14 日	409,320. 00	6,000	14	3.40	541.21	-	-
华泰证券	202201 140002 4094	天合光 能	2022年 1月14 日	6,822,00 0.00	100,000	14	3.40	9,020. 20	-	-
华泰证券	202201 140002 4114	虹软科 技	2022年 1月14 日	247,020. 00	6,000	14	3.40	326.62	-	-
华泰证券	202201 050000 9061	柏楚电 子	2022年 1月5日	1,684,84 2.00	4,600	28	3.40	5,251. 09	-	-
华泰证券	202201 050000 9065	优刻得	2022年 1月5日	48,420.0 0	1,800	28	3.40	150.91	-	-
华泰证券	202201 050000 9101	九号公 司	2022年 1月5日	1,611,60 0.00	23,700	28	3.40	5,022. 82	-	-
华泰证券	202201 050000 9103	道通科 技	2022年 1月5日	1,595,37 0.00	21,400	28	3.40	4,972. 24	-	-
华泰证券	202201 050000 9111	南微医 学	2022年 1月5日	418,950. 00	2,100	28	3.40	1,305. 73	-	-
华泰证券	202201 050000 9113	南微医 学	2022年 1月5日	1,536,15 0.00	7,700	28	3.40	4,787. 67	-	-
华泰证券	202201 050000 9121	凯赛生 物	2022年 1月5日	1,237,51 5.00	6,900	28	3.40	3,856. 92	-	-
华泰证券	202201 050000 9123	晶晨股 份	2022年 1月5日	2,239,92 4.00	19,400	28	3.40	6,981. 10	-	-
华泰证券	202201 170000 0598	极米科 技	2022年 1月17 日	4,940,50 0.00	10,000	14	3.40	9,798. 66	-	-
华泰证券	202201 170000 0600	容百科 技	2022年 1月17 日	5,054,00 0.00	38,000	14	3.40	10,023 .77	-	-
华泰证券	202201 170000 0602	圣湘生 物	2022年 1月17 日	70,550.0 0	1,000	14	3.40	139.92	-	-
华泰证券	202201 170000	中控技 术	2022年 1月17	1,865,75 0.00	25,000	14	3.40	3,700. 40	-	-

	0604		日								
华泰证券	202201 180002 3948	传音控 股	2022年 1月18 日	389,070. 00	2,700	14	3.40	734.91	-	-	
华泰证券	202201 180002 3952	中微公 司	2022年 1月18 日	2,367,40 0.00	20,000	14	3.40	4,471. 76	-	-	
华泰证券	202201 180002 3966	康希诺	2022年 1月18 日	1,527,14 2.00	5,300	14	3.40	2,884. 60	-	-	
华泰证券	202201 180002 3972	康希诺	2022年 1月18 日	1,152,56 0.00	4,000	14	3.40	2,177. 06	-	-	
华泰证券	202201 180002 3980	金山办 公	2022年 1月18 日	13,244,3 50.00	47,900	14	3.40	25,017 .11	-	-	
华泰证券	202201 190000 0660	微芯生 物	2022年 1月19 日	1,005,45 2.00	29,800	14	3.40	1,804. 23	-	-	
华泰证券	202201 190000 0664	容百科 技	2022年 1月19 日	6,527,48 8.00	51,200	14	3.40	11,713 .21	-	-	
华泰证券	202201 190000 9517	圣湘生 物	2022年 1月19 日	341,000. 00	5,500	14	3.40	611.91	-	-	
华泰证券	202201 190000 9871	海尔生 物	2022年 1月19 日	958,310. 00	12,200	14	3.40	1,719. 63	-	-	
华泰证券	202201 190000 9873	传音控 股	2022年 1月19 日	3,605,53 0.00	25,400	14	3.40	6,469. 92	-	-	
华泰证券	202201 190000 9875	中微公 司	2022年 1月19 日	2,337,20 0.00	20,000	14	3.40	4,193. 98	-	-	
华泰证券	202201 190000 9877	昊海生 科	2022年 1月19 日	1,068,06 7.00	9,100	14	3.40	1,916. 59	-	-	
华泰证券	202201 190000 9879	华兴源 创	2022年 1月19 日	368,800. 00	10,000	14	3.40	661.79	-	-	
华泰证券	202201 190000 9881	传音控 股	2022年 1月19 日	425,850. 00	3,000	14	3.40	764.16	-	-	
华泰证券	202201	华熙生	2022年	2,669,60	20,000	14	3.40	4,790.	-	-	

	190000 9883	物	1月19日	0.00				45		
华泰证券	202201 190000 9885	传音控 股	2022年 1月19日	1,902,130.00	13,400	14	3.40	3,413.27	-	-
华泰证券	202201 190001 0321	君实生 物	2022年 1月19日	484,036.00	5,900	14	3.40	868.58	-	-
华泰证券	202201 190001 0337	泽璟制 药	2022年 1月19日	1,093,680.00	21,000	14	3.40	1,962.55	-	-
华泰证券	202201 200000 0807	中望软 件	2022年 1月20日	333,800.00	1,000	14	3.40	567.46	-	-
华泰证券	202201 200000 8876	九号公 司	2022年 1月20日	142,736.00	2,200	14	3.40	242.65	-	-
华泰证券	202201 200000 9670	君实生 物	2022年 1月20日	693,252.00	8,400	14	3.40	1,178.53	-	-
华泰证券	202201 210001 1148	晶丰明 源	2022年 1月21日	1,236,900.00	5,000	14	3.40	1,985.91	-	-
华泰证券	202201 240000 9210	固德威	2022年 1月24日	2,412,360.00	6,000	14	3.40	3,189.68	-	-
华泰证券	202201 240000 9212	天奈科 技	2022年 1月24日	428,232.00	2,800	14	3.40	566.22	-	-
华泰证券	202201 240000 9214	嘉元科 技	2022年 1月24日	2,539,800.00	20,000	14	3.40	3,358.18	-	-
华泰证券	202201 240000 9800	传音控 股	2022年 1月24日	1,511,580.00	10,500	14	3.40	1,998.64	-	-
华泰证券	202201 240000 9816	天合光 能	2022年 1月24日	704,300.00	10,000	14	3.40	931.24	-	-
华泰证券	202201 250000 9198	圣湘生 物	2022年 1月25日	156,930.00	3,000	14	3.40	207.50	-	-
华泰证券	202201 250001 1596	恒玄科 技	2022年 1月25日	269,840.00	1,000	14	3.40	356.79	-	-

华泰证券	202201 250001 1624	寒武纪	2022年 1月25 日	1,573,39 0.00	19,000	14	3.40	2,080. 37	-	-
华泰证券	202201 250001 1632	传音控 股	2022年 1月25 日	2,817,80 0.00	20,000	14	3.40	3,725. 76	-	-
华泰证券	202201 260001 1954	博瑞医 药	2022年 1月26 日	2,412,00 0.00	72,000	14	3.40	3,189. 20	-	-
华泰证券	202201 260001 1958	海尔生 物	2022年 1月26 日	2,171,40 0.00	30,000	14	3.40	2,871. 07	-	-
华泰证券	202201 260001 1966	圣湘生 物	2022年 1月26 日	1,562,61 5.00	29,500	14	3.40	2,066. 12	-	-
华泰证券	202201 270000 0537	晶晨股 份	2022年 1月27 日	7,678,03 2.00	61,800	14	3.40	10,152 .06	-	-
华泰证券	202201 270000 0539	天合光 能	2022年 1月27 日	2,650,95 0.00	38,700	14	3.40	3,505. 15	-	-
华泰证券	202201 270000 9921	金山办 公	2022年 1月27 日	7,406,10 0.00	30,000	14	3.40	9,792. 51	-	-
华泰证券	202201 270000 9923	金山办 公	2022年 1月27 日	2,468,70 0.00	10,000	14	3.60	3,456. 18	-	-
华泰证券	202201 270000 9927	寒武纪	2022年 1月27 日	243,060. 00	3,000	14	3.40	321.38	-	-
华泰证券	202201 270000 9929	天奈科 技	2022年 1月27 日	894,870. 00	6,100	14	3.40	1,183. 22	-	-
华泰证券	202201 270000 9943	凯赛生 物	2022年 1月27 日	435,652. 00	2,800	14	3.40	576.03	-	-
华泰证券	202201 270000 9951	固德威	2022年 1月27 日	2,746,24 0.00	7,000	14	3.40	3,631. 14	-	-
华泰证券	202201 280001 8816	虹软科 技	2022年 1月28 日	231,180. 00	6,000	14	3.40	305.67	-	-
华泰证券	202201 280002	中国通 号	2022年 1月28	3,949,99 0.00	819,500	14	2.00	3,072. 21	-	-

	0694		日								
华泰证券	2022012800021446	天合光能	2022年1月28日	399,420.00	6,000	14	3.40	528.12	-	-	
华泰证券	2022020700001179	天合光能	2022年2月7日	3,046,425.00	45,300	14	3.40	4,028.05	-	-	
华泰证券	2022020700001181	圣湘生物	2022年2月7日	998,800.00	20,000	14	3.40	1,320.64	-	-	
华泰证券	2022020700001183	君实生物	2022年2月7日	482,980.00	8,200	14	3.40	638.61	-	-	
华泰证券	2022020700043907	华熙生物	2022年2月7日	2,400,200.00	20,000	14	3.40	3,173.60	-	-	
华泰证券	2022020700043913	圣湘生物	2022年2月7日	49,940.00	1,000	14	3.40	66.03	-	-	
华泰证券	2022020700043917	圣湘生物	2022年2月7日	274,670.00	5,500	14	3.40	363.17	-	-	
华泰证券	2022020700043919	君实生物	2022年2月7日	347,510.00	5,900	14	3.40	459.49	-	-	
华泰证券	2022020700043923	君实生物	2022年2月7日	494,760.00	8,400	14	3.40	654.18	-	-	
华泰证券	2022020700043925	中控技术	2022年2月7日	1,833,500.00	25,000	14	3.40	2,424.29	-	-	
华泰证券	2022020700043931	中微公司	2022年2月7日	2,400,600.00	20,000	14	3.40	3,174.13	-	-	
华泰证券	2022020700043957	传音控股	2022年2月7日	1,783,808.00	13,400	14	3.40	2,358.59	-	-	
华泰证券	2022020700043959	传音控股	2022年2月7日	3,381,248.00	25,400	14	3.40	4,470.76	-	-	
华泰证券	2022020700043973	金山办公	2022年2月7日	11,627,725.00	47,900	14	3.40	15,374.44	-	-	
华泰证券	202202	天合光	2022年	672,500.	10,000	14	3.40	889.19	-	-	

	070004 6349	能	2月7日	00							
华泰证券	202202 070004 6353	固德威	2022年 2月7日	2,447,94 0.00	6,000	14	3.40	3,236. 72	-	-	
华泰证券	202202 070004 6357	嘉元科 技	2022年 2月7日	2,413,20 0.00	20,000	14	3.40	3,190. 79	-	-	
华泰证券	202202 070004 6395	传音控 股	2022年 2月7日	1,397,76 0.00	10,500	14	3.40	1,848. 15	-	-	
华泰证券	202202 070004 6407	天奈科 技	2022年 2月7日	408,380. 00	2,800	14	3.40	539.97	-	-	
华泰证券	202202 070004 9255	康希诺	2022年 2月7日	1,040,72 0.00	4,000	14	3.40	1,376. 06	-	-	
华泰证券	202202 070004 9261	康希诺	2022年 2月7日	1,378,95 4.00	5,300	14	3.40	1,823. 28	-	-	
华泰证券	202202 070004 9271	容百科 技	2022年 2月7日	4,953,30 0.00	38,000	14	3.40	6,549. 36	-	-	
华泰证券	202202 070005 2777	海尔生 物	2022年 2月7日	933,178. 00	12,200	14	3.40	1,233. 87	-	-	
华泰证券	202202 070005 4835	九号公 司	2022年 2月7日	134,926. 00	2,200	14	3.40	178.40	-	-	
华泰证券	202202 070005 4847	极米科 技	2022年 2月7日	5,535,00 0.00	10,000	14	3.40	7,318. 50	-	-	
华泰证券	202202 070005 4849	微芯生 物	2022年 2月7日	881,484. 00	29,800	14	3.40	1,165. 52	-	-	
华泰证券	202202 070005 4853	晶丰明 源	2022年 2月7日	1,177,80 0.00	5,000	14	3.40	1,557. 31	-	-	
华泰证券	202202 070005 4861	中望软 件	2022年 2月7日	313,980. 00	1,000	14	3.40	415.15	-	-	
华泰证券	202202 070005 4897	泽璟制 药	2022年 2月7日	987,000. 00	21,000	14	3.40	1,305. 03	-	-	

华泰证券	202202 070005 9373	容百科 技	2022年 2月7日	6,673,92 0.00	51,200	14	3.40	8,824. 41	-	-
华泰证券	202202 080000 1015	天奈科 技	2022年 2月8日	916,110. 00	6,500	14	3.40	1,211. 30	-	-
华泰证券	202202 080000 1019	天合光 能	2022年 2月8日	1,668,83 4.00	27,800	14	3.40	2,206. 57	-	-
华泰证券	202202 080001 5246	传音控 股	2022年 2月8日	2,613,40 0.00	20,000	14	3.40	3,455. 50	-	-
华泰证券	202202 080001 5260	寒武纪	2022年 2月8日	1,492,07 0.00	19,000	14	3.40	1,972. 85	-	-
华泰证券	202202 080001 5670	圣湘生 物	2022年 2月8日	153,930. 00	3,000	14	3.40	203.53	-	-
华泰证券	202202 090000 0834	嘉元科 技	2022年 2月9日	140,292. 00	1,200	14	3.40	185.50	-	-
华泰证券	202202 090000 0836	天合光 能	2022年 2月9日	248,009. 00	4,100	14	3.40	327.92	-	-
华泰证券	202202 090000 0840	虹软科 技	2022年 2月9日	316,960. 00	8,000	14	3.40	419.09	-	-
华泰证券	202202 090001 6392	圣湘生 物	2022年 2月9日	1,536,65 5.00	29,500	14	3.40	2,031. 80	-	-
华泰证券	202202 090001 7360	海尔生 物	2022年 2月9日	2,251,80 0.00	30,000	14	3.40	2,977. 38	-	-
华泰证券	202202 090001 7370	博瑞医 药	2022年 2月9日	2,175,12 0.00	72,000	14	3.40	2,875. 99	-	-
华泰证券	202202 100000 0686	华兴源 创	2022年 2月10 日	105,617. 00	3,100	14	3.40	139.65	-	-
华泰证券	202202 100000 0688	晶晨股 份	2022年 2月10 日	141,252. 00	1,200	14	3.40	186.77	-	-
华泰证券	202202 100000	泽璟制 药	2022年 2月10	109,986. 00	2,300	14	3.40	145.43	-	-

	0690		日									
华泰证券	202202 100001 2258	固德威	2022年 2月10 日	2,422,14 0.00	7,000	14	3.40	3,202. 61	-	-		
华泰证券	202202 100001 3162	金山办 公	2022年 2月10 日	6,416,40 0.00	30,000	14	3.40	8,483. 91	-	-		
华泰证券	202202 100001 3166	金山办 公	2022年 2月10 日	2,138,80 0.00	10,000	14	3.60	2,994. 32	-	-		
华泰证券	202202 100001 3176	天奈科 技	2022年 2月10 日	793,000. 00	6,100	14	3.40	1,048. 52	-	-		
华泰证券	202202 100001 3178	寒武纪	2022年 2月10 日	236,760. 00	3,000	14	3.40	313.05	-	-		
华泰证券	202202 100001 4022	天合光 能	2022年 2月10 日	2,212,47 9.00	38,700	14	3.40	2,925. 39	-	-		
华泰证券	202202 110000 0506	天合光 能	2022年 2月11 日	56,500.0 0	1,000	14	3.40	74.71	-	-		
华泰证券	202202 110001 7240	中国通 号	2022年 2月11 日	4,089,30 5.00	819,500	14	2.00	3,180. 57	-	-		
华泰证券	202202 110001 8822	天合光 能	2022年 2月11 日	339,000. 00	6,000	14	3.40	448.23	-	-		
华泰证券	202202 110001 8824	虹软科 技	2022年 2月11 日	227,820. 00	6,000	14	3.40	301.23	-	-		
华泰证券	202202 140000 0401	中望软 件	2022年 2月14 日	1,078,16 0.00	4,000	14	3.40	1,425. 57	-	-		
华泰证券	202202 140000 0403	恒玄科 技	2022年 2月14 日	490,240. 00	2,000	14	3.40	648.21	-	-		
华泰证券	202202 070004 3995	南微医 学	2022年 2月7日	321,741. 00	2,100	28	3.40	850.83	-	-		
华泰证券	202202 070005 4831	九号公 司	2022年 2月7日	1,453,52 1.00	23,700	28	3.40	3,843. 76	-	-		
华泰证券	202202	道通科	2022年	1,270,73	21,400	28	3.40	3,360.	-	-		

	070005 4851	技	2月7日	2.00					38		
华泰证券	202202 070005 4855	凯赛生 物	2022年 2月7日	1,072,81 2.00	6,900	28	3.40	2,836. 99	-	-	
华泰证券	202202 070005 4877	优刻得	2022年 2月7日	39,096.0 0	1,800	28	3.40	103.39	-	-	
华泰证券	202202 070005 4883	晶晨股 份	2022年 2月7日	2,378,82 8.00	19,400	28	3.40	6,290. 68	-	-	
华泰证券	202202 210000 0530	派能科 技	2022年 2月21 日	359,064. 00	2,400	14	3.40	474.76	-	-	
华泰证券	202202 210003 5709	中控技 术	2022年 2月21 日	1,852,75 0.00	25,000	14	3.40	2,449. 75	-	-	
华泰证券	202202 210003 5735	传音控 股	2022年 2月21 日	1,344,21 0.00	10,500	14	3.40	1,777. 34	-	-	
华泰证券	202202 210003 5743	传音控 股	2022年 2月21 日	3,251,70 8.00	25,400	14	3.40	4,299. 48	-	-	
华泰证券	202202 210003 5747	海尔生 物	2022年 2月21 日	880,596. 00	12,200	14	3.40	1,164. 34	-	-	
华泰证券	202202 210003 5755	固德威	2022年 2月21 日	2,287,92 0.00	6,000	14	3.40	3,025. 14	-	-	
华泰证券	202202 210003 7685	天奈科 技	2022年 2月21 日	385,168. 00	2,800	14	3.40	509.28	-	-	
华泰证券	202202 210004 7279	圣湘生 物	2022年 2月21 日	1,019,80 0.00	20,000	14	3.40	1,348. 40	-	-	
华泰证券	202202 210004 7281	君实生 物	2022年 2月21 日	406,982. 00	5,900	14	3.40	538.12	-	-	
华泰证券	202202 210004 7283	圣湘生 物	2022年 2月21 日	50,990.0 0	1,000	14	3.40	67.42	-	-	
华泰证券	202202 210004 7285	君实生 物	2022年 2月21 日	579,432. 00	8,400	14	3.40	766.14	-	-	

华泰证券	202202 210004 7287	君实生物	2022年 2月21 日	565,636. 00	8,200	14	3.40	747.90	-	-
华泰证券	202202 210004 7289	圣湘生物	2022年 2月21 日	280,445. 00	5,500	14	3.40	370.81	-	-
华泰证券	202202 210004 7295	嘉元科技	2022年 2月21 日	2,200,00 0.00	20,000	14	3.40	2,908. 89	-	-
华泰证券	202202 210004 7299	容百科技	2022年 2月21 日	6,772,73 6.00	51,200	14	3.40	8,955. 06	-	-
华泰证券	202202 210004 7333	泽璟制药	2022年 2月21 日	971,460. 00	21,000	14	3.40	1,284. 49	-	-
华泰证券	202202 210004 7337	华熙生物	2022年 2月21 日	2,338,00 0.00	20,000	14	3.40	3,091. 36	-	-
华泰证券	202202 210004 7349	中望软件	2022年 2月21 日	264,620. 00	1,000	14	3.40	349.89	-	-
华泰证券	202202 210004 7361	极米科技	2022年 2月21 日	4,615,00 0.00	10,000	14	3.40	6,102. 06	-	-
华泰证券	202202 220000 0521	固德威	2022年 2月22 日	762,000. 00	2,000	14	3.40	1,007. 53	-	-
华泰证券	202202 220001 1067	传音控股	2022年 2月22 日	2,517,20 0.00	20,000	14	3.40	3,328. 30	-	-
华泰证券	202202 220001 1073	寒武纪	2022年 2月22 日	1,592,01 0.00	19,000	14	3.40	2,104. 99	-	-
华泰证券	202202 220001 1077	天合光能	2022年 2月22 日	1,762,52 0.00	27,800	14	3.40	2,330. 44	-	-
华泰证券	202202 220001 1079	天奈科技	2022年 2月22 日	879,905. 00	6,500	14	3.40	1,163. 43	-	-
华泰证券	202202 220001 1089	圣湘生物	2022年 2月22 日	149,370. 00	3,000	14	3.40	197.50	-	-
华泰证券	202202 230000	君实生物	2022年 2月23	69,800.0 0	1,000	14	3.40	92.29	-	-

	0621		日								
华泰证券	202202 230000 0623	柏楚电 子	2022年 2月23 日	679,074. 00	2,200	14	3.40	897.89	-	-	
华泰证券	202202 230000 0627	博瑞医 药	2022年 2月23 日	29,400.0 0	1,000	14	3.40	38.87	-	-	
华泰证券	202202 230001 1586	博瑞医 药	2022年 2月23 日	2,116,80 0.00	72,000	14	3.40	2,798. 88	-	-	
华泰证券	202202 230001 3528	圣湘生 物	2022年 2月23 日	1,483,85 0.00	29,500	14	3.40	1,961. 98	-	-	
华泰证券	202202 230001 3536	海尔生 物	2022年 2月23 日	2,200,50 0.00	30,000	14	3.40	2,909. 55	-	-	
华泰证券	202202 240001 1327	天合光 能	2022年 2月24 日	2,625,79 5.00	38,700	14	3.40	3,471. 88	-	-	
华泰证券	202202 240001 1335	金山办 公	2022年 2月24 日	2,076,50 0.00	10,000	14	3.60	2,907. 10	-	-	
华泰证券	202202 240001 1337	金山办 公	2022年 2月24 日	6,229,50 0.00	30,000	14	3.40	8,236. 78	-	-	
华泰证券	202202 240001 1993	固德威	2022年 2月24 日	2,688,00 0.00	7,000	14	3.40	3,554. 13	-	-	
华泰证券	202202 240001 1995	天奈科 技	2022年 2月24 日	903,959. 00	6,100	14	3.40	1,195. 23	-	-	
华泰证券	202202 250000 0400	寒武纪	2022年 2月25 日	482,940. 00	6,000	14	3.40	638.55	-	-	
华泰证券	202202 250001 8985	中国通 号	2022年 2月25 日	3,966,38 0.00	819,500	14	2.00	3,084. 96	-	-	
华泰证券	202202 250001 9383	虹软科 技	2022年 2月25 日	225,540. 00	6,000	14	3.40	298.21	-	-	
华泰证券	202202 250001 9385	天合光 能	2022年 2月25 日	72,020.0 0	1,000	14	3.40	95.23	-	-	
华泰证券	202203	容百科	2022年	6,479,36	51,200	14	3.40	8,567.	-	-	

	070003 6396	技	3月7日	0.00				15		
华泰证券	202203 070003 6664	固德威	2022年 3月7日	2,615,40 0.00	6,000	14	3.40	3,458. 14	-	-
华泰证券	202203 070003 6666	圣湘生 物	2022年 3月7日	928,200. 00	20,000	14	3.40	1,227. 29	-	-
华泰证券	202203 070003 6670	圣湘生 物	2022年 3月7日	46,410.0 0	1,000	14	3.40	61.36	-	-
华泰证券	202203 070003 6672	传音控 股	2022年 3月7日	3,246,88 2.00	25,400	14	3.40	4,293. 10	-	-
华泰证券	202203 070003 6674	传音控 股	2022年 3月7日	1,342,21 5.00	10,500	14	3.40	1,774. 71	-	-
华泰证券	202203 070003 6698	中控技 术	2022年 3月7日	1,978,75 0.00	25,000	14	3.40	2,616. 35	-	-
华泰证券	202203 070003 6704	华熙生 物	2022年 3月7日	2,303,00 0.00	20,000	14	3.40	3,045. 08	-	-
华泰证券	202203 070003 6708	派能科 技	2022年 3月7日	327,600. 00	2,400	14	3.40	433.16	-	-
华泰证券	202203 070003 6712	嘉元科 技	2022年 3月7日	1,942,00 0.00	20,000	14	3.40	2,567. 76	-	-
华泰证券	202203 070003 6714	极米科 技	2022年 3月7日	3,845,00 0.00	10,000	14	3.40	5,083. 94	-	-
华泰证券	202203 070003 7862	中望软 件	2022年 3月7日	246,000. 00	1,000	14	3.40	325.27	-	-
华泰证券	202203 070004 4872	天奈科 技	2022年 3月7日	377,972. 00	2,800	14	3.40	499.76	-	-
华泰证券	202203 080001 2958	固德威	2022年 3月8日	837,760. 00	2,000	14	3.40	1,107. 70	-	-
华泰证券	202203 080001 2962	圣湘生 物	2022年 3月8日	130,920. 00	3,000	14	3.40	173.11	-	-

华泰证券	202203 080001 2964	寒武纪	2022年 3月8日	1,642,930.00	19,000	14	3.40	2,172.32	-	-
华泰证券	202203 080001 2968	传音控股	2022年 3月8日	2,416,200.00	20,000	14	3.40	3,194.75	-	-
华泰证券	202203 080001 2990	天合光能	2022年 3月8日	2,034,682.00	27,800	14	3.40	2,690.30	-	-
华泰证券	202203 080001 5720	天奈科技	2022年 3月8日	876,525.00	6,500	14	3.40	1,158.96	-	-
华泰证券	202203 090001 5783	海尔生物	2022年 3月9日	2,096,400.00	30,000	14	3.40	2,771.91	-	-
华泰证券	202203 090001 8105	圣湘生物	2022年 3月9日	1,265,550.00	29,500	14	3.40	1,673.34	-	-
华泰证券	202203 100001 2540	固德威	2022年 3月10日	2,953,930.00	7,000	14	3.40	3,905.75	-	-
华泰证券	202203 100001 2542	金山办公	2022年 3月10日	5,640,000.00	30,000	14	3.40	7,457.33	-	-
华泰证券	202203 100001 2544	金山办公	2022年 3月10日	1,880,000.00	10,000	14	3.60	2,632.00	-	-
华泰证券	202203 100001 3036	天奈科技	2022年 3月10日	871,690.00	6,100	14	3.40	1,152.57	-	-
华泰证券	202203 100001 3038	天合光能	2022年 3月10日	2,849,094.00	38,700	14	3.40	3,767.14	-	-
华泰证券	202203 110001 6148	虹软科技	2022年 3月11日	186,120.00	6,000	14	3.40	246.09	-	-
华泰证券	202203 210003 2909	派能科技	2022年 3月21日	301,968.00	2,400	14	3.40	456.31	-	-
华泰证券	202203 210003 2917	天奈科技	2022年 3月21日	425,600.00	2,800	14	3.40	643.13	-	-
华泰证券	202203 210003	固德威	2022年 3月21日	2,367,000.00	6,000	14	3.40	3,576.80	-	-

	2921		日								
华泰证券	202203 210003 2929	嘉元科 技	2022年 3月21 日	1,911,60 0.00	20,000	14	3.40	2,888. 64	-	-	
华泰证券	202203 210003 2937	极米科 技	2022年 3月21 日	3,590,00 0.00	10,000	14	3.40	5,424. 89	-	-	
华泰证券	202203 210003 5021	容百科 技	2022年 3月21 日	7,068,16 0.00	51,200	14	3.40	10,680 .78	-	-	
华泰证券	202203 210003 5027	华熙生 物	2022年 3月21 日	2,308,40 0.00	20,000	14	3.40	3,488. 25	-	-	
华泰证券	202203 210003 5037	中控技 术	2022年 3月21 日	1,863,75 0.00	25,000	14	3.40	2,816. 33	-	-	
华泰证券	202203 210003 5041	圣湘生 物	2022年 3月21 日	934,800. 00	20,000	14	3.40	1,412. 59	-	-	
华泰证券	202203 210003 5043	圣湘生 物	2022年 3月21 日	46,740.0 0	1,000	14	3.40	70.63	-	-	
华泰证券	202203 220001 4271	天合光 能	2022年 3月22 日	1,834,80 0.00	27,800	14	3.40	2,599. 30	-	-	
华泰证券	202203 220001 4273	圣湘生 物	2022年 3月22 日	134,310. 00	3,000	14	3.40	190.27	-	-	
华泰证券	202203 220001 4287	天奈科 技	2022年 3月22 日	978,900. 00	6,500	14	3.40	1,386. 78	-	-	
华泰证券	202203 220001 4289	寒武纪	2022年 3月22 日	1,231,96 0.00	19,000	14	3.40	1,745. 28	-	-	
华泰证券	202203 220001 4291	传音控 股	2022年 3月22 日	1,994,40 0.00	20,000	14	3.40	2,825. 40	-	-	
华泰证券	202203 220001 4307	固德威	2022年 3月22 日	751,000. 00	2,000	14	3.40	1,063. 92	-	-	
华泰证券	202203 230001 2495	圣湘生 物	2022年 3月23 日	1,335,76 0.00	29,500	14	3.40	1,766. 17	-	-	
华泰证券	202203	海尔生	2022年	2,241,30	30,000	14	3.40	2,963.	-	-	

	230001 2511	物	3月23 日	0.00				50		
华泰证券	202203 240001 2789	金山办 公	2022年 3月24 日	1,921,10 0.00	10,000	14	3.60	2,689. 54	-	-
华泰证券	202203 240001 2791	金山办 公	2022年 3月24 日	5,763,30 0.00	30,000	14	3.40	7,620. 36	-	-
华泰证券	202203 240001 2795	天奈科 技	2022年 3月24 日	907,192. 00	6,100	14	3.40	1,199. 51	-	-
华泰证券	202203 240001 2801	固德威	2022年 3月24 日	2,628,50 0.00	7,000	14	3.40	3,475. 46	-	-
华泰证券	202203 240001 2805	天合光 能	2022年 3月24 日	2,517,43 5.00	38,700	14	3.40	3,328. 61	-	-
华泰证券	202203 250001 8796	虹软科 技	2022年 3月25 日	175,560. 00	6,000	14	3.40	232.13	-	-
华泰证券	202203 240000 0371	柏楚电 子	2022年 3月24 日	6,019,80 0.00	20,000	28	3.40	10,802 .20	-	-
华泰证券	202204 060004 8673	天奈科 技	2022年 4月6日	888,875. 00	6,500	14	3.40	1,175. 29	-	-
华泰证券	202204 060004 8675	天奈科 技	2022年 4月6日	382,900. 00	2,800	14	3.40	506.28	-	-
华泰证券	202204 060005 6665	圣湘生 物	2022年 4月6日	136,590. 00	3,000	14	3.40	180.60	-	-
华泰证券	202204 060005 6669	圣湘生 物	2022年 4月6日	45,530.0 0	1,000	14	3.40	60.20	-	-
华泰证券	202204 060005 6673	圣湘生 物	2022年 4月6日	1,343,13 5.00	29,500	14	3.40	1,775. 92	-	-
华泰证券	202204 060006 4117	固德威	2022年 4月6日	1,908,96 0.00	6,000	14	3.40	2,524. 07	-	-
华泰证券	202204 060006 5865	派能科 技	2022年 4月6日	317,136. 00	2,400	14	3.40	419.32	-	-

华泰证券	202204 060006 5871	中控技术	2022年 4月6日	1,675,00 0.00	25,000	14	3.40	2,214. 72	-	-
华泰证券	202204 060006 6077	传音控股	2022年 4月6日	1,876,40 0.00	20,000	14	3.40	2,481. 02	-	-
华泰证券	202204 060006 6079	寒武纪	2022年 4月6日	1,192,25 0.00	19,000	14	3.40	1,576. 42	-	-
华泰证券	202204 060006 6081	容百科技	2022年 4月6日	6,348,80 0.00	51,200	14	3.40	8,394. 52	-	-
华泰证券	202204 060006 6083	天合光能	2022年 4月6日	1,554,29 8.00	27,800	14	3.40	2,055. 13	-	-
华泰证券	202204 060006 6099	海尔生物	2022年 4月6日	2,181,30 0.00	30,000	14	3.40	2,884. 16	-	-
华泰证券	202204 060006 6103	极米科技	2022年 4月6日	3,961,60 0.00	10,000	14	3.40	5,238. 12	-	-
华泰证券	202204 070001 2866	天合光能	2022年 4月7日	2,024,01 0.00	38,700	14	3.40	2,676. 19	-	-
华泰证券	202204 070001 2868	金山办公	2022年 4月7日	5,408,40 0.00	30,000	14	3.40	7,151. 11	-	-
华泰证券	202204 070001 2870	金山办公	2022年 4月7日	1,802,80 0.00	10,000	14	3.60	2,523. 92	-	-
华泰证券	202204 070001 2882	天奈科技	2022年 4月7日	836,005. 00	6,100	14	3.40	1,105. 38	-	-
华泰证券	202204 070001 2884	固德威	2022年 4月7日	2,123,80 0.00	7,000	14	3.40	2,808. 14	-	-
华泰证券	202204 080001 4809	虹软科技	2022年 4月8日	162,120. 00	6,000	14	3.40	214.36	-	-
华泰证券	202204 180000 0699	海尔生物	2022年 4月18 日	5,352,00 0.00	80,000	14	3.40	8,592. 93	-	-
华泰证券	202204 200003	容百科技	2022年 4月20	5,087,74 4.00	51,200	14	3.40	7,207. 64	-	-

	8484		日								
华泰证券	202204 200003 8522	中控技术	2022年 4月20 日	1,625,25 0.00	25,000	14	3.40	2,302. 44		-	-
华泰证券	202204 200003 8536	天合光能	2022年 4月20 日	1,428,64 2.00	27,800	14	3.40	2,023. 91		-	-
华泰证券	202204 200004 6430	传音控股	2022年 4月20 日	1,789,40 0.00	20,000	14	3.40	2,534. 98		-	-
华泰证券	202204 200004 6440	寒武纪	2022年 4月20 日	1,125,56 0.00	19,000	14	3.40	1,594. 54		-	-
华泰证券	202204 200004 6458	海尔生物	2022年 4月20 日	1,941,90 0.00	30,000	14	3.40	2,751. 03		-	-
华泰证券	202204 200004 6466	圣湘生物	2022年 4月20 日	42,220.0 0	1,000	14	3.40	59.81		-	-
华泰证券	202204 200004 6468	圣湘生物	2022年 4月20 日	126,660. 00	3,000	14	3.40	179.44		-	-
华泰证券	202204 200004 6474	极米科技	2022年 4月20 日	3,520,00 0.00	10,000	14	3.40	4,986. 67		-	-
华泰证券	202204 200004 6906	派能科技	2022年 4月20 日	364,224. 00	2,400	14	3.40	515.98		-	-
华泰证券	202204 210001 2019	天合光能	2022年 4月21 日	1,872,30 6.00	38,700	14	3.40	2,475. 60		-	-
华泰证券	202204 210001 2023	天奈科技	2022年 4月21 日	707,722. 00	6,100	14	3.40	935.77		-	-
华泰证券	202204 210001 2035	金山办公	2022年 4月21 日	1,768,90 0.00	10,000	14	3.60	2,476. 46		-	-
华泰证券	202204 210001 2037	金山办公	2022年 4月21 日	5,306,70 0.00	30,000	14	3.40	7,016. 64		-	-
华泰证券	202204 210001 2039	固德威	2022年 4月21 日	1,560,93 0.00	7,000	14	3.40	2,063. 90		-	-
华泰证券	202204	虹软科	2022年	147,900.	6,000	14	3.40	195.56		-	-

	220001 6540	技	4月22 日	00							
华泰证券	202204 210001 2033	柏楚电 子	2022年 4月21 日	5,055.00 0.00	20,000	28	3.40	13,367 .67			
华泰证券	202205 050007 0265	金山办 公	2022年 5月5日	5,781.30 0.00	30,000	14	3.40	7,644. 16			
华泰证券	202205 050007 0267	金山办 公	2022年 5月5日	1,927.10 0.00	10,000	14	3.60	2,697. 94			
华泰证券	202205 050007 0285	天合光 能	2022年 5月5日	2,015.49 6.00	38,700	14	3.40	2,664. 93			
华泰证券	202205 050007 0297	传音控 股	2022年 5月5日	1,690.00 0.00	20,000	14	3.40	2,234. 56			
华泰证券	202205 050007 0313	圣湘生 物	2022年 5月5日	44,300.0 0	1,000	14	3.40	58.57			
华泰证券	202205 050007 0323	圣湘生 物	2022年 5月5日	132,900. 00	3,000	14	3.40	175.72			
华泰证券	202205 050007 0335	寒武纪	2022年 5月5日	1,005.10 0.00	19,000	14	3.40	1,328. 97			
华泰证券	202205 050007 0341	固德威	2022年 5月5日	1,270.50 0.00	7,000	14	3.40	1,679. 88			
华泰证券	202205 050007 0345	海尔生 物	2022年 5月5日	2,134.20 0.00	30,000	14	3.40	2,821. 89			
华泰证券	202205 050007 0347	海尔生 物	2022年 5月5日	5,691.20 0.00	80,000	14	3.40	7,525. 03			
华泰证券	202205 050007 0349	天奈科 技	2022年 5月5日	695,400. 00	6,100	14	3.40	919.47			
华泰证券	202205 050007 0359	中控技 术	2022年 5月5日	1,637.50 0.00	25,000	14	3.40	2,165. 14			
华泰证券	202205 050007 0363	容百科 技	2022年 5月5日	4,618.24 0.00	51,200	14	3.40	6,106. 34			

华泰证券	202205 050007 4147	极米科 技	2022年 5月5日	3,590,00 0.00	10,000	14	3.40	4,746. 78	-	-
华泰证券	202205 060000 0399	九号公 司	2022年 5月6日	721,000. 00	20,000	14	3.40	953.32	-	-
华泰证券	202205 060000 0401	海尔生 物	2022年 5月6日	718,500. 00	10,000	14	3.40	950.02	-	-
华泰证券	202205 060001 4331	虹软科 技	2022年 5月6日	134,040. 00	6,000	14	3.40	177.23	-	-
华泰证券	202205 160000 0660	大全能 源	2022年 5月16 日	9,181,70 0.00	170,000	14	3.40	12,140 .25	-	-
华泰证券	202205 190004 2623	圣湘生 物	2022年 5月19 日	127,950. 00	3,000	14	3.40	169.18	-	-
华泰证券	202205 190004 2625	圣湘生 物	2022年 5月19 日	42,650.0 0	1,000	14	3.40	56.39	-	-
华泰证券	202205 190004 2629	海尔生 物	2022年 5月19 日	5,597,60 0.00	80,000	14	3.40	7,401. 27	-	-
华泰证券	202205 190004 2631	海尔生 物	2022年 5月19 日	2,099,10 0.00	30,000	14	3.40	2,775. 48	-	-
华泰证券	202205 190004 2633	极米科 技	2022年 5月19 日	3,798,80 0.00	10,000	14	3.40	5,022. 86	-	-
华泰证券	202205 190004 2635	寒武纪	2022年 5月19 日	1,046,14 0.00	19,000	14	3.40	1,383. 23	-	-
华泰证券	202205 190004 4973	天奈科 技	2022年 5月19 日	822,768. 00	6,100	14	3.40	1,087. 88	-	-
华泰证券	202205 190004 4983	中控技 术	2022年 5月19 日	1,739,50 0.00	25,000	14	3.40	2,300. 01	-	-
华泰证券	202205 190004 4991	金山办 公	2022年 5月19 日	2,076,00 0.00	10,000	14	3.60	2,906. 40	-	-
华泰证券	202205 190004	金山办 公	2022年 5月19	6,228,00 0.00	30,000	14	3.40	8,234. 80	-	-

	4995		日									
华泰证券	202205 190004 4999	固德威	2022年 5月19 日	1,788,36 0.00	7,000	14	3.40	2,364. 61				
华泰证券	202205 190004 5009	天合光 能	2022年 5月19 日	2,460,54 6.00	38,700	14	3.40	3,253. 39				
华泰证券	202205 200001 4596	海尔生 物	2022年 5月20 日	716,000. 00	10,000	14	3.40	1,149. 58				
华泰证券	202205 200001 4602	九号公 司	2022年 5月20 日	861,000. 00	20,000	14	3.40	1,382. 38				
华泰证券	202205 240000 0822	圣湘生 物	2022年 5月24 日	2,878,80 0.00	60,000	14	3.40	3,806. 41				
华泰证券	202205 300000 4360	大全能 源	2022年 5月30 日	10,021,5 00.00	170,000	14	3.40	13,250 .65				
华泰证券	202205 190004 9811	柏楚电 子	2022年 5月19 日	5,746,60 0.00	20,000	28	3.40	15,196 .56				
华泰证券	202206 020001 5164	金山办 公	2022年 6月2日	2,102,30 0.00	10,000	14	3.60	2,943. 22				
华泰证券	202206 020001 5166	海尔生 物	2022年 6月2日	6,038,40 0.00	80,000	14	3.40	7,984. 11				
华泰证券	202206 020001 5178	天奈科 技	2022年 6月2日	843,325. 00	6,100	14	3.40	1,115. 06				
华泰证券	202206 020002 2080	天合光 能	2022年 6月2日	2,396,69 1.00	38,700	14	3.40	3,168. 96				
华泰证券	202206 020002 2084	金山办 公	2022年 6月2日	6,306,90 0.00	30,000	14	3.40	8,339. 12				
华泰证券	202206 020002 2088	中控技 术	2022年 6月2日	1,975,00 0.00	25,000	14	3.40	2,611. 39				
华泰证券	202206 020002 2090	圣湘生 物	2022年 6月2日	32,650.0 0	1,000	14	3.40	43.17				
华泰证券	202206	固德威	2022年	1,970,43	7,000	14	3.40	2,605.				

	020002 2112		6月2日	0.00				35		
华泰证券	202206 060001 1194	海尔生 物	2022年 6月6日	765,800. 00	10,000	14	3.40	1,012. 56	-	-
华泰证券	202206 060001 1196	九号公 司	2022年 6月6日	1,100,00 0.00	20,000	14	3.40	1,454. 44	-	-
华泰证券	202206 070000 8712	圣湘生 物	2022年 6月7日	1,951,80 0.00	60,000	14	3.40	2,580. 71	-	-
华泰证券	202206 130002 1675	大全能 源	2022年 6月13 日	12,138,0 00.00	170,000	14	3.40	16,049 .13	-	-
华泰证券	202206 160001 4929	中控技 术	2022年 6月16 日	1,933,75 0.00	25,000	14	3.40	2,556. 85	-	-
华泰证券	202206 160001 4945	海尔生 物	2022年 6月16 日	5,992,80 0.00	80,000	14	3.40	7,923. 81	-	-
华泰证券	202206 160001 5565	金山办 公	2022年 6月16 日	2,070,70 0.00	10,000	14	3.60	2,898. 98	-	-
华泰证券	202206 160001 5567	天合光 能	2022年 6月16 日	2,304,97 2.00	38,700	14	3.40	3,047. 69	-	-
华泰证券	202206 160001 5573	天奈科 技	2022年 6月16 日	890,966. 00	6,100	14	3.40	1,178. 06	-	-
华泰证券	202206 200001 2288	九号公 司	2022年 6月20 日	929,000. 00	20,000	14	3.40	877.39	890,00 0.00	877.39
华泰证券	202206 160001 4941	柏楚电 子	2022年 6月16 日	4,154,20 0.00	20,000	28	3.40	5,492. 78	4,400, 800.00	5,492.7 8
华泰证券	202206 210000 9086	圣湘生 物	2022年 6月21 日	1,819,80 0.00	60,000	14	3.40	1,546. 83	1,776, 600.00	1,546.8 3
华泰证券	202206 270001 5380	大全能 源	2022年 6月27 日	11,393,4 00.00	170,000	14	3.40	3,228. 13	11,614 ,400.0 0	3,228.1 3
华泰证券	202206 300001 6003	XD天奈 科	2022年 6月30 日	1,033,82 8.00	6,100	14	3.40	-	1,033, 828.00	-

华泰证券	202206 300001 6011	海尔生 物	2022年 6月30 日	5,826,40 0.00	80,000	14	3.40	-	5,826, 400.00	-
华泰证券	202206 300001 9523	金山办 公	2022年 6月30 日	1,971,20 0.00	10,000	14	3.60	-	1,971, 200.00	-
华泰证券	202206 300001 9527	中控技 术	2022年 6月30 日	1,819,00 0.00	25,000	14	3.40	-	1,819, 000.00	-

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自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（%）
华泰柏瑞上 证科创板50 成份交易型 开放式指数 证券投资基金	1,182,584,952.00	31.2236	819,397,373.00	22.9416
华泰证券股 份有限公司	4,229,389.00	0.1117	2,833,740.00	0.0793

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	8,922,932.52	16,533.89	15,559,535.60	21,557.59

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	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	137,994	785,185.86
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	62,602	694,882.20
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	118034	晶能转债	网上配售	49,070	4,907,000.00
华泰联合证券	118031	天 23 转债	网上配售	170,940	17,094,000.00
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
-	-	-	-	-	-

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
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-

				期 内							
601133	柏 诚 股 份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-	
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	628	11,178.40	11,234.92	-	
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 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	7,405	147,063.30	133,734.30	-	
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	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
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	-
688435	英方软件	2023年1月12日	6个月	新股锁定期内	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯	2023年4	6个月	新股	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-

	集成	月 28 日		锁定期内							
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-	
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	1,008	40,309.92	37,003.68	-	
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-	
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	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-	

				期 内							
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	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定期内	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-	
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	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-	
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	688005	容百科技	2023年7月3日-2023年7月18日	54.02	215,000	11,614,300.00
2	688256	寒武纪	2023年7月13日	188.00	167,000	31,396,000.00
3	688390	固德威	2023年7月10日-2023年7月14日	166.86	73,600	12,280,896.00
4	688396	华润微	2023年7月13日	52.41	4,400	230,604.00
5	688521	芯原股份	2023年7月13日	71.92	7,200	517,824.00
6	688536	思瑞浦	2023年7月10日	218.00	6,000	1,308,000.00
7	688777	中控技术	2023年7月5日-2023年7月28日	62.78	422,000	26,493,160.00
8	689009	九号公司	2023年7月24日	36.85	300,000	11,055,000.00
9	688008	澜起科技	2023年7月3日-2023年7月14日	57.42	709,900	40,762,458.00
10	688009	中国通号	2023年7月4日-2023年7月10日	5.80	632,300	3,667,340.00
11	688032	禾迈股份	2023年7月4日	355.15	10,000	3,551,500.00
12	688036	传音控股	2023年7月11日-2023年7月14日	147.00	243,800	35,838,600.00
13	688063	派能科技	2023年7月4日-2023年7月10日	198.25	75,000	14,868,750.00

14	688099	晶晨股份	2023年7月13日-2023年7月14日	84.32	120,000	10,118,400.00
15	688111	金山办公	2023年7月4日-2023年7月14日	472.22	162,600	76,782,972.00
16	688169	石头科技	2023年7月14日-2023年7月26日	320.68	43,000	13,789,240.00
合计	-	-	-	-	3,191,800	294,275,044.00

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	8,922,932.52	-	-	-	-	-	8,922,932.52
结算备付金	1,182,175.01	-	-	-	-	-	1,182,175.01
存出保证金	31,967.29	-	-	-	-	-	31,967.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,928,513,321.51	3,928,513,321.51
应收股利	-	-	-	-	-	45,000.00	45,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	835,613.53	835,613.53
其他资产	-	-	-	-	-	289,395.21	289,395.21
资产总计	10,137,074.82	-	-	-	-	3,929,683,330.25	3,939,820,405.07
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	11,687.41	11,687.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,605,535.95	1,605,535.95
应付托管费	-	-	-	-	-	321,107.18	321,107.18

应付清算款	-	-	-	-	-	72,976.14	72,976.14
其他负债	-	-	-	-	-	1,344,063.63	1,344,063.63
负债总计	-	-	-	-	-	3,355,370.31	3,355,370.31
利率敏感度缺口	10,137,074.82	-	-	-	-	-3,926,327,959.94	3,936,465,034.76
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	18,208,559.64	-	-	-	-	-	18,208,559.64
结算备付金	1,134,273.81	-	-	-	-	-	1,134,273.81
存出保证金	13,974.20	-	-	-	-	-	13,974.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-3,529,224,926.48	3,529,224,926.48
应收清算款	-	-	-	-	-	987,908.31	987,908.31
其他资产	-	-	-	-	-	99,539.25	99,539.25
资产总计	19,356,807.65	-	-	-	-	-3,530,312,374.04	3,549,669,181.69
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,511,384.54	1,511,384.54
应付托管费	-	-	-	-	-	302,276.91	302,276.91
应交税费	-	-	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	-	-	1,256,849.96	1,256,849.96
负债总计	-	-	-	-	-	3,070,511.62	3,070,511.62
利率敏感度缺口	19,356,807.65	-	-	-	-	-3,527,241,862.42	3,546,598,670.07

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，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	3,928,513,321.51	99.80	3,529,224,926.48	99.51
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	-11,687.41	-0.00	-	-
合计	3,928,501,634.10	99.80	3,529,224,926.48	99.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证科创板 50 成份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）
	上证科创板 50 成份指数上升 5%	195,388,280.07	175,559,543.88
上证科创板 50 成份指数下降 5%	-195,388,280.07	-175,559,543.88	

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	3,927,300,474.90	3,528,305,497.02
第二层次	76,505.00	-
第三层次	1,136,341.61	919,429.46
合计	3,928,513,321.51	3,529,224,926.48

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	3,928,513,321.51	99.71
	其中：股票	3,928,513,321.51	99.71
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	10,105,107.53	0.26
8	其他各项资产	1,201,976.03	0.03
9	合计	3,939,820,405.07	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 294,275,044.00 元，占本基金期末资产净值的 7.48%。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 51,092 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 44,144,661.00 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,980,506,974.43	75.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	946,162,225.47	24.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,926,669,199.90	99.75

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	1,526,411.38	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	30,441.28	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	262,358.32	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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	1,844,121.61	0.05
--	----	--------------	------

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	688981	中芯国际	7,450,170	376,382,588.40	9.56
2	688111	金山办公	709,261	334,927,229.42	8.51
3	688012	中微公司	1,659,595	259,643,637.75	6.60
4	688036	传音控股	1,233,349	181,302,303.00	4.61
5	688599	天合光能	4,173,589	177,836,627.29	4.52
6	688008	澜起科技	3,053,218	175,315,777.56	4.45
7	688256	寒武纪	799,964	150,393,232.00	3.82
8	688777	中控技术	1,809,655	113,610,140.90	2.89
9	688126	沪硅产业	5,231,218	109,332,456.20	2.78
10	688223	晶科能源	7,663,860	107,753,871.60	2.74
11	688396	华润微	2,027,785	106,276,211.85	2.70
12	688303	大全能源	2,455,759	99,335,451.55	2.52
13	688122	西部超导	1,748,475	97,442,511.75	2.48
14	688099	晶晨股份	1,119,804	94,421,873.28	2.40
15	688169	石头科技	218,280	69,998,030.40	1.78
16	688521	芯原股份	959,924	69,037,734.08	1.75
17	688063	派能科技	335,948	66,601,691.00	1.69
18	688390	固德威	398,309	66,461,839.74	1.69
19	688363	华熙生物	736,609	65,676,058.44	1.67
20	688005	容百科技	1,208,828	65,300,888.56	1.66
21	688041	海光信息	891,959	60,894,040.93	1.55
22	689009	九号公司	1,649,159	60,771,509.15	1.54
23	688220	翱捷科技	801,888	60,454,336.32	1.54
24	688536	思瑞浦	277,295	60,450,310.00	1.54
25	688009	中国通号	9,917,671	57,522,491.80	1.46
26	688180	君实生物	1,470,816	56,685,248.64	1.44
27	688301	奕瑞科技	196,990	55,635,885.70	1.41
28	688561	奇安信	1,051,382	54,472,101.42	1.38
29	688772	珠海冠宇	2,569,282	51,771,032.30	1.32
30	688385	复旦微电	1,022,003	51,202,350.30	1.30
31	688032	禾迈股份	127,497	45,280,559.55	1.15
32	688188	柏楚电子	225,610	42,541,021.60	1.08

33	688187	时代电气	1,001,499	41,922,748.14	1.06
34	688065	凯赛生物	673,344	41,922,397.44	1.06
35	688779	长远锂科	3,688,594	41,570,454.38	1.06
36	688538	和辉光电	15,999,533	40,638,813.82	1.03
37	688082	盛美上海	329,618	36,389,827.20	0.92
38	688271	联影医疗	223,231	30,808,110.31	0.78
39	688728	格科微	1,900,924	30,072,617.68	0.76
40	688690	纳微科技	769,530	29,896,240.50	0.76
41	688052	纳芯微	166,121	26,308,582.77	0.67
42	688297	中无人机	512,446	26,283,355.34	0.67
43	688348	昱能科技	131,333	24,668,277.39	0.63
44	688234	天岳先进	325,187	24,044,326.78	0.61
45	688819	天能股份	523,400	19,282,056.00	0.49
46	688349	三一重能	548,927	17,686,427.94	0.45
47	688047	龙芯中科	138,067	15,848,710.93	0.40
48	688114	华大智造	146,163	12,651,869.28	0.32
49	688295	中复神鹰	310,334	11,383,051.12	0.29
50	688375	国博电子	133,337	10,560,290.40	0.27

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	688498	源杰科技	2,215	631,275.00	0.02
2	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.01
3	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
4	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
5	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
6	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
7	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
8	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
9	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
10	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
11	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
12	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
13	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
14	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
15	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
16	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
17	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
18	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
19	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
20	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00

21	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
22	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
23	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
24	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
25	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
26	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
27	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
28	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
29	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
30	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
31	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
32	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
33	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
34	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
35	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
36	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
37	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	688385	复旦微电	76,187,613.36	2.15
2	688303	大全能源	52,155,035.26	1.47
3	688220	翱捷科技	51,851,660.76	1.46
4	688348	昱能科技	46,904,673.23	1.32
5	688772	珠海冠宇	38,662,784.03	1.09
6	688363	华熙生物	28,719,604.93	0.81
7	688297	中无人机	24,062,338.89	0.68
8	688223	晶科能源	22,546,836.17	0.64
9	688032	禾迈股份	20,928,169.70	0.59
10	688082	盛美上海	20,458,215.69	0.58
11	688349	三一重能	18,946,767.33	0.53
12	688047	龙芯中科	18,780,314.73	0.53
13	688375	国博电子	14,495,429.02	0.41
14	688126	沪硅产业	14,024,468.58	0.40
15	688234	天岳先进	13,421,089.72	0.38
16	688114	华大智造	12,108,169.57	0.34
17	688536	思瑞浦	10,394,943.15	0.29
18	688728	格科微	10,384,376.54	0.29
19	688301	奕瑞科技	9,717,485.35	0.27

20	688188	柏楚电子	8,174,267.20	0.23
----	--------	------	--------------	------

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	688139	海尔生物	54,767,817.97	1.54
2	688981	中芯国际	42,669,100.36	1.20
3	688116	天奈科技	34,473,579.13	0.97
4	688185	康希诺	33,226,725.97	0.94
5	688111	金山办公	32,260,511.92	0.91
6	688276	百克生物	30,502,370.41	0.86
7	688202	美迪西	29,349,062.70	0.83
8	688012	中微公司	26,134,411.56	0.74
9	688006	杭可科技	24,266,270.58	0.68
10	688777	中控技术	17,724,711.88	0.50
11	688008	澜起科技	16,429,156.25	0.46
12	688599	天合光能	15,848,107.22	0.45
13	688036	传音控股	15,546,017.42	0.44
14	688063	派能科技	13,054,038.82	0.37
15	688301	奕瑞科技	11,567,435.75	0.33
16	688032	禾迈股份	11,098,698.70	0.31
17	688396	华润微	10,681,219.12	0.30
18	688122	西部超导	10,539,595.59	0.30
19	688256	寒武纪	10,495,768.05	0.30
20	688169	石头科技	9,615,362.54	0.27

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	603,299,951.93
卖出股票收入（成交）总额	562,724,295.62

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**

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	31,967.29
2	应收清算款	835,613.53
3	应收股利	45,000.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	213,778.97
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	1,201,976.03

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	688111	金山办公	76,782,972.00	1.95	转融通证券出借
2	688008	澜起科技	40,762,458.00	1.04	转融通证券出借
3	688036	传音控股	35,838,600.00	0.91	转融通证券出借
4	688256	寒武纪	31,396,000.00	0.80	转融通证券出借
5	688777	中控技术	26,493,160.00	0.67	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	688435	英方软件	199,225.84	0.01	新股锁定期内
2	688249	晶合集成	133,734.30	0.00	新股锁定期内
3	688472	阿特斯	106,687.44	0.00	新股锁定期内
4	688443	智翔金泰	89,443.17	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	
		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 (%)
108,414	34,935.27	303,277,627.00	8.01	2,301,610,179.00	60.77	1,182,584,952.00	31.22

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	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	56,042,700.00	1.48
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	44,331,700.00	1.17
3	中国人寿保险（集团）公司	41,999,961.00	1.11
4	王旭林	28,300,000.00	0.75
5	中国国际金融有限公司	12,960,832.00	0.34
6	姚志刚	11,441,615.00	0.30
7	邹明刚	8,645,500.00	0.23
8	王云岗	8,093,500.00	0.21
9	国寿养老配置 2 号混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	8,000,000.00	0.21
10	金晓斌	6,843,728.00	0.18

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	75,000.00	0.0020

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（2020年9月28日）基金份额总额	5,498,735,457.00
本报告期期初基金份额总额	3,571,672,758.00
本报告期基金总申购份额	1,354,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,138,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,787,472,758.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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 (%)	
南京证券	2	631,299,415.26	54.63	588,034.85	54.63	-
安信证券	1	522,809,300.86	45.24	486,916.40	45.23	-
华西证券	1	1,581,003.65	0.14	1,472.35	0.14	-

爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	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	-	-	-	-	-
方正证券	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	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	4	-	-	-	-	-
摩根大通 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	2	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	4	-	-	-	-	-
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：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；3) 资金雄厚，信誉良好。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；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时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(%)
南京证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	25,888,763.27	100.00	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证	-	-	-	-	-	-

券						
长江证 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	-	-	-	-	-	-
方正证 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	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证	-	-	-	-	-	-

券						
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-
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	证监会规定报刊和网站	2023年6月3日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
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 5 月 9 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 4 月 29 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 4 月 22 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期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 23 日
13	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 2 月 15 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	1	20230101-202	819,397,3	556,144,	192,957,3	1,182,584,952	31.22

金		30630;	73.00	972.00	93.00	.00
产品特有风险						
<p>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。</p>						

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