

华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银河证券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	6
§ 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等内容真实、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	60
7.1 期末基金资产组合情况	60
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	62
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66

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	66
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	66
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末上市基金前十名持有人	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	稀土 ETF
场内简称	稀土 ETF (扩位证券简称: 稀土 ETF)
基金主代码	516780
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	856,549,838.00 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	2021 年 3 月 8 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	中证稀土产业指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证稀土产业指数，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	中国银河证券股份有限公司
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	95551;400-888-8888
传真	021-38601799	010-80928078
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	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号

	大五道口广场 1 号 17 层	楼青海金融大厦
邮政编码	200135	100073
法定代表人	贾波	陈亮

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	-13,167,026.74
本期利润	-1,820,220.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0023
本期加权平均净值利润率	-0.21%
本期基金份额净值增长率	0.10%
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	46,979,823.59
期末可供分配基金份额利润	0.0548
期末基金资产净值	903,529,661.59
期末基金份额净值	1.0548
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	5.48%

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

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

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

3.2 基金净值表现

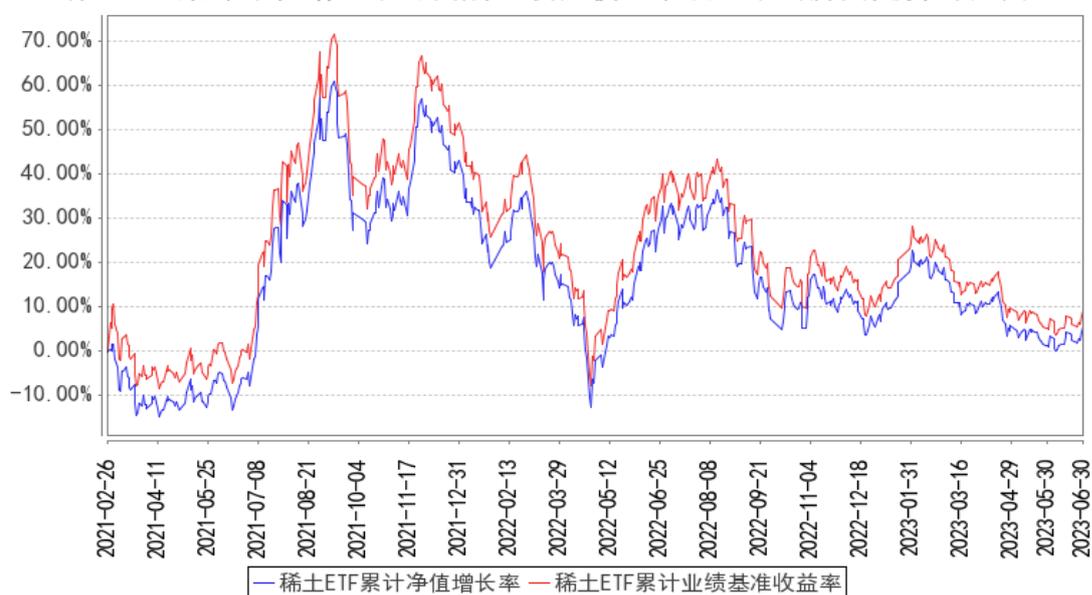
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	4.48%	1.06%	4.12%	1.06%	0.36%	0.00%
过去三个月	-3.81%	1.10%	-4.55%	1.11%	0.74%	-0.01%
过去六个月	0.10%	1.18%	-0.78%	1.19%	0.88%	-0.01%
过去一年	-18.90%	1.46%	-20.56%	1.48%	1.66%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.48%	2.03%	9.03%	2.09%	-3.55%	-0.06%

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

稀土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 2021 年 2 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、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		
李茜	本基金的基金经理	2021年2月26日	-	8年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015年3月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019年11月至2022年12月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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11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。2020年12月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年1月起任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的基金经理。2021年2月起任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的基金经理。2021年3月起任华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理。2021年9月起任华泰柏

					<p>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的基金经理。2021 年 11 月起任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的基金经理。2022 年 1 月起任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的基金经理。2022 年 4 月起任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) 的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 5 月起任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的基金经理。2023 年 6 月起任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的基金经理。</p>
谭弘翔	指数投资部 副总监、本基金的基金经理	2021 年 3 月 10 日	-	7 年	<p>美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融工程专业硕士。曾任上海证券交易所产品中心基金业务部经理。2020 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部副总监。2021 年 3 月起任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、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月起任华泰柏瑞中证科技 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。2021 年 6 月起任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的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月起任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的基金经理。2021 年 12 月起任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的基金经理。2022 年 1 月起任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的基金经理。2022 年 7 月起任华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</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 0.019%，期间日跟踪误差为 0.026%，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 1.0548 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.10%，业绩比较基准收益率为-0.78%。

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

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金

法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配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。

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

本托管人依法复核华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证稀土产业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	8,499,339.57	8,719,752.56
结算备付金		172,884.91	457,844.43
存出保证金		250,363.91	442,956.22
交易性金融资产	6.4.7.2	896,076,889.18	778,016,359.23
其中：股票投资		896,076,889.18	777,387,335.17
基金投资		-	-
债券投资		-	629,024.06
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		-	231,329.12
应收股利		27,755.60	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	91,479.35	6,101.96
资产总计		905,118,712.52	787,874,343.52
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		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		651,735.53	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		354,775.76	350,198.52
应付托管费		70,955.15	70,039.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	6.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	511,584.49	843,956.87
负债合计		1,589,050.93	1,264,202.04
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	856,549,838.00	746,549,838.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	46,979,823.59	40,060,303.48
净资产合计		903,529,661.59	786,610,141.48
负债和净资产总计		905,118,712.52	787,874,343.52

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0548 元，基金份额总额 856,549,838.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证稀土产业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		961,242.50	-141,845,013.37
1. 利息收入		419,579.01	737,667.06

其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,297.39	47,792.69
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		399,281.62	689,874.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,142,352.38	-120,895,996.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-16,244,417.14	-126,270,027.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	295,419.68	167,537.79
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	4,806,645.08	5,206,492.51
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	11,346,806.02	-23,869,635.97
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	337,209.85	2,182,952.48
减：二、营业总支出		2,781,463.22	3,563,293.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,160,853.19	2,808,246.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	432,170.65	561,649.40
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		0.28	0.55
8. 其他费用	6.4.7.23	188,439.10	193,396.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,820,220.72	-145,408,306.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,820,220.72	-145,408,306.61

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,820,220.72	-145,408,306.61

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证稀土产业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）	746,549,838.00	-	40,060,303.48	786,610,141.48
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）	746,549,838.00	-	40,060,303.48	786,610,141.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	110,000,000.00	-	6,919,520.11	116,919,520.11
（一）、综合收益总额	-	-	-1,820,220.72	-1,820,220.72
（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）	110,000,000.00	-	8,739,740.83	118,739,740.83
其中：1. 基金申购款	245,500,000.00	-	25,155,663.20	270,655,663.20
2. 基金赎回款	-135,500,000.00	-	-16,415,922.37	-151,915,922.37
（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)	856,549,838.00	-	46,979,823.59	903,529,661.59
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)	878,049,838.00	-	376,226,541.46	1,254,276,379.46
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)	878,049,838.00	-	376,226,541.46	1,254,276,379.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-23,500,000.00	-	-119,313,723.69	-142,813,723.69
(一)、综合收益总额	-	-	-145,408,306.61	-145,408,306.61
(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)	-23,500,000.00	-	26,094,582.92	2,594,582.92
其中：1. 基金申购款	802,500,000.00	-	184,768,274.52	987,268,274.52
2. 基金赎回款	-826,000,000.00	-	-158,673,691.60	-984,673,691.60
(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)	854,549,838.00	-	256,912,817.77	1,111,462,655.77

				7
--	--	--	--	---

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证稀土产业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[2021]第 369 号《关于准予华泰柏瑞中证稀土产业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《华泰柏瑞中证稀土产业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 1,999,949,838.00 元,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(2021)第 0232 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,999,949,838.00 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,基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]89 号核准,本基金 1,999,949,838.00 份基金份额于 2021 年 03 月 08 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证稀土产业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(包括主板、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、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、同业存单、股指期货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%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金

不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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中证稀土产业指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华泰柏瑞中证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(以下简称“华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 联接基金为交易型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2023 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证稀土产业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日前取得的基金、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基金份额净值、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	8,499,339.57
等于：本金	8,498,085.57
加：应计利息	1,254.00
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	8,499,339.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,044,537,092.72	-	896,076,889.18	-148,460,203.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,044,537,092.72	-	896,076,889.18	-148,460,203.54

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。

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	15,863.11

待摊费用	75,616.24
合计	91,479.35

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	168,877.12
其中：交易所市场	168,877.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	154,055.34
应退退补款	188,652.03
合计	511,584.49

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	746,549,838.00	746,549,838.00
本期申购	245,500,000.00	245,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-135,500,000.00	-135,500,000.00
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	856,549,838.00	856,549,838.00

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	281,337,586.11	-241,277,282.63	40,060,303.48
本期利润	-13,167,026.74	11,346,806.02	-1,820,220.72
本期基金份额交易产生的变动数	40,305,211.81	-31,565,470.98	8,739,740.83
其中：基金申购款	90,341,799.50	-65,186,136.30	25,155,663.20
基金赎回款	-50,036,587.69	33,620,665.32	-16,415,922.37

本期已分配利润	-	-	-
本期末	308,475,771.18	-261,495,947.59	46,979,823.59

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	14,807.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,210.11
其他	2,279.58
合计	20,297.39

注：其他为结算保证金利息收入、直销申购款利息收入和期货备付金利息收入。

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	-5,371,941.83
股票投资收益——赎回差价收入	-10,872,475.31
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	-16,244,417.14

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	120,763,713.26
减：卖出股票成本总额	125,712,028.67
减：交易费用	423,626.42
买卖股票差价收入	-5,371,941.83

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	151,915,922.37
减：现金支付赎回款总额	73,125,245.37
减：赎回股票成本总额	89,663,152.31
减：交易费用	-

赎回差价收入	-10,872,475.31
--------	----------------

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	76.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	295,343.39
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	295,419.68

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	924,483.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	628,900.00
减：应计利息总额	202.63
减：交易费用	36.98
买卖债券差价收入	295,343.39

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。

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	4,806,645.08
其中：证券出借权益补偿收入	94,789.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,806,645.08

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	11,346,806.02
股票投资	11,346,806.02
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	11,346,806.02

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	337,209.85
合计	337,209.85

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	74,383.76
IOPV 计算发布费	9,916.99
合计	188,439.10

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
中国银河证券股份有限公司（“中国银河证券”）	基金托管人、基金销售机构
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”）	基金管理人的股东的子公司
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（“稀土ETF联接”）	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
银河证券	297,114,514.95	100.00	946,050,790.70	100.00

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
银河证券	274,273.88	100.00	168,877.12	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
银河证券	866,238.31	100.00	407,444.11	100.00

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,160,853.19	2,808,246.60
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	432,170.65	561,649.40

注：支付基金托管人中国银河证券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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	325,461,551.00	255,257.68	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	311,647,324.00	189,783.95	73,893,413.00	30,374.20

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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	202305250000161	安泰科技	2023年5月25日	222,750.00	25,000.00	14	3.2000	277.20	-	-
华泰证券	2023051900002207	安泰科技	2023年5月19日	172,710.00	19,000.00	28	3.1000	416.36	-	-
华泰证券	2023060800016462	安泰科技	2023年6月8日	217,500.00	25,000.00	14	3.2000	347.94	-	-
华泰证券	2023062600036321	安泰科技	2023年6月26日	230,250.00	25,000.00	14	3.2000	81.88	236,750.00	81.88
华泰证券	202306	安泰科	2023年	176,320.	19,000.0	28	3.100	212.52	179,93	212.52

	1600017882	技	6月16日	00	0		0	0.00		
华泰证券	202305250000183	包钢股份	2023年5月25日	448,350.00	245,000.00	14	3.2000	557.90	-	-
华泰证券	2023051900002219	包钢股份	2023年5月19日	482,448.00	262,200.00	28	3.1000	1,163.12	-	-
华泰证券	2023060800017215	包钢股份	2023年6月8日	443,450.00	245,000.00	14	3.2000	709.56	-	-
华泰证券	2023062600038893	包钢股份	2023年6月26日	436,100.00	245,000.00	14	3.2000	155.04	438,550.00	155.04
华泰证券	2023061600019401	包钢股份	2023年6月16日	479,826.00	262,200.00	28	3.1000	578.48	469,338.00	578.48
华泰证券	202305250000185	北方稀土	2023年5月25日	482,200.00	20,000.00	14	3.2000	600.04	-	-
华泰证券	2023051900002215	北方稀土	2023年5月19日	1,114,008.00	45,600.00	28	3.1000	2,686.04	-	-
华泰证券	2023060800018924	北方稀土	2023年6月8日	467,400.00	20,000.00	14	3.2000	747.90	-	-
华泰证券	2023062600050178	北方稀土	2023年6月26日	470,800.00	20,000.00	14	3.2000	167.40	479,600.00	167.40
华泰证券	2023061600019501	北方稀土	2023年6月16日	1,106,712.00	45,600.00	28	3.1000	1,334.20	1,093,488.00	1,334.20
华泰证券	2023011300009766	大地熊	2023年1月13日	172,755.00	3,300.00	14	3.4000	277.44	-	-
华泰证券	2023013000082259	大地熊	2023年1月30日	185,295.00	3,300.00	14	3.4000	245.00	-	-
华泰证券	2023021300078046	大地熊	2023年2月13日	190,740.00	3,300.00	14	3.4000	252.14	-	-
华泰证券	2023022700072574	大地熊	2023年2月27日	170,412.00	3,300.00	14	3.4000	225.26	-	-

华泰证券	202303 130007 0226	大地熊	2023年 3月13 日	154,638. 00	3,300.00	14	3.400 0	204.40	-	-
华泰证券	202303 270007 3421	大地熊	2023年 3月27 日	152,328. 00	3,300.00	14	3.400 0	201.46	-	-
华泰证券	202304 100005 9439	大地熊	2023年 4月10 日	144,672. 00	3,300.00	14	3.400 0	191.24	-	-
华泰证券	202304 240001 9101	大地熊	2023年 4月24 日	132,561. 00	3,300.00	14	3.400 0	175.28	-	-
华泰证券	202305 080002 8003	大地熊	2023年 5月8日	119,955. 00	3,300.00	14	3.400 0	158.62	-	-
华泰证券	202305 250000 0171	大洋电 机	2023年 5月25 日	241,200. 00	45,000.0 0	14	3.200 0	300.16	-	-
华泰证券	202305 190000 2255	大洋电 机	2023年 5月19 日	245,784. 00	45,600.0 0	28	3.100 0	592.48	-	-
华泰证券	202306 080002 4460	大洋电 机	2023年 6月8日	233,550. 00	45,000.0 0	14	3.200 0	373.68	-	-
华泰证券	202306 260004 1275	大洋电 机	2023年 6月26 日	245,250. 00	45,000.0 0	14	3.200 0	87.20	256,50 0.00	87.20
华泰证券	202306 160002 0159	大洋电 机	2023年 6月16 日	247,152. 00	45,600.0 0	28	3.100 0	297.92	259,92 0.00	297.92
华泰证券	202305 190000 2250	丰元股 份	2023年 5月19 日	111,986. 00	3,800.00	28	3.100 0	269.92	-	-
华泰证券	202306 160001 9301	丰元股 份	2023年 6月16 日	81,852.0 0	3,800.00	28	3.100 0	98.70	82,384 .00	98.70
华泰证券	202305 190000 2239	格林美	2023年 5月19 日	454,195. 00	66,500.0 0	28	3.100 0	1,095. 08	-	-
华泰证券	202306 160002 1444	格林美	2023年 6月16 日	465,500. 00	66,500.0 0	28	3.100 0	561.12	459,51 5.00	561.12
华泰证券	202305 190000	广晟有 色	2023年 5月19	139,954. 00	3,800.00	28	3.100 0	337.40	-	-

	2213		日							
华泰证券	202306 160001 8766	广晟有色	2023年 6月16 日	135,926. 00	3,800.00	28	3.100 0	163.80	137,33 2.00	163.80
华泰证券	202305 250000 0169	横店东 磁	2023年 5月25 日	375,000. 00	20,000.0 0	14	3.200 0	466.62	-	-
华泰证券	202305 190000 2231	横店东 磁	2023年 5月19 日	314,811. 00	17,100.0 0	28	3.100 0	759.08	-	-
华泰证券	202306 080002 0530	横店东 磁	2023年 6月8日	336,000. 00	20,000.0 0	14	3.200 0	537.66	-	-
华泰证券	202306 260003 7399	横店东 磁	2023年 6月26 日	349,600. 00	20,000.0 0	14	3.200 0	124.32	364,20 0.00	124.32
华泰证券	202306 160001 9195	横店东 磁	2023年 6月16 日	302,841. 00	17,100.0 0	28	3.100 0	365.12	311,39 1.00	365.12
华泰证券	202305 190000 2211	鸿达兴 业	2023年 5月19 日	165,528. 00	68,400.0 0	28	3.100 0	399.00	-	-
华泰证券	202306 160001 8765	鸿达兴 业	2023年 6月16 日	155,268. 00	68,400.0 0	28	3.100 0	187.18	153,21 6.00	187.18
华泰证券	202305 190000 2241	华宏科 技	2023年 5月19 日	70,680.0 0	5,700.00	28	3.100 0	170.52	-	-
华泰证券	202306 160001 9298	华宏科 技	2023年 6月16 日	67,773.0 0	5,700.00	28	3.100 0	81.76	69,882 .00	81.76
华泰证券	202305 250000 0179	焦作万 方	2023年 5月25 日	97,000.0 0	20,000.0 0	14	3.200 0	120.68	-	-
华泰证券	202305 190000 2221	焦作万 方	2023年 5月19 日	112,404. 00	22,800.0 0	28	3.100 0	271.04	-	-
华泰证券	202306 080002 4771	焦作万 方	2023年 6月8日	96,200.0 0	20,000.0 0	14	3.200 0	153.90	-	-
华泰证券	202306 260005 1664	焦作万 方	2023年 6月26 日	93,600.0 0	20,000.0 0	14	3.200 0	33.28	96,800 .00	33.28
华泰证券	202306	焦作万	2023年	111,264.	22,800.0	28	3.100	134.12	110,35	134.12

	1600017552	方	6月16日	00	0		0		2.00	
华泰证券	202305250000175	金风科技	2023年5月25日	388,500.00	35,000.00	14	3.2000	483.42	-	-
华泰证券	2023051900002259	金风科技	2023年5月19日	508,440.00	45,600.00	28	3.1000	1,225.84	-	-
华泰证券	2023060800018814	金风科技	2023年6月8日	372,050.00	35,000.00	14	3.2000	595.26	-	-
华泰证券	2023062600038797	金风科技	2023年6月26日	362,950.00	35,000.00	14	3.2000	129.04	371,700.00	129.04
华泰证券	2023061600021862	金风科技	2023年6月16日	493,392.00	45,600.00	28	3.1000	594.86	484,272.00	594.86
华泰证券	2023011300009688	金力永磁	2023年1月13日	919,376.00	29,600.00	14	3.4000	1,476.11	-	-
华泰证券	2023013000088747	金力永磁	2023年1月30日	995,744.00	29,600.00	14	3.4000	1,316.56	-	-
华泰证券	2023021300082870	金力永磁	2023年2月13日	1,036,000.00	29,600.00	14	3.4000	1,369.76	-	-
华泰证券	2023022700072454	金力永磁	2023年2月27日	953,712.00	29,600.00	14	3.4000	1,260.98	-	-
华泰证券	2023031300070214	金力永磁	2023年3月13日	848,336.00	29,600.00	14	3.4000	1,121.68	-	-
华泰证券	2023032700071353	金力永磁	2023年3月27日	844,784.00	29,600.00	14	3.4000	1,117.06	-	-
华泰证券	2023041000064889	金力永磁	2023年4月10日	844,784.00	29,600.00	14	3.4000	1,117.06	-	-
华泰证券	2023042400058379	金力永磁	2023年4月24日	812,816.00	29,600.00	14	3.4000	1,074.78	-	-
华泰证券	2023050800025833	金力永磁	2023年5月8日	818,736.00	29,600.00	14	3.4000	1,082.62	-	-

华泰证券	202305 190000 2205	金力永 磁	2023年 5月19 日	206,872. 00	7,600.00	28	3.100 0	498.68	-	-
华泰证券	202306 160001 7549	金力永 磁	2023年 6月16 日	204,212. 00	7,600.00	28	3.100 0	246.12	227,39 2.00	246.12
华泰证券	202305 190000 2253	京运通	2023年 5月19 日	246,981. 00	39,900.0 0	28	3.100 0	595.56	-	-
华泰证券	202306 160002 0811	京运通	2023年 6月16 日	235,011. 00	39,900.0 0	28	3.100 0	283.36	241,39 5.00	283.36
华泰证券	202305 250000 0189	科力远	2023年 5月25 日	302,800. 00	40,000.0 0	14	3.200 0	376.88	-	-
华泰证券	202305 190000 2245	科力远	2023年 5月19 日	271,472. 00	36,100.0 0	28	3.100 0	654.64	-	-
华泰证券	202306 080001 9997	科力远	2023年 6月8日	268,000. 00	40,000.0 0	14	3.200 0	428.76	-	-
华泰证券	202306 260003 9363	科力远	2023年 6月26 日	269,600. 00	40,000.0 0	14	3.200 0	95.84	285,60 0.00	95.84
华泰证券	202306 160001 8442	科力远	2023年 6月16 日	253,783. 00	36,100.0 0	28	3.100 0	305.90	257,75 4.00	305.90
华泰证券	202305 250000 0173	领益智 造	2023年 5月25 日	235,200. 00	40,000.0 0	14	3.200 0	292.74	-	-
华泰证券	202306 080001 7136	领益智 造	2023年 6月8日	249,200. 00	40,000.0 0	14	3.200 0	398.70	-	-
华泰证券	202306 260004 4201	领益智 造	2023年 6月26 日	261,200. 00	40,000.0 0	14	3.200 0	92.88	276,40 0.00	92.88
华泰证券	202305 250000 0187	宁波韵 升	2023年 5月25 日	162,200. 00	20,000.0 0	14	3.200 0	201.88	-	-
华泰证券	202305 190000 2223	宁波韵 升	2023年 5月19 日	108,262. 00	13,300.0 0	28	3.100 0	260.96	-	-
华泰证券	202306 080001	宁波韵 升	2023年 6月8日	153,400. 00	20,000.0 0	14	3.200 0	245.52	-	-

	6894									
华泰证券	202306 260003 8048	宁波韵升	2023年 6月26 日	160,800. 00	20,000.0 0	14	3.200 0	57.16	177,40 0.00	57.16
华泰证券	202306 160001 9192	宁波韵升	2023年 6月16 日	107,331. 00	13,300.0 0	28	3.100 0	129.36	117,97 1.00	129.36
华泰证券	202305 190000 2225	厦门钨业	2023年 5月19 日	427,044. 00	22,800.0 0	28	3.100 0	1,029. 56	-	-
华泰证券	202306 160002 0809	厦门钨业	2023年 6月16 日	440,952. 00	22,800.0 0	28	3.100 0	531.58	433,88 4.00	531.58
华泰证券	202305 250000 0197	盛和资源	2023年 5月25 日	192,150. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	239.12	-	-
华泰证券	202305 190000 2249	盛和资源	2023年 5月19 日	371,355. 00	28,500.0 0	28	3.100 0	895.44	-	-
华泰证券	202306 080001 7860	盛和资源	2023年 6月8日	190,050. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	304.02	-	-
华泰证券	202306 260003 8124	盛和资源	2023年 6月26 日	188,850. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	67.16	193,05 0.00	67.16
华泰证券	202306 160001 9959	盛和资源	2023年 6月16 日	371,925. 00	28,500.0 0	28	3.100 0	448.42	366,79 5.00	448.42
华泰证券	202305 250000 0177	盛新锂能	2023年 5月25 日	492,300. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	612.64	-	-
华泰证券	202305 190000 2261	盛新锂能	2023年 5月19 日	451,535. 00	13,300.0 0	28	3.100 0	1,088. 64	-	-
华泰证券	202306 080001 9134	盛新锂能	2023年 6月8日	505,950. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	809.46	-	-
华泰证券	202306 260003 7521	盛新锂能	2023年 6月26 日	475,650. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	169.12	478,05 0.00	169.12
华泰证券	202306 160001 7564	盛新锂能	2023年 6月16 日	452,865. 00	13,300.0 0	28	3.100 0	546.00	423,87 1.00	546.00
华泰证券	202305	天通股	2023年	249,750.	25,000.0	14	3.200	310.80	-	-

	250000 0195	份	5月25 日	00	0		0				
华泰证券	202305 190000 2228	天通股 份	2023年 5月19 日	258,115. 00	24,700.0 0	28	3.100 0	622.44	-	-	
华泰证券	202306 080002 0111	天通股 份	2023年 6月8日	239,750. 00	25,000.0 0	14	3.200 0	383.58	-	-	
华泰证券	202306 260003 7699	天通股 份	2023年 6月26 日	318,500. 00	25,000.0 0	14	3.200 0	113.24	298,00 0.00	113.24	
华泰证券	202306 160001 8536	天通股 份	2023年 6月16 日	296,400. 00	24,700.0 0	28	3.100 0	357.28	294,42 4.00	357.28	
华泰证券	202305 250000 0191	卧龙电 驱	2023年 5月25 日	184,350. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	229.46	-	-	
华泰证券	202305 190000 2242	卧龙电 驱	2023年 5月19 日	309,985. 00	24,700.0 0	28	3.100 0	747.32	-	-	
华泰证券	202306 080001 9678	卧龙电 驱	2023年 6月8日	175,200. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	280.26	-	-	
华泰证券	202306 260004 2790	卧龙电 驱	2023年 6月26 日	192,750. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	68.52	219,15 0.00	68.52	
华泰证券	202306 160001 8339	卧龙电 驱	2023年 6月16 日	302,575. 00	24,700.0 0	28	3.100 0	364.84	360,86 7.00	364.84	
华泰证券	202305 190000 2237	湘电股 份	2023年 5月19 日	326,610. 00	19,000.0 0	28	3.100 0	787.36	-	-	
华泰证券	202306 160002 0384	湘电股 份	2023年 6月16 日	334,020. 00	19,000.0 0	28	3.100 0	402.64	362,71 0.00	402.64	
华泰证券	202305 190000 2232	英洛华	2023年 5月19 日	83,391.0 0	13,300.0 0	28	3.100 0	201.04	-	-	
华泰证券	202306 160001 8980	英洛华	2023年 6月16 日	84,322.0 0	13,300.0 0	28	3.100 0	101.64	100,81 4.00	101.64	
华泰证券	202305 250000 0181	有研新 材	2023年 5月25 日	200,400. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	249.34	-	-	

华泰证券	202305 190000 2234	有研新材	2023年 5月19 日	233,928. 00	17,100.0 0	28	3.100 0	563.92	-	-
华泰证券	202306 080001 7105	有研新材	2023年 6月8日	190,650. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	305.10	-	-
华泰证券	202306 260004 6321	有研新材	2023年 6月26 日	192,000. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	68.28	197,10 0.00	68.28
华泰证券	202306 160001 7349	有研新材	2023年 6月16 日	225,207. 00	17,100.0 0	28	3.100 0	271.46	224,69 4.00	271.46
华泰证券	202305 190000 2203	正海磁材	2023年 5月19 日	116,185. 00	9,500.00	28	3.100 0	280.00	-	-
华泰证券	202306 160001 7228	正海磁材	2023年 6月16 日	112,195. 00	9,500.00	28	3.100 0	135.24	122,17 0.00	135.24
华泰证券	202305 190000 2257	中钢天源	2023年 5月19 日	146,376. 00	15,200.0 0	28	3.100 0	352.80	-	-
华泰证券	202306 160002 0908	中钢天源	2023年 6月16 日	150,176. 00	15,200.0 0	28	3.100 0	181.02	159,60 0.00	181.02
华泰证券	202305 250000 0193	中国铝业	2023年 5月25 日	260,000. 00	50,000.0 0	14	3.200 0	323.54	-	-
华泰证券	202305 190000 2247	中国铝业	2023年 5月19 日	616,018. 00	110,200. 00	28	3.100 0	1,485. 40	-	-
华泰证券	202306 080001 9573	中国铝业	2023年 6月8日	280,000. 00	50,000.0 0	14	3.200 0	448.02	-	-
华泰证券	202306 260004 2255	中国铝业	2023年 6月26 日	266,500. 00	50,000.0 0	14	3.200 0	94.76	274,50 0.00	94.76
华泰证券	202306 160002 1185	中国铝业	2023年 6月16 日	644,670. 00	110,200. 00	28	3.100 0	777.14	604,99 8.00	777.14
华泰证券	202305 250000 0167	中国稀土	2023年 5月25 日	469,200. 00	15,000.0 0	14	3.200 0	583.94	-	-
华泰证券	202305 190000	中国稀土	2023年 5月19	370,386. 00	11,400.0 0	28	3.100 0	892.92	-	-

	2217		日							
华泰证券	2023060800018990	中国稀土	2023年6月8日	445,500.00	15,000.00	14	3.2000	712.80	-	-
华泰证券	2023062600035793	中国稀土	2023年6月26日	436,500.00	15,000.00	14	3.2000	155.20	444,000.00	155.20
华泰证券	2023061600019621	中国稀土	2023年6月16日	354,312.00	11,400.00	28	3.1000	427.14	337,440.00	427.14
华泰证券	2023052500000163	中科三环	2023年5月25日	178,650.00	15,000.00	14	3.2000	222.32	-	-
华泰证券	2023051900002209	中科三环	2023年5月19日	255,607.00	20,900.00	28	3.1000	616.28	-	-
华泰证券	2023060800018819	中科三环	2023年6月8日	175,350.00	15,000.00	14	3.2000	280.62	-	-
华泰证券	2023062600050576	中科三环	2023年6月26日	183,450.00	15,000.00	14	3.2000	65.24	192,300.00	65.24
华泰证券	2023061600019719	中科三环	2023年6月16日	250,800.00	20,900.00	28	3.1000	302.40	267,938.00	302.40
华泰证券	2023052500000165	中色股份	2023年5月25日	186,000.00	40,000.00	14	3.2000	231.42	-	-
华泰证券	2023051900002227	中色股份	2023年5月19日	197,600.00	38,000.00	28	3.1000	476.56	-	-
华泰证券	2023060800018383	中色股份	2023年6月8日	191,200.00	40,000.00	14	3.2000	306.00	-	-
华泰证券	2023062600038791	中色股份	2023年6月26日	180,800.00	40,000.00	14	3.2000	64.28	188,800.00	64.28
华泰证券	2023061600018868	中色股份	2023年6月16日	183,160.00	38,000.00	28	3.1000	220.78	179,360.00	220.78
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)	出借期限	费率(%)	利息收入	期末证券出借	期末应收利息余额

					位：股)	(单			业务余	
						位：			额	
						天)				
华泰证券	202204 060006 6105	金力永 磁	2022-0 4-06	808,600. 00	26,000	14	3.40	1,069. 15	-	-
华泰证券	202204 070001 2880	金力永 磁	2022-0 4-07	60,360.0 0	2,000	14	3.40	79.81	-	-
华泰证券	202204 200004 6442	金力永 磁	2022-0 4-20	711,880. 00	26,000	14	3.40	1,008. 50	-	-
华泰证券	202204 210001 3033	金力永 磁	2022-0 4-21	52,660.0 0	2,000	14	3.40	69.63	-	-
华泰证券	202205 050007 0309	金力永 磁	2022-0 5-05	53,220.0 0	2,000	14	3.40	70.37	-	-
华泰证券	202205 050007 0311	金力永 磁	2022-0 5-05	691,860. 00	26,000	14	3.40	914.79	-	-
华泰证券	202205 180000 0714	金力永 磁	2022-0 5-18	767,260. 00	26,000	14	3.40	1,014. 49	-	-
华泰证券	202205 190004 2627	金力永 磁	2022-0 5-19	59,080.0 0	2,000	14	3.40	78.12	-	-
华泰证券	202206 010000 5064	金力永 磁	2022-0 6-01	782,860. 00	26,000	14	3.40	1,035. 11	-	-
华泰证券	202206 020002 2110	金力永 磁	2022-0 6-02	63,360.0 0	2,000	14	3.40	83.78	-	-
华泰证券	202206 150000 1448	金力永 磁	2022-0 6-15	1,008,76 8.00	29,600	14	3.40	1,333. 82	-	-
华泰证券	202206 150000 1451	大地熊	2022-0 6-15	285,450. 00	3,300	14	3.40	377.43	-	-
华泰证券	202206 150002 2491	金力永 磁	2022-0 6-15	886,080. 00	26,000	14	3.40	1,171. 59	-	-
华泰证券	202206 160001	金力永 磁	2022-0 6-16	67,000.0 0	2,000	14	3.40	88.59	-	-

	4931									
华泰证券	202206 240000 0891	大地熊	2022-0 6-24	185,850. 00	2,100	14	3.40	210.63	177,05 1.00	210.63
华泰证券	202206 240000 0893	金力永 磁	2022-0 6-24	814,416. 00	22,800	14	3.40	923.00	839,04 0.00	923.00
华泰证券	202206 290002 1336	大地熊	2022-0 6-29	269,148. 00	3,300	14	3.40	177.94	278,22 3.00	177.94
华泰证券	202206 290002 2880	金力永 磁	2022-0 6-29	1,066,19 2.00	29,600	14	3.40	704.87	1,089, 280.00	704.87

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
华泰柏瑞中 证稀土产业 交易型开放 式指数证券 投资基金发 起式联接基 金	80,850,610.00	9.4391	71,878,736.00	9.6281
华泰证券股 份有限公司	6,999,922.00	0.8172	12,358,574.00	1.6554
中国银河证 券股份有限 公司	3,173,700.00	0.3705	0.00	0.0000

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

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
华泰联合证券有限责任公司	301408.SZ	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券有限责任公司	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券有限责任公司	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券有限责任公司	603137.SH	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券有限责任公司	688469.SH	中芯集成	网下申购	95,906	545,705.14
华泰联合证券有限责任公司	688512.SH	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券有限责任公司	688472.SH	阿特斯	网下申购	33,109	367,509.90
华泰联合证券有限责任公司	300804.SZ	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券有限责任公司	688429.SH	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
中国银河证券	301215	中汽股份	网下申购	47,421	180,199.80

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	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值总	备注	

代码	券名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	额	
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	11.88	21.02	1,088	12,925.44	22,869.76	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定期内	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定期内	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华	2023	6个月	新股	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

	塑科技	年3月1日		锁定期内						
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定期内	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定期内	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定期内	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	38.13	31.03	1,117	42,591.21	34,660.51	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定期内	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美	2023	6个月	新股	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

	硕科技	年6月19日		锁定期内						
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定期内	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定期内	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定期内	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定期内	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定期内	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南	2023	6个月	新股	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

	王科技	年6月2日		锁定期内						
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定期内	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定期内	23.77	42.89	1,042	24,768.34	44,691.38	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定期内	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定期内	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定期内	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定期内	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股锁定期内	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股锁定期内	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿	2023	6个月	新股	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-

	莱德	年2月2日		锁定期内						
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定期内	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定期内	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期内	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	6.58	7.58	2,524	16,607.92	19,131.92	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
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	2023	6个月	新股	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-

	重科技	年 3 月 29 日		锁定期内						
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	5,060	100,491.60	91,383.60	-
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	764	18,030.40	49,407.88	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	37.88	29.49	1,734	65,683.92	51,135.66	-
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	2023	6 个月	新股	5.69	5.41	9,591	54,572.79	51,887.31	-

	芯集成	年 4 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	3,311	36,752.10	56,419.44	-
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	824	32,951.76	30,249.04	-
688485	九州一轨	2023 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	245.56	122.11	207	34,378.40	25,276.77	-
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	-
688515	裕太微	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	92.00	162.75	4,183	384,836.00	680,783.25	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	152.38	135.97	295	44,952.10	40,111.15	-
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	2023	6 个月	新股	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-

	科军工	年6月14日		锁定期内						
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	000612	焦作万方	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	4.84	42,800	207,152.00
2	000758	中色股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	4.72	78,000	368,160.00
3	000795	英洛华	2023 年 7 月 14 日-2023 年 7 月 14 日	7.58	13,300	100,814.00
4	000831	中国稀土	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	29.6	26,400	781,440.00
5	000969	安泰科技	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	9.47	44,000	416,680.00
6	000970	中科三环	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	12.82	35,900	460,238.00

7	002002	鸿达兴业	2023年7月14日-2023年7月14日	2.24	68,400	153,216.00
8	002056	横店东磁	2023年7月10日-2023年7月14日	18.21	37,100	675,591.00
9	002057	中钢天源	2023年7月14日-2023年7月14日	10.5	15,200	159,600.00
10	002202	金风科技	2023年7月10日-2023年7月14日	10.62	80,600	855,972.00
11	002240	盛新锂能	2023年7月10日-2023年7月14日	31.87	28,300	901,921.00
12	002249	大洋电机	2023年7月10日-2023年7月14日	5.7	90,600	516,420.00
13	002340	格林美	2023年7月14日-2023年7月14日	6.91	66,500	459,515.00
14	002600	领益智造	2023年7月10日-2023年7月10日	6.91	40,000	276,400.00
15	002645	华宏科技	2023年7月14日-2023年7月14日	12.26	5,700	69,882.00
16	002805	丰元股份	2023年7月14日-2023年7月14日	21.68	3,800	82,384.00
17	300224	正海磁材	2023年7月14日-2023年7月14日	12.86	9,500	122,170.00
18	300748	金力永磁	2023年7月14日-2023年7月14日	29.92	7,600	227,392.00
19	600010	宝钢股份	2023年7月10日-2023年7月14日	1.79	507,200	907,888.00
20	600111	北方稀土	2023年7月10日-2023年7月14日	23.98	65,600	1,573,088.00
21	600206	有研新材	2023年7月10日-2023年7月14日	13.14	32,100	421,794.00
22	600259	广晟有色	2023年7月14日-2023年7月14日	36.14	3,800	137,332.00
23	600330	天通股份	2023年7月5日-2023年7月14日	11.92	349,700	4,168,424.00
24	600366	宁波韵升	2023年7月10日-2023年7月14日	8.87	33,300	295,371.00
25	600392	盛和资源	2023年7月10日-2023年7月14日	12.87	43,500	559,845.00
26	600416	湘电股份	2023年7月14日-2023年7月14日	19.09	19,000	362,710.00
27	600478	科力远	2023年7月10日-2023年7月14日	7.14	76,100	543,354.00
28	600549	厦门钨业	2023年7月14日-2023年7月14日	19.03	22,800	433,884.00

29	600580	卧龙电驱	2023年7月10日-2023年7月14日	14.61	39,700	580,017.00
30	601600	中国铝业	2023年7月10日-2023年7月14日	5.49	160,200	879,498.00
31	601908	京运通	2023年7月14日-2023年7月14日	6.05	39,900	241,395.00
合计	-	-	-	-	-	17,939,547.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银河证券股份有限公司开立于中国工商银行的托管账户，因而与银行

存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2022 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.08%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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	8,499,339.57	-	-	-	-	-	8,499,339.57
结算备付金	172,884.91	-	-	-	-	-	172,884.91
存出保证金	250,363.91	-	-	-	-	-	250,363.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-896,076,889.18	896,076,889.18
应收股利	-	-	-	-	-	27,755.60	27,755.60
其他资产	-	-	-	-	-	91,479.35	91,479.35
资产总计	8,922,588.39	-	-	-	-	-896,196,124.13	905,118,712.52
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	354,775.76	354,775.76
应付托管费	-	-	-	-	-	70,955.15	70,955.15

应付清算款	-	-	-	-	-	651,735.53	651,735.53
其他负债	-	-	-	-	-	511,584.49	511,584.49
负债总计	-	-	-	-	-	1,589,050.93	1,589,050.93
利率敏感度缺口	8,922,588.39	-	-	-	-	-894,607,073.20	903,529,661.59
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	8,719,752.56	-	-	-	-	-	8,719,752.56
结算备付金	457,844.43	-	-	-	-	-	457,844.43
存出保证金	442,956.22	-	-	-	-	-	442,956.22
交易性金融资产	-	-	-	-629,024.06	777,387,335.17	-	778,016,359.23
应收清算款	-	-	-	-	-	231,329.12	231,329.12
其他资产	-	-	-	-	-	6,101.96	6,101.96
资产总计	9,620,553.21	-	-	-629,024.06	777,624,766.25	-	787,874,343.52
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	350,198.52	350,198.52
应付托管费	-	-	-	-	-	70,039.71	70,039.71
应交税费	-	-	-	-	-	6.94	6.94
其他负债	-	-	-	-	-	843,956.87	843,956.87
负债总计	-	-	-	-	-	1,264,202.04	1,264,202.04
利率敏感度缺口	9,620,553.21	-	-	-629,024.06	776,360,564.21	-	786,610,141.48

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：0.08%)，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	896,076,889.18	99.18	777,387,335.17	98.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	896,076,889.18	99.18	777,387,335.17	98.83

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证稀土产业指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	中证稀土产业指数上升5%	44,462,075.50	38,406,913.94
中证稀土产业指数下降5%	-44,462,075.50	-38,406,913.94	

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	893,286,795.46	775,240,145.19
第二层次	726,804.90	629,024.06
第三层次	2,063,288.82	2,147,189.98
合计	896,076,889.18	778,016,359.23

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	896,076,889.18	99.00
	其中：股票	896,076,889.18	99.00
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	8,672,224.48	0.96
8	其他各项资产	369,598.86	0.04
9	合计	905,118,712.52	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 17,939,547.00 元，占本基金期末资产净值的 1.99%。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 427,161.40 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 134,849,023.80 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	28,633,506.74	3.17
C	制造业	864,621,265.68	95.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	893,254,772.42	98.86

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,484,533.79	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	66,354.93	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	117,951.91	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	69,135.17	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	2,822,116.76	0.31
--	----	--------------	------

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	600111	北方稀土	4,452,751	106,776,968.98	11.82
2	002600	领益智造	6,688,977	46,220,831.07	5.12
3	601600	中国铝业	7,993,701	43,885,418.49	4.86
4	002340	格林美	6,306,000	43,574,460.00	4.82
5	002202	金风科技	4,004,102	42,523,563.24	4.71
6	600010	包钢股份	23,595,660	42,236,231.40	4.67
7	002240	盛新锂能	1,276,403	40,678,963.61	4.50
8	600549	厦门钨业	2,022,266	38,483,721.98	4.26
9	600392	盛和资源	2,502,113	32,202,194.31	3.56
10	600580	卧龙电驱	2,186,580	31,945,933.80	3.54
11	000831	中国稀土	1,049,048	31,051,820.80	3.44
12	600416	湘电股份	1,574,300	30,053,387.00	3.33
13	002056	横店东磁	1,452,496	26,449,952.16	2.93
14	600330	天通股份	2,051,816	24,457,646.72	2.71
15	002249	大洋电机	3,962,892	22,588,484.40	2.50
16	600478	科力远	3,142,650	22,438,521.00	2.48
17	000970	中科三环	1,734,900	22,241,418.00	2.46
18	300748	金力永磁	740,772	22,163,898.24	2.45
19	601908	京运通	3,437,458	20,796,620.90	2.30
20	600206	有研新材	1,404,982	18,461,463.48	2.04
21	000969	安泰科技	1,744,866	16,523,881.02	1.83
22	002002	鸿达兴业	7,264,900	16,273,376.00	1.80
23	000758	中色股份	3,313,265	15,638,610.80	1.73
24	300811	铂科新材	236,900	14,081,336.00	1.56
25	002057	中钢天源	1,261,587	13,246,663.50	1.47
26	600259	广晟有色	359,571	12,994,895.94	1.44
27	300224	正海磁材	877,123	11,279,801.78	1.25
28	600366	宁波韵升	1,190,423	10,559,052.01	1.17
29	000612	焦作万方	1,983,900	9,602,076.00	1.06
30	300066	三川智慧	1,729,515	9,443,151.90	1.05
31	000795	英洛华	1,212,700	9,192,266.00	1.02
32	601609	金田股份	1,404,400	9,114,556.00	1.01

33	002805	丰元股份	398,060	8,629,940.80	0.96
34	002645	华宏科技	518,840	6,360,978.40	0.70
35	300340	科恒股份	489,151	6,246,458.27	0.69
36	300127	银河磁体	229,200	4,155,396.00	0.46
37	600980	北矿科技	260,394	4,114,225.20	0.46
38	688190	云路股份	49,612	3,621,676.00	0.40
39	688077	大地熊	97,482	2,944,931.22	0.33

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	688515	裕太微	4,183	680,783.25	0.08
2	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
5	688249	晶合集成	5,060	91,383.60	0.01
6	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
7	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
8	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
9	688472	阿特斯	3,311	56,419.44	0.01
10	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
11	688469	中芯集成	9,591	51,887.31	0.01
12	688443	智翔金泰	1,734	51,135.66	0.01
13	688361	中科飞测	764	49,407.88	0.01
14	301358	湖南裕能	1,042	44,691.38	0.00
15	688531	日联科技	295	40,111.15	0.00
16	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
17	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
18	301291	明阳电气	1,117	34,660.51	0.00
19	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
20	688484	南芯科技	824	30,249.04	0.00
21	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
22	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
23	688507	索辰科技	207	25,276.77	0.00
24	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
25	001287	中电港	1,088	22,869.76	0.00
26	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
27	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
28	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
29	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
30	601061	中信金属	2,524	19,131.92	0.00
31	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00

32	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
33	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
34	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
35	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
36	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
37	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
38	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
39	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
40	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
41	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
42	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
43	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
44	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
45	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
46	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
47	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
48	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
49	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
50	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
51	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
52	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
53	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
54	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
55	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
56	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
57	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
58	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
59	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
60	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
61	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
62	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
63	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
64	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
65	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
66	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
67	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
68	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
69	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
70	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
71	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
72	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
73	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
74	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00

75	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
76	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
77	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
78	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
79	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
80	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
81	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
82	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
83	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
84	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
85	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
86	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	002240	盛新锂能	16,323,953.12	2.08
2	002340	格林美	15,420,491.00	1.96
3	002202	金风科技	14,087,348.40	1.79
4	600111	北方稀土	11,925,926.00	1.52
5	002600	领益智造	11,712,376.01	1.49
6	000831	中国稀土	10,508,626.15	1.34
7	300066	三川智慧	9,253,602.05	1.18
8	002056	横店东磁	8,983,138.31	1.14
9	300748	金力永磁	7,942,163.97	1.01
10	300811	铂科新材	7,711,956.00	0.98
11	000970	中科三环	7,193,742.85	0.91
12	002002	鸿达兴业	7,116,318.00	0.90
13	002249	大洋电机	6,238,181.41	0.79
14	000758	中色股份	5,224,827.00	0.66
15	000969	安泰科技	4,414,425.45	0.56
16	002057	中钢天源	4,149,487.00	0.53
17	688190	云路股份	3,452,550.17	0.44
18	002805	丰元股份	3,435,294.00	0.44
19	000612	焦作万方	3,189,813.19	0.41
20	300224	正海磁材	3,131,138.00	0.40

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601600	中国铝业	10,601,872.00	1.35
2	002600	领益智造	8,210,213.00	1.04
3	002202	金风科技	8,175,132.00	1.04
4	002340	格林美	7,118,450.00	0.90
5	002240	盛新锂能	6,991,687.00	0.89
6	000831	中国稀土	6,977,412.00	0.89
7	002056	横店东磁	5,951,194.00	0.76
8	000970	中科三环	4,868,621.00	0.62
9	002249	大洋电机	4,286,806.00	0.54
10	000758	中色股份	3,472,553.00	0.44
11	300748	金力永磁	3,289,971.00	0.42
12	300811	铂科新材	3,046,098.00	0.39
13	002057	中钢天源	2,921,762.00	0.37
14	002002	鸿达兴业	2,712,014.00	0.34
15	000969	安泰科技	2,666,013.00	0.34
16	002805	丰元股份	2,461,073.00	0.31
17	000612	焦作万方	2,180,973.00	0.28
18	300224	正海磁材	2,068,229.00	0.26
19	000795	英洛华	1,549,302.00	0.20
20	002645	华宏科技	1,519,661.00	0.19

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	190,985,238.05
卖出股票收入（成交）总额	120,763,713.26

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。

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	250,363.91
2	应收清算款	-
3	应收股利	27,755.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	15,863.11
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	369,598.86

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	600111	北方稀土	1,573,088.00	0.17	新股锁定期内
2	600010	宝钢股份	907,888.00	0.10	新股锁定期内
3	002240	盛新锂能	901,921.00	0.10	新股锁定期内
4	601600	中国铝业	879,498.00	0.10	新股锁定期内
5	002202	金风科技	855,972.00	0.09	新股锁定期内
6	600580	卧龙电驱	580,017.00	0.06	新股锁定期内
7	600392	盛和资源	559,845.00	0.06	新股锁定期内
8	002340	格林美	459,515.00	0.05	新股锁定期内
9	600549	厦门钨业	433,884.00	0.05	新股锁定期内
10	002600	领益智造	276,400.00	0.03	新股锁定期内

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	688515	裕太微	680,783.25	0.08	新股锁定期内
2	301486	致尚科技	277,921.20	0.03	新股未上市
3	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股未上市
4	301488	N 豪恩	93,721.68	0.01	新股未上市
4	301488	N 豪恩	10,422.36	0.00	新股锁定期内
5	688249	晶合集成	91,383.60	0.01	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华泰柏瑞中证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	
		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 (%)
33,23	25,774.0	173,401,266.0	20.2	602,297,962.0	70.3	80,850,610.0	9.44

3	8	0	4	0	2	0
---	---	---	---	---	---	---

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—个险分红	58,497,900.00	6.83
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	42,426,200.00	4.95
3	北京平凡私募基金管理有限公司—平凡浩睿私募证券投资基金	7,000,166.00	0.82
4	华泰证券股份有限公司	6,999,922.00	0.82
5	国泰君安证券股份有限公司	5,400,812.00	0.63
6	俞伟儿	5,006,517.00	0.58
7	许进军	4,612,140.00	0.54
8	华泰证券资管—工商银行—华泰鹏泰3号集合资产管理计划	4,424,600.00	0.52
9	国元农业保险股份有限公司	4,000,000.00	0.47
10	广发证券股份有限公司	3,719,441.00	0.43

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	0.00	0.0000

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（2021年2月26日）基金份额总额	1,999,949,838.00
本报告期期初基金份额总额	746,549,838.00
本报告期基金总申购份额	245,500,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	135,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	856,549,838.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人于 2023 年 5 月 18 日发布《关于中国银河证券股份有限公司托管总部总经理变更的公告》，中国银河证券股份有限公司托管总部总经理自 2023 年 5 月 17 日起变更为鹿宁，罗黎明不再担任托管总部总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

银河证券	4	297,114,514.95	100.00	274,273.88	100.00	-
------	---	----------------	--------	------------	--------	---

注：1、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为，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务。
- 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，无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
银河证券	924,483.00	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023年6月21日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023年6月16日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023年6月3日

4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 5 月 9 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 29 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 19 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 11 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 30 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 22 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 21 日
11	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

§ 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

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

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