

# 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 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 30 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。本年度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 2024 年 03 月 29 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>58</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	76
8.6 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 .....	76
8.7 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 .....	76
8.8 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 .....	76
8.9 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 .....	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
8.12 投资组合报告附注 .....	76
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>77</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	77
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
9.4 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 .....	78
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>78</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
11.2 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 .....	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	79
11.4 基金投资策略的改变 .....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8 其他重大事件 .....	84
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>86</b>
12.1 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 .....	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	87
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>87</b>
13.1 备查文件目录 .....	87
13.2 存放地点 .....	87
13.3 查阅方式 .....	87

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	MSCIETF
场内简称	MSCIETF（扩位证券简称：MSCIETF）
基金主代码	512520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	93,056,394.00 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	2018 年 5 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略；一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	王小飞
	联系电话	021-38601777	021-60637103
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	021-60637228
传真		021-38601799	021-60635778
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-19,080,163.40	-10,887,227.62	72,200,014.90
本期利润	11,868,085.82	-119,827,200.82	39,813,925.96
加权平均基金份额本期利润	0.0916	-0.2608	0.1032
本期加权平均净值利润率	7.91%	-20.80%	5.96%
本期基金份额净值增长率	-9.31%	-17.87%	5.90%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	3,717,206.86	66,396,653.76	208,453,442.77
期末可供分配基金份额利润	0.0399	0.1466	0.5742
期末基金资产净值	96,773,600.86	519,453,047.76	645,474,664.88
期末基金份额	1.0399	1.1466	1.7779

额净值			
3.1.3 累计 期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累 计净值增长 率	32.43%	46.02%	77.79%

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

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

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

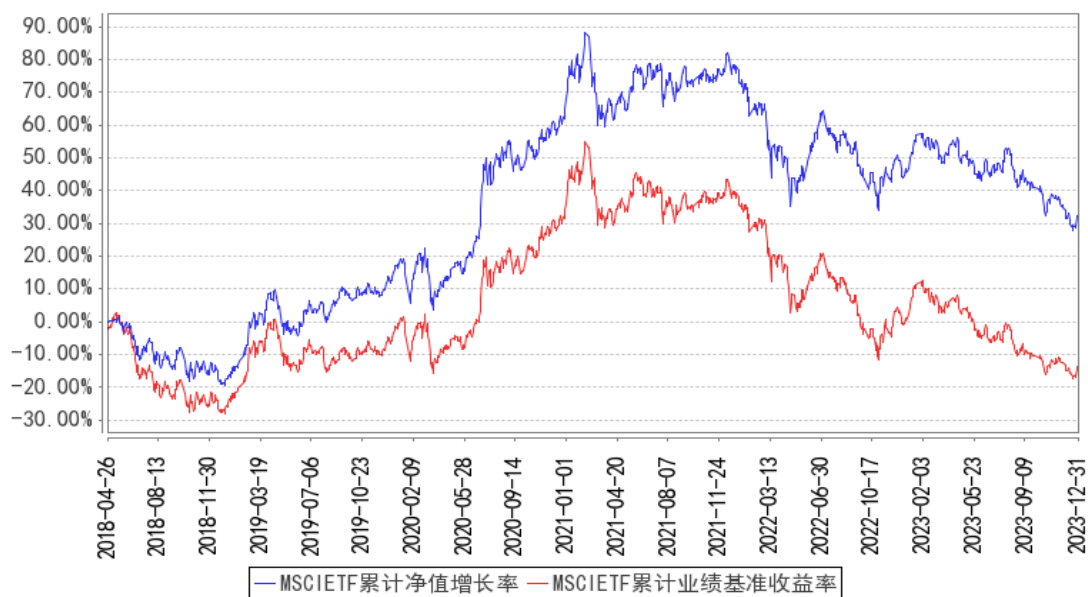
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.15%	0.78%	-3.62%	0.88%	-2.53%	-0.10%
过去六个月	-9.19%	0.82%	-8.23%	0.96%	-0.96%	-0.14%
过去一年	-9.31%	0.80%	-14.56%	0.97%	5.25%	-0.17%
过去三年	-21.11%	1.09%	-36.70%	1.25%	15.59%	-0.16%
过去五年	62.40%	1.19%	18.11%	1.34%	44.29%	-0.15%
自基金合同生效起 至今	32.43%	1.22%	-13.78%	1.37%	46.21%	-0.15%

### 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

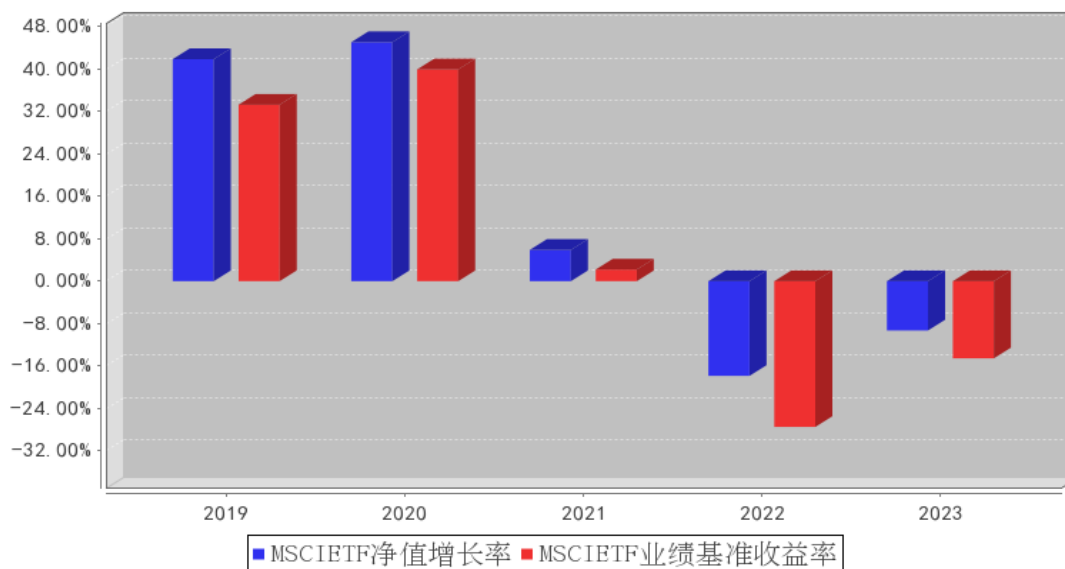
MSCIETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2018年4月26日至2023年12月31日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

MSCIETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023年	-	-	-	-	-
2022年	3.3000	119,808,610.02	-	119,808,610.02	-
2021年	-	-	-	-	-



合计	3.3000	119,808,610.02	-	119,808,610.02
----	--------	----------------	---	----------------

注：本基金报告期末可供分配利润为3,717,206.86元。本基金2023年末未实施过利润分配。

## § 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、华泰柏瑞亨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、华泰柏瑞益享债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦合债券型证券投资基金、华泰柏瑞祥泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、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发起式联接基金、华泰柏瑞科技创新混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、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发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投

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发起式联接基金。截至 2023 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 3801.46 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2018 年 4 月 26 日	-	22 年	复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞锦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月至2023年8月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月至2023年12月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。2023年9月起任华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年10月起任华泰柏瑞中证A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 20 次，其中 4 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 16 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 年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、计算机、电子的表现相对较好，涨跌幅分别为 25.75%、16.80%、8.97%和 7.25%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为-11.38%、-7.42%、-6.28%和-19.41%。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-4.10%和-21.85%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

回顾 2023 年，在经济复苏预期历经调整、海外经济保持紧缩态势等内外因素综合影响下，库存周期及中美经济周期错位的驱动下，市场呈现震荡走势。从估值和盈利贡献拆解角度看，指数的收益率落后于 ROE，估值的持续收缩成为指数承压的重要拖累。

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 0.040%，期间日跟踪误差为 0.056%，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 1.0399 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.31%，业绩比较基准收益率为-14.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国内增长相对乏力、美债利率上行以及海外资金流出共同导致了风险溢价的抬升，这种抬升导致的过度悲观预期或已经反应在当前市场资产价格上，当前 A 股赔率处于历史高位，股债性价比已经达到了较高分位。确定性较高的驱动因素在于：1、国内积极财政政策的前置，财政政策将对基建发力形成积极支撑。2、部分行业逐渐进入到补库存周期，存货净增加或成为基本边际改善的来源之一，后续工业稳增长政策是影响当前及明年库存补库节奏的重要变量。3、中美经济周期错位预计或将进入下半场，宽基指数配置机会可能大于风险。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投

资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

无。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22200 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞MSCI ETF基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞MSCI ETF基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>

形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞 MSCI ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞 MSCI ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞 MSCI ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞 MSCI ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞 MSCI ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞 MSCI ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得</p>

	<p>的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞 MSCI ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,935,272.31	9,926,995.56
结算备付金		4,001,927.54	12,134,549.46
存出保证金		758,054.21	2,593,905.51
交易性金融资产	7.4.7.2	90,275,233.56	495,720,543.02
其中：股票投资		90,275,233.56	495,699,542.74
基金投资		-	-
债券投资		-	21,000.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		14,737.48	251,461.32
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		96,985,225.10	520,627,454.87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,262.83	67,180.18
应付托管费		4,087.61	22,393.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	195,273.80	1,084,833.12
负债合计		211,624.24	1,174,407.11
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	93,056,394.00	453,056,394.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	3,717,206.86	66,396,653.76
净资产合计		96,773,600.86	519,453,047.76
负债和净资产总计		96,985,225.10	520,627,454.87

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0399 元，基金份额总额 93,056,394.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		12,506,190.85	-118,204,608.16
1. 利息收入		104,903.13	179,617.56
其中：存款利息收入	7.4.7.13	104,903.13	179,617.56
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,399,816.17	-10,423,992.45
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-19,769,795.36	-19,298,833.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	24,191.75	253,806.09
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-499,768.71	-3,840,242.88
股利收益	7.4.7.19	1,845,556.15	12,461,277.50
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）	7.4.7.20	30,948,249.22	-108,939,973.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-147,145.33	979,739.93
<b>减：二、营业总支出</b>		638,105.03	1,622,592.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	236,911.71	865,369.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	78,970.66	288,456.39
3. 销售服务费		-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,501.90	0.68
8. 其他费用	7.4.7.23	320,720.76	468,766.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,868,085.82	-119,827,200.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,868,085.82	-119,827,200.82
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		11,868,085.82	-119,827,200.82

### 7.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	453,056,394.00	-	66,396,653.76	519,453,047.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	453,056,394.00	-	66,396,653.76	519,453,047.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-360,000,000.0 0	-	-62,679,446.90	-422,679,446.90
（一）、综合收益总额	-	-	11,868,085.82	11,868,085.82
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-360,000,000.0 0	-	-74,547,532.72	-434,547,532.72
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	-	561,428.73	3,561,428.73
2. 基金赎回款	-363,000,000.0 0	-	-75,108,961.45	-438,108,961.45
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	93,056,394.00	-	3,717,206.86	96,773,600.86
项目	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	363,056,394.00	-	282,418,270.88	645,474,664.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	363,056,394.00	-	282,418,270.88	645,474,664.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	90,000,000.00	-	-216,021,617.12	-126,021,617.12
(一)、综合收益总额	-	-	-119,827,200.82	-119,827,200.82
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	90,000,000.00	-	23,614,193.72	113,614,193.72
其中：1. 基金申购款	219,000,000.00	-	51,880,167.47	270,880,167.47
2. 基金赎回款	-129,000,000.00	-	-28,265,973.75	-157,265,973.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-119,808,610.02	-119,808,610.02
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	453,056,394.00	-	66,396,653.76	519,453,047.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]501 号《关于准予华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通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 1,547,024,828.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0284 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,547,056,394.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 31,566.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2018]58 号文审核同意,本基金 1,547,056,394.00 份基金份额于 2018 年 5 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定,在履行适当程序后参与融资及转融通证券出借业务。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》,本基金自 2019 年 10 月 16 日起,修改上述投资范围表述:本基金可根据法律法规的规定,参与转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。



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 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(以下简称“华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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 MSCI 中国 A 股国际通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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，

以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融

资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的

差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。



## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	活期存款	1,935,272.31		9,926,995.56
等于：本金	1,935,019.79		9,926,034.19	
加：应计利息	252.52		961.37	
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	1,935,272.31		9,926,995.56	

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	110,513,891.85	-	90,275,233.56	-20,238,658.29
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	110,513,891.85	-	90,275,233.56	-20,238,658.29
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	546,299,870.25	-	495,699,542.74	-50,600,327.51
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	21,000.00	0.28	21,000.28	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	21,000.00	0.28	21,000.28	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		546,320,870.25	0.28	495,720,543.02	-50,600,327.51

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,305,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	6,305,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,305,000.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	20,525,860.00	-	-	-
其中：股指期货投资	20,525,860.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	20,525,860.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2401	中证 500 股指期货 2401	2.00	2,174,720.00	-35,160.00
IF2401	深 300 股指期货 2401	4.00	4,127,760.00	32,640.00
合计				-2,520.00
减：可抵销期货暂收款				-2,520.00
净额				-

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

#### 7.4.7.3.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31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	330.85	46,076.61
其中：交易所市场	330.85	46,076.61
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	194,942.95	180,000.00
应付指数使用费	-	858,756.51
合计	195,273.80	1,084,833.12

#### 7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	453,056,394.00	453,056,394.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-363,000,000.00	-363,000,000.00
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	93,056,394.00	93,056,394.00

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。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未有其他综合收益。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	97,853,247.75	-31,456,593.99	66,396,653.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	97,853,247.75	-31,456,593.99	66,396,653.76
本期利润	-19,080,163.40	30,948,249.22	11,868,085.82
本期基金份额交易产生的变动数	-66,621,216.91	-7,926,315.81	-74,547,532.72
其中：基金申购款	648,550.01	-87,121.28	561,428.73
金赎回款	-67,269,766.92	-7,839,194.53	-75,108,961.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,151,867.44	-8,434,660.58	3,717,206.86

## 7.4.7.13 存款利息收入

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	14,726.35	44,333.78
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	89,446.99	134,008.32
其他	729.79	1,275.46
合计	104,903.13	179,617.56

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,092,580.98	-12,769,978.44
股票投资收益——赎回差价收入	-10,677,214.38	-6,528,854.72
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	-19,769,795.36	-19,298,833.16

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	225,500,866.64	396,722,574.03
减：卖出股票成本总额	234,223,913.82	408,508,961.68
减：交易费用	369,533.80	983,590.79
买卖股票差价收入	-9,092,580.98	-12,769,978.44

## 7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
赎回基金份额对价总额	438,108,961.45	157,265,973.75
减：现金支付赎回款总额	206,214,282.45	69,521,978.75
减：赎回股票成本总额	242,571,893.38	94,272,849.72
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-10,677,214.38	-6,528,854.72

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

### 7.4.7.15 债券投资收益

#### 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	17.70	186.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	24,174.05	253,619.32
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	24,191.75	253,806.09

#### 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	123,997.30	1,289,244.60
减：卖出债券（债转股	99,800.00	1,035,400.00

及债券到期兑付) 成本总额		
减: 应计利息总额	18.29	196.36
减: 交易费用	4.96	28.92
买卖债券差价收入	24,174.05	253,619.32

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无权证差价收入。



## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-499,768.71	-3,840,242.88

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,845,556.15	12,461,277.50
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,845,556.15	12,461,277.50

## 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	30,361,669.22	-108,651,293.20
股票投资	30,361,669.22	-108,647,740.00
债券投资	-	-3,553.20
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	586,580.00	-288,680.00
权证投资	-	-
期货投资	586,580.00	-288,680.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	30,948,249.22	-108,939,973.20

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	-	-

其他收入	1,975.37	826.80
替代损益	-149,120.70	978,913.13
合计	-147,145.33	979,739.93

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	140,395.76	288,456.39
银行划款手续费	325.00	310.00
合计	320,720.76	468,766.39

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度伍(5)千美元或等值人民币(即不足5千美元部分按照5千美元或等值人民币收取)。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东

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 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（“华泰柏瑞 MSCIETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	52,443,199.78	20.11	186,258,007.77	26.31

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	46,258.65	37.77	32.56	9.84
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	169,437.74	36.68	16,013.11	34.75

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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	236,911.71	865,369.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,706.55	6,549.42
应支付基金管理人的净管理费	229,205.16	858,819.78

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	78,970.66	288,456.39

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 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

##### 7.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

## 7.4.10.5.2 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12月31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	15,710,141.00	16.8824	374,081,441.00	82.5684
华泰证券股份有限公司	1,359,450.00	1.4609	1,161,068.00	0.2563

## 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,935,272.31	14,726.35	9,926,995.56	44,333.78

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。

## 7.4.10.7 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

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
本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
华泰联合证券	110095	双良转债	网上配售	70	7,000.00
华泰联合证券	118031	天23转债	网上配售	260	26,000.00
华泰联合证券	113066	平煤转债	网上配售	90	9,000.00
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	2,889	46,917.36
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	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	916	14,564.40
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	4,312	47,863.20
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	1,982	41,463.44
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	14,075	80,086.75
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	1,294	24,844.80
华泰联合证券	688602	康鹏科技	网下申购	2,692	23,312.72

华泰联合证券	688693	锆威特	网下申购	650	26,539.50
华泰联合证券	688720	艾森股份	网下申购	794	22,255.82
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	301207	华兰疫苗	网下申购	3,721	211,650.48
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
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	688253	英诺特	网下申购	4,364	113,725.84
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	688353	华盛锂电	网下申购	2,778	273,216.30
华泰联合证券	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35
华泰联合证券	688351	微电生理	网下申购	10,946	180,718.46
华泰联合证券	301327	华宝新能	网下申购	2,296	545,300.00
华泰联合证券	301339	通行宝	网下申购	9,127	171,405.06
华泰联合证券	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合证券	301290	东星医疗	网下申购	3,291	145,100.19
华泰联合证券	301277	新天地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合证券	123145	药石转债	网上配售	127	12,700.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 18,200 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 284,306.01 元，估值总额为人民币 253,890.00 元，占基金净资产的比例为 0.26%(2022 年 12 月 31 日：本基金持有 97,200 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 1,604,788.22 元，估值总额为人民币 1,238,328.00 元，占基金净资产的比例为 114.15%)。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 23,436 股建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 143,389.65 元，估值总额为人民币 152,568.36 元，占基金资产净值的比例为 0.16%(2022 年 12 月 31 日：本基金持有 126,736 股建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 788,303.38 元，估值总额为人民币 713,523.68 元，占基金资产净值的比例为 0.14%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定期内	11.25	11.07	156	1,755.00	1,726.92	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	705	1,198.50	2,862.30	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定期内	16.80	31.19	50	840.00	1,559.50	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定期内	58.08	57.81	24	1,393.92	1,387.44	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定期内	23.10	23.31	46	1,062.60	1,072.26	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定期内	14.23	18.19	67	953.41	1,218.73	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	15.32	23.87	61	934.52	1,456.07	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定期内	17.38	16.66	67	1,164.46	1,116.22	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	21.29	21.53	43	915.47	925.79	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股锁定期内	21.77	29.58	54	1,175.58	1,597.32	-

603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	9.50	18.97	87	826.50	1,650.39	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定期内	49.97	39.70	32	1,599.04	1,270.40	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定期内	25.73	24.88	47	1,209.31	1,169.36	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定期内	19.10	34.75	41	783.10	1,424.75	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股锁定期内	53.09	36.42	50	2,654.50	1,821.00	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定期内	9.87	12.75	450	4,441.50	5,737.50	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定期内	5.18	8.09	662	3,429.16	5,355.58	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股锁定期内	78.99	60.49	72	5,687.28	4,355.28	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股锁定期内	23.68	28.80	139	3,291.52	4,003.20	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	26.74	38.67	116	3,101.84	4,485.72	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股锁定期内	24.98	28.02	155	3,871.90	4,343.10	-
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	新股锁定期内	50.50	50.53	108	5,454.00	5,457.24	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股锁定期内	8.66	11.06	270	2,338.20	2,986.20	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期内	55.00	74.14	56	3,080.00	4,151.84	-



688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股锁定期内	73.33	51.00	71	5,206.43	3,621.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股锁定期内	47.29	37.97	57	2,695.53	2,164.29	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定期内	46.77	87.72	64	2,993.28	5,614.08	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	46.80	36.07	75	3,510.00	2,705.25	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股锁定期内	15.18	21.43	150	2,277.00	3,214.50	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定期内	39.90	46.05	75	2,992.50	3,453.75	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定期内	31.95	52.25	77	2,460.15	4,023.25	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定期内	10.50	15.99	224	2,352.00	3,581.76	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定期内	103.40	78.23	25	2,585.00	1,955.75	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股锁定期内	36.12	34.30	119	4,298.28	4,081.70	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定期内	40.83	43.41	65	2,653.95	2,821.65	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股锁定期内	42.66	48.18	72	3,071.52	3,468.96	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定期内	29.66	36.39	78	2,313.48	2,838.42	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股锁定期内	69.98	60.10	42	2,939.16	2,524.20	-

688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股锁定期内	28.03	49.84	80	2,242.40	3,987.20	-
--------	------	-------------	-----	--------	-------	-------	----	----------	----------	---

注：1、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新股中需要限售的部分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。

2、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。

3、基金作为特定投资者，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。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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，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 12 月 31 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 0.004%)。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 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时间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 7.4.12。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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	1,935,272.31	-	-	-	-	-	1,935,272.31
结算备付金	4,001,927.54	-	-	-	-	-	4,001,927.54
存出保证金	1,756.61	-	-	-	-	756,297.60	758,054.21
交易性金融资产	-	-	-	-	-	90,275,233.56	90,275,233.56
应收清算款	-	-	-	-	-	14,737.48	14,737.48
资产总计	5,938,956.46	-	-	-	-	91,046,268.64	96,985,225.10
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,262.83	12,262.83
应付托管费	-	-	-	-	-	4,087.61	4,087.61
其他负债	-	-	-	-	-	195,273.80	195,273.80
负债总计	-	-	-	-	-	211,624.24	211,624.24
利率敏感度缺口	5,938,956.46	-	-	-	-	90,834,644.40	96,773,600.86
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							
货币资金	9,926,995.56	-	-	-	-	-	9,926,995.56
结算备付金	12,134,549.46	-	-	-	-	-	12,134,549.46
存出保证金	37,011.11	-	-	-	-	2,556,894.40	2,593,905.51
交易性金融资产	-	-	-	-	21,000.28	495,699,542.74	495,720,543.02
应收清算款	-	-	-	-	-	251,461.32	251,461.32
资产总计	22,098,556.13	-	-	-	21,000.28	498,507,898.46	520,627,454.87

负债							
应付管理人报酬		-	-	-	-	67,180.18	67,180.18
应付托管费		-	-	-	-	22,393.40	22,393.40
应交税费		-	-	-	-	0.41	0.41
其他负债		-	-	-	-	1,084,833.12	1,084,833.12
负债总计		-	-	-	-	1,174,407.11	1,174,407.11
利率敏感度缺口	22,098,556.13	-	-	-	-21,000.28	497,333,491.35	519,453,047.76

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：0.004%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	90,275,233.56	93.28	495,699,542.74	95.43
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	90,275,233.56	93.28	495,699,542.74	95.43

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 MSCI 中国 A 股国际通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12月31日)	上年度末(2022年12月31日)
	MSCI 中国 A 股国际通指数上升 5%	3,783,338.82	21,168,193.76
MSCI 中国 A 股国际通指数下降 5%	-3,783,338.82	-21,168,193.76	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	90,162,043.69	491,446,831.20

第二层次	-	615,986.08
第三层次	113,189.87	3,657,725.74
合计	90,275,233.56	495,720,543.02

#### 7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,657,725.74	3,657,725.74
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	556,680.50	556,680.50
转出第三层次	-	5,336,308.75	5,336,308.75
当期利得或损失总额	-	1,235,092.38	1,235,092.38
其中：计入损益的利得或损失	-	1,235,092.38	1,235,092.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	113,189.87	113,189.87
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	15,437.88	15,437.88
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		



	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,320,211.12	4,320,211.12
转出第三层次	-	2,094,739.83	2,094,739.83
当期利得或损失总额	-	1,432,254.45	1,432,254.45
其中：计入损益的利得或损失	-	1,432,254.45	1,432,254.45
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,657,725.74	3,657,725.74
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	749,724.44	749,724.44

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	113,189.87	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	3,657,725.74	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891~2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2023 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 3,561,428.73 元(2022 年度：270,880,167.47 元)，其中包括以股票支付的申购款 1,975,868.00 元和以现金支付的申购款 1,585,560.73 元(2022 年度：其中包括以股票支付的申购款 149,726,940.50 元和以现金支付的申购款 121,153,226.97 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	90,275,233.56	93.08
	其中：股票	90,275,233.56	93.08
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	5,937,199.85	6.12
8	其他各项资产	772,791.69	0.80
9	合计	96,985,225.10	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	1,034,035.64	1.07

B	采矿业	4,367,768.83	4.51
C	制造业	50,282,107.54	51.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,709,836.70	3.83
E	建筑业	1,810,382.06	1.87
F	批发和零售业	968,347.11	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,222,827.08	3.33
H	住宿和餐饮业	112,506.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,129,904.93	4.27
J	金融业	16,640,414.87	17.20
K	房地产业	1,201,597.51	1.24
L	租赁和商务服务业	725,705.75	0.75
M	科学研究和技术服务业	675,725.60	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	112,680.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	59,976.00	0.06
Q	卫生和社会工作	566,032.47	0.58
R	文化、体育和娱乐业	412,817.60	0.43
S	综合	129,378.00	0.13
	合计	90,162,043.69	93.17

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 8.2.2 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	101,159.74	0.10
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	1,726.92	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,878.46	0.01

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,424.75	0.00
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	113,189.87	0.12

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 8.2.3 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。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	600519	贵州茅台	3,149	5,435,174.00	5.62
2	300750	宁德时代	10,860	1,773,003.60	1.83
3	600036	招商银行	50,754	1,411,976.28	1.46
4	600900	长江电力	60,250	1,406,235.00	1.45
5	000858	五粮液	9,606	1,347,817.86	1.39
6	601318	中国平安	26,544	1,069,723.20	1.11
7	002594	比亚迪	4,471	885,258.00	0.91
8	300760	迈瑞医疗	3,000	871,800.00	0.90
9	601166	兴业银行	51,082	828,039.22	0.86
10	601288	农业银行	209,577	762,860.28	0.79
11	601398	工商银行	154,917	740,503.26	0.77
12	600276	恒瑞医药	15,814	715,267.22	0.74
13	600809	山西汾酒	3,000	692,190.00	0.72
14	000568	泸州老窖	3,687	661,521.54	0.68
15	601899	紫金矿业	50,656	631,173.76	0.65
16	600030	中信证券	30,269	616,579.53	0.64
17	002475	立讯精密	17,685	609,248.25	0.63
18	600309	万华化学	7,700	591,514.00	0.61
19	601328	交通银行	96,664	554,851.36	0.57

20	601816	京沪高铁	112,700	554,484.00	0.57
21	002714	牧原股份	13,458	554,200.44	0.57
22	300059	东方财富	39,122	549,272.88	0.57
23	601088	中国神华	16,200	507,870.00	0.52
24	601225	陕西煤业	23,889	499,041.21	0.52
25	601668	中国建筑	103,204	496,411.24	0.51
26	002352	顺丰控股	11,967	483,466.80	0.50
27	600000	浦发银行	72,289	478,553.18	0.49
28	601138	工业富联	31,000	468,720.00	0.48
29	603259	药明康德	6,360	462,753.60	0.48
30	000001	平安银行	47,829	449,114.31	0.46
31	600406	国电南瑞	19,790	441,712.80	0.46
32	603288	海天味业	11,491	436,083.45	0.45
33	600028	中国石化	78,030	435,407.40	0.45
34	601012	隆基绿能	18,788	430,245.20	0.44
35	688111	金山办公	1,348	426,237.60	0.44
36	600887	伊利股份	15,724	420,617.00	0.43
37	002304	洋河股份	3,700	406,630.00	0.42
38	601601	中国太保	16,900	401,882.00	0.42
39	601888	中国中免	4,799	401,628.31	0.42
40	601857	中国石油	53,183	375,471.98	0.39
41	300015	爱尔眼科	23,017	364,128.94	0.38
42	300122	智飞生物	5,950	363,604.50	0.38
43	600436	片仔癀	1,500	362,985.00	0.38
44	000725	京东方 A	92,196	359,564.40	0.37
45	601985	中国核电	46,500	348,750.00	0.36
46	601988	中国银行	86,495	345,115.05	0.36
47	002371	北方华创	1,400	343,994.00	0.36
48	000625	长安汽车	20,392	343,197.36	0.35
49	600050	中国联通	78,300	342,954.00	0.35
50	601818	光大银行	114,327	331,548.30	0.34
51	600690	海尔智家	15,602	327,642.00	0.34
52	300498	温氏股份	16,320	327,379.20	0.34
53	600016	民生银行	87,356	326,711.44	0.34
54	002142	宁波银行	16,237	326,526.07	0.34
55	600019	宝钢股份	54,770	324,786.10	0.34
56	300274	阳光电源	3,700	324,083.00	0.33
57	600150	中国船舶	11,000	323,840.00	0.33
58	601766	中国中车	59,900	315,074.00	0.33
59	601658	邮储银行	71,600	311,460.00	0.32
60	603501	韦尔股份	2,903	309,779.13	0.32
61	600905	三峡能源	70,500	308,085.00	0.32
62	601919	中远海控	31,552	302,268.16	0.31

63	600048	保利发展	29,510	292,149.00	0.30
64	600031	三一重工	20,937	288,302.49	0.30
65	601390	中国中铁	50,600	287,408.00	0.30
66	600919	江苏银行	42,779	286,191.51	0.30
67	601127	赛力斯	3,700	281,940.00	0.29
68	688036	传音控股	2,035	281,644.00	0.29
69	600438	通威股份	11,100	277,833.00	0.29
70	601211	国泰君安	18,621	277,080.48	0.29
71	601006	大秦铁路	37,900	273,259.00	0.28
72	002230	科大讯飞	5,772	267,705.36	0.28
73	000063	中兴通讯	10,000	264,800.00	0.27
74	600989	宝丰能源	17,900	264,383.00	0.27
75	688041	海光信息	3,720	264,045.60	0.27
76	600104	上汽集团	19,129	258,815.37	0.27
77	002493	荣盛石化	24,878	257,487.30	0.27
78	000596	古井贡酒	1,100	256,080.00	0.26
79	601688	华泰证券	18,200	253,890.00	0.26
80	601066	中信建投	10,700	253,162.00	0.26
81	000002	万 科 A	23,969	250,715.74	0.26
82	600999	招商证券	18,340	250,157.60	0.26
83	600893	航发动力	6,605	246,894.90	0.26
84	000166	申万宏源	55,511	246,468.84	0.25
85	600886	国投电力	18,400	242,512.00	0.25
86	688012	中微公司	1,562	239,923.20	0.25
87	601169	北京银行	52,055	235,809.15	0.24
88	600346	恒力石化	17,380	228,894.60	0.24
89	000338	潍柴动力	16,761	228,787.65	0.24
90	000895	双汇发展	8,537	228,023.27	0.24
91	603993	洛阳钼业	43,482	226,106.40	0.23
92	300308	中际旭创	2,000	225,820.00	0.23
93	002027	分众传媒	35,642	225,257.44	0.23
94	600837	海通证券	23,854	223,511.98	0.23
95	600585	海螺水泥	9,886	223,028.16	0.23
96	000651	格力电器	6,900	221,973.00	0.23
97	300033	同花顺	1,400	219,618.00	0.23
98	688271	联影医疗	1,600	219,216.00	0.23
99	601995	中金公司	5,700	216,885.00	0.22
100	000538	云南白药	4,411	216,800.65	0.22
101	600845	宝信软件	4,399	214,671.20	0.22
102	000792	盐湖股份	13,400	213,730.00	0.22
103	300014	亿纬锂能	5,025	212,055.00	0.22
104	000776	广发证券	14,666	209,577.14	0.22
105	601229	上海银行	34,969	208,764.93	0.22

106	601669	中国电建	42,447	207,565.83	0.21
107	601111	中国国航	28,200	206,988.00	0.21
108	002466	天齐锂业	3,700	206,423.00	0.21
109	001979	招商蛇口	21,658	206,400.74	0.21
110	601689	拓普集团	2,800	205,800.00	0.21
111	300124	汇川技术	3,250	205,205.00	0.21
112	600547	山东黄金	8,891	203,337.17	0.21
113	000100	TCL 科技	46,234	198,806.20	0.21
114	601628	中国人寿	6,818	193,290.30	0.20
115	300782	卓胜微	1,368	192,888.00	0.20
116	601009	南京银行	25,464	187,924.32	0.19
117	600188	兖矿能源	9,450	187,204.50	0.19
118	600660	福耀玻璃	4,941	184,743.99	0.19
119	002311	海大集团	4,100	184,131.00	0.19
120	601600	中国铝业	32,600	183,864.00	0.19
121	600015	华夏银行	32,677	183,644.74	0.19
122	600795	国电电力	44,000	183,040.00	0.19
123	600085	同仁堂	3,400	182,580.00	0.19
124	000963	华东医药	4,396	182,258.16	0.19
125	601100	恒立液压	3,328	181,975.04	0.19
126	002920	德赛西威	1,400	181,314.00	0.19
127	688008	澜起科技	3,076	180,745.76	0.19
128	002241	歌尔股份	8,452	177,576.52	0.18
129	300896	爱美客	600	176,598.00	0.18
130	600011	华能国际	22,578	173,850.60	0.18
131	002460	赣锋锂业	4,053	173,468.40	0.18
132	600111	北方稀土	8,867	171,487.78	0.18
133	600703	三安光电	12,300	170,355.00	0.18
134	600089	特变电工	12,340	170,292.00	0.18
135	002459	晶澳科技	8,216	170,235.52	0.18
136	601868	中国能建	79,800	167,580.00	0.17
137	600674	川投能源	11,000	166,320.00	0.17
138	601901	方正证券	20,300	163,618.00	0.17
139	600010	包钢股份	111,744	163,146.24	0.17
140	601336	新华保险	5,200	161,876.00	0.17
141	300433	蓝思科技	12,200	161,040.00	0.17
142	600958	东方证券	18,495	160,906.50	0.17
143	600115	中国东航	41,410	160,670.80	0.17
144	000661	长春高新	1,100	160,380.00	0.17
145	601699	潞安环能	7,315	160,271.65	0.17
146	600029	南方航空	27,600	158,976.00	0.16
147	000425	徐工机械	29,100	158,886.00	0.16
148	002129	TCL 中环	10,050	157,182.00	0.16

149	601360	三六零	17,400	156,774.00	0.16
150	300832	新产业	2,000	156,400.00	0.16
151	688599	天合光能	5,468	156,002.04	0.16
152	603392	万泰生物	2,072	155,669.36	0.16
153	601633	长城汽车	6,096	153,741.12	0.16
154	688396	华润微	3,426	153,107.94	0.16
155	000301	东方盛虹	15,900	152,640.00	0.16
156	601939	建设银行	23,436	152,568.36	0.16
157	603986	兆易创新	1,636	151,150.04	0.16
158	603369	今世缘	3,100	151,125.00	0.16
159	600588	用友网络	8,464	150,574.56	0.16
160	002236	大华股份	8,100	149,445.00	0.15
161	601788	光大证券	9,600	148,032.00	0.15
162	600221	海航控股	106,400	145,768.00	0.15
163	688223	晶科能源	16,388	145,197.68	0.15
164	600926	杭州银行	14,502	145,165.02	0.15
165	600426	华鲁恒升	5,260	145,123.40	0.15
166	002049	紫光国微	2,100	141,645.00	0.15
167	300316	晶盛机电	3,200	141,088.00	0.15
168	300408	三环集团	4,700	138,415.00	0.14
169	000983	山西焦煤	14,002	138,339.76	0.14
170	000938	紫光股份	7,136	138,081.60	0.14
171	688188	柏楚电子	542	137,185.62	0.14
172	601825	沪农商行	23,800	136,612.00	0.14
173	002812	恩捷股份	2,400	136,368.00	0.14
174	600570	恒生电子	4,716	135,632.16	0.14
175	002736	国信证券	15,825	135,145.50	0.14
176	601618	中国中冶	44,000	134,640.00	0.14
177	600600	青岛啤酒	1,800	134,550.00	0.14
178	600039	四川路桥	17,919	134,213.31	0.14
179	601916	浙商银行	53,060	133,711.20	0.14
180	002252	上海莱士	16,600	132,800.00	0.14
181	002050	三花智控	4,500	132,300.00	0.14
182	600196	复星医药	5,277	132,083.31	0.14
183	603799	华友钴业	4,002	131,785.86	0.14
184	600584	长电科技	4,400	131,384.00	0.14
185	601881	中国银河	10,900	131,345.00	0.14
186	600745	闻泰科技	3,100	131,161.00	0.14
187	688303	大全能源	4,410	130,403.70	0.13
188	601727	上海电气	31,200	130,104.00	0.13
189	002001	新和成	7,652	129,777.92	0.13
190	600741	华域汽车	7,820	127,309.60	0.13
191	600023	浙能电力	27,500	126,775.00	0.13



192	688256	寒武纪	935	126,187.60	0.13
193	601377	兴业证券	21,283	124,931.21	0.13
194	002648	卫星化学	8,374	123,516.50	0.13
195	000999	华润三九	2,453	121,987.69	0.13
196	601021	春秋航空	2,400	120,480.00	0.12
197	000977	浪潮信息	3,628	120,449.60	0.12
198	300999	金龙鱼	3,600	120,168.00	0.12
199	002709	天赐材料	4,760	119,380.80	0.12
200	600489	中金黄金	11,900	118,524.00	0.12
201	601872	招商轮船	20,100	118,188.00	0.12
202	600918	中泰证券	17,200	117,992.00	0.12
203	600161	天坛生物	3,800	117,572.00	0.12
204	300413	芒果超媒	4,660	117,432.00	0.12
205	002600	领益智造	17,300	116,948.00	0.12
206	688126	沪硅产业	6,750	116,910.00	0.12
207	600256	广汇能源	16,200	115,668.00	0.12
208	601607	上海医药	6,860	114,767.80	0.12
209	000157	中联重科	17,510	114,340.30	0.12
210	601877	正泰电器	5,300	114,003.00	0.12
211	688301	奕瑞科技	349	113,515.74	0.12
212	601319	中国人保	23,300	112,772.00	0.12
213	603806	福斯特	4,629	112,345.83	0.12
214	300418	昆仑万维	3,000	112,200.00	0.12
215	600160	巨化股份	6,700	110,483.00	0.11
216	688072	拓荆科技	474	109,636.20	0.11
217	301236	软通动力	2,350	108,570.00	0.11
218	300759	康龙化成	3,725	107,950.50	0.11
219	600803	新奥股份	6,400	107,648.00	0.11
220	600061	国投资本	15,900	107,166.00	0.11
221	002938	鹏鼎控股	4,800	107,136.00	0.11
222	603659	璞泰来	5,116	107,077.88	0.11
223	300661	圣邦股份	1,202	106,990.02	0.11
224	002821	凯莱英	920	106,812.00	0.11
225	601865	福莱特	4,000	106,800.00	0.11
226	600027	华电国际	20,700	106,398.00	0.11
227	600183	生益科技	5,800	106,198.00	0.11
228	603198	迎驾贡酒	1,600	106,064.00	0.11
229	002422	科伦药业	3,632	105,509.60	0.11
230	600026	中远海能	8,600	105,264.00	0.11
231	000807	云铝股份	8,600	105,092.00	0.11
232	600522	中天科技	8,400	104,916.00	0.11
233	601799	星宇股份	800	104,888.00	0.11
234	600233	圆通速递	8,500	104,465.00	0.11

235	000876	新希望	11,207	104,449.24	0.11
236	000617	中油资本	19,300	104,220.00	0.11
237	601238	广汽集团	11,900	104,125.00	0.11
238	600515	海南机场	28,100	103,970.00	0.11
239	601838	成都银行	9,200	103,592.00	0.11
240	002555	三七互娱	5,500	103,455.00	0.11
241	002463	沪电股份	4,660	103,079.20	0.11
242	000975	银泰黄金	6,820	102,300.00	0.11
243	600009	上海机场	3,114	102,076.92	0.11
244	603260	合盛硅业	2,000	102,000.00	0.11
245	603939	益丰药房	2,540	101,701.60	0.11
246	600985	淮北矿业	6,100	101,443.00	0.10
247	002601	龙佰集团	5,900	101,067.00	0.10
248	688169	石头科技	357	101,013.15	0.10
249	600875	东方电气	6,900	100,878.00	0.10
250	000786	北新建材	4,300	100,448.00	0.10
251	600332	白云山	3,479	99,499.40	0.10
252	600079	人福医药	4,000	99,440.00	0.10
253	002007	华兰生物	4,490	99,363.70	0.10
254	002028	思源电气	1,900	98,876.00	0.10
255	000408	藏格矿业	3,900	98,826.00	0.10
256	600415	小商品城	13,500	98,820.00	0.10
257	601878	浙商证券	9,400	98,042.00	0.10
258	600176	中国巨石	9,894	97,258.02	0.10
259	002916	深南电路	1,360	96,546.40	0.10
260	300496	中科创达	1,200	96,072.00	0.10
261	603195	公牛集团	1,000	95,650.00	0.10
262	003816	中国广核	30,700	95,477.00	0.10
263	002602	世纪华通	18,460	95,253.60	0.10
264	300751	迈为股份	732	94,801.32	0.10
265	002074	国轩高科	4,400	94,600.00	0.10
266	601117	中国化学	14,838	94,369.68	0.10
267	300628	亿联网络	3,190	94,264.50	0.10
268	000933	神火股份	5,600	94,080.00	0.10
269	300142	沃森生物	4,000	94,040.00	0.10
270	002603	以岭药业	4,040	93,202.80	0.10
271	600362	江西铜业	5,155	92,068.30	0.10
272	603833	欧派家居	1,320	91,885.20	0.09
273	002294	信立泰	2,807	91,676.62	0.09
274	605117	德业股份	1,090	91,451.00	0.09
275	605499	东鹏饮料	500	91,255.00	0.09
276	603290	斯达半导	500	90,500.00	0.09
277	601058	赛轮轮胎	7,700	90,475.00	0.09

278	688122	西部超导	1,684	89,639.32	0.09
279	601108	财通证券	11,510	89,317.60	0.09
280	601233	桐昆股份	5,900	89,267.00	0.09
281	601077	渝农商行	21,800	88,944.00	0.09
282	601555	东吴证券	12,125	88,633.75	0.09
283	002156	通富微电	3,800	87,856.00	0.09
284	000932	华菱钢铁	17,000	87,550.00	0.09
285	603688	石英股份	1,000	86,880.00	0.09
286	002223	鱼跃医疗	2,500	86,450.00	0.09
287	600348	华阳股份	8,850	86,376.00	0.09
288	603899	晨光股份	2,300	86,365.00	0.09
289	300037	新宙邦	1,820	86,086.00	0.09
290	000630	铜陵有色	26,200	85,936.00	0.09
291	600546	山煤国际	4,900	85,799.00	0.09
292	600219	南山铝业	28,900	84,966.00	0.09
293	600018	上港集团	17,206	84,309.40	0.09
294	601168	西部矿业	5,900	84,193.00	0.09
295	300223	北京君正	1,300	84,045.00	0.09
296	600733	北汽蓝谷	13,700	83,981.00	0.09
297	002078	太阳纸业	6,900	83,973.00	0.09
298	603345	安井食品	800	83,688.00	0.09
299	600109	国金证券	9,200	83,536.00	0.09
300	688777	中控技术	1,833	83,126.55	0.09
301	000733	振华科技	1,400	82,376.00	0.09
302	002064	华峰化学	12,200	81,862.00	0.08
303	688363	华熙生物	1,218	81,520.74	0.08
304	600132	重庆啤酒	1,224	81,334.80	0.08
305	688180	君实生物	1,940	81,150.20	0.08
306	000066	中国长城	8,000	80,960.00	0.08
307	300765	新诺威	2,200	80,564.00	0.08
308	002939	长城证券	10,000	80,000.00	0.08
309	002128	电投能源	5,600	79,912.00	0.08
310	600460	士兰微	3,500	79,905.00	0.08
311	603658	安图生物	1,400	79,814.00	0.08
312	300866	安克创新	900	79,740.00	0.08
313	600732	爱旭股份	4,520	79,732.80	0.08
314	300454	深信服	1,100	79,519.00	0.08
315	002180	纳思达	3,500	79,205.00	0.08
316	600418	江淮汽车	4,900	79,135.00	0.08
317	300502	新易盛	1,600	78,912.00	0.08
318	002625	光启技术	5,300	78,334.00	0.08
319	002384	东山精密	4,300	78,174.00	0.08
320	002841	视源股份	1,700	77,792.00	0.08

321	600642	申能股份	12,100	77,682.00	0.08
322	600298	安琪酵母	2,200	77,396.00	0.08
323	688390	固德威	592	77,303.36	0.08
324	300601	康泰生物	2,840	77,106.00	0.08
325	688009	中国通号	17,590	77,044.20	0.08
326	601216	君正集团	20,600	77,044.00	0.08
327	000423	东阿阿胶	1,557	76,791.24	0.08
328	600536	中国软件	2,110	76,508.60	0.08
329	002414	高德红外	10,480	76,504.00	0.08
330	600779	水井坊	1,300	76,401.00	0.08
331	600884	杉杉股份	5,600	76,272.00	0.08
332	603596	伯特利	1,100	76,230.00	0.08
333	000027	深圳能源	11,798	76,097.10	0.08
334	688099	晶晨股份	1,208	75,657.04	0.08
335	601958	金钼股份	8,000	75,600.00	0.08
336	002465	海格通信	5,848	75,146.80	0.08
337	000009	中国宝安	6,400	75,136.00	0.08
338	000629	钒钛股份	22,900	75,112.00	0.08
339	603882	金域医学	1,200	75,084.00	0.08
340	600157	永泰能源	54,700	74,939.00	0.08
341	688728	格科微	3,655	74,817.85	0.08
342	002152	广电运通	6,100	74,786.00	0.08
343	600177	雅戈尔	11,400	74,670.00	0.08
344	000988	华工科技	2,500	74,400.00	0.08
345	300003	乐普医疗	4,600	74,336.00	0.08
346	002032	苏泊尔	1,400	74,214.00	0.08
347	301269	华大九天	700	74,095.00	0.08
348	300919	中伟股份	1,500	73,695.00	0.08
349	300763	锦浪科技	1,050	73,395.00	0.08
350	688561	奇安信	1,830	73,364.70	0.08
351	000728	国元证券	10,740	73,354.20	0.08
352	300146	汤臣倍健	4,300	73,229.00	0.08
353	300394	天孚通信	800	73,216.00	0.08
354	000783	长江证券	13,600	73,168.00	0.08
355	002353	杰瑞股份	2,600	73,086.00	0.08
356	002430	杭氧股份	2,500	73,025.00	0.08
357	600487	亨通光电	6,100	72,834.00	0.08
358	603606	东方电缆	1,700	72,675.00	0.08
359	601990	南京证券	9,100	72,618.00	0.08
360	002756	永兴材料	1,390	72,571.90	0.07
361	600566	济川药业	2,300	72,289.00	0.07
362	603233	大参林	2,898	72,160.20	0.07
363	000723	美锦能源	10,700	71,262.00	0.07

363	600153	建发股份	7,400	71,262.00	0.07
364	601966	玲珑轮胎	3,700	71,151.00	0.07
365	603816	顾家家居	2,030	71,050.00	0.07
366	002739	万达电影	5,400	70,308.00	0.07
367	601615	明阳智能	5,600	70,224.00	0.07
368	600096	云天化	4,500	70,200.00	0.07
369	002673	西部证券	11,000	70,070.00	0.07
370	601696	中银证券	6,800	69,972.00	0.07
371	603000	人民网	2,500	69,950.00	0.07
372	603338	浙江鼎力	1,360	69,591.20	0.07
373	002340	格林美	12,700	69,342.00	0.07
374	002532	天山铝业	11,500	69,115.00	0.07
375	600763	通策医疗	900	68,805.00	0.07
376	600754	锦江酒店	2,300	68,770.00	0.07
377	600873	梅花生物	7,200	68,760.00	0.07
378	002202	金风科技	8,583	68,664.00	0.07
379	688516	奥特维	758	68,599.00	0.07
380	300442	润泽科技	2,700	68,499.00	0.07
381	603568	伟明环保	4,280	68,480.00	0.07
382	601577	长沙银行	10,000	68,200.00	0.07
383	300957	贝泰妮	1,000	68,170.00	0.07
384	603156	养元饮品	3,200	68,032.00	0.07
385	601231	环旭电子	4,500	67,995.00	0.07
386	603737	三棵树	1,428	67,987.08	0.07
387	300207	欣旺达	4,600	67,896.00	0.07
388	600702	舍得酒业	700	67,690.00	0.07
389	600705	中航产融	21,684	67,437.24	0.07
390	002185	华天科技	7,900	67,308.00	0.07
391	601880	辽港股份	46,400	67,280.00	0.07
392	600352	浙江龙盛	8,000	67,200.00	0.07
393	600369	西南证券	16,400	67,076.00	0.07
394	002409	雅克科技	1,200	66,876.00	0.07
395	300724	捷佳伟创	900	66,609.00	0.07
396	688187	时代电气	1,833	66,592.89	0.07
397	600606	绿地控股	28,900	66,470.00	0.07
398	000831	中国稀土	2,400	66,408.00	0.07
399	000800	一汽解放	7,800	66,300.00	0.07
400	600066	宇通客车	5,000	66,250.00	0.07
401	603885	吉祥航空	5,500	66,000.00	0.07
402	688220	翱捷科技	935	65,861.40	0.07
403	000799	酒鬼酒	900	65,835.00	0.07
404	601198	东兴证券	7,994	65,790.62	0.07
405	000738	航发控制	3,300	65,670.00	0.07

406	002738	中矿资源	1,760	65,665.60	0.07
407	600486	扬农化工	1,040	65,644.80	0.07
408	002080	中材科技	4,100	65,272.00	0.07
409	600998	九州通	9,295	65,157.95	0.07
410	603589	口子窖	1,437	65,096.10	0.07
411	002568	百润股份	2,632	64,773.52	0.07
412	600583	海油工程	10,900	64,746.00	0.07
413	601155	新城控股	5,630	64,238.30	0.07
414	300144	宋城演艺	6,480	63,957.60	0.07
415	601456	国联证券	5,900	63,956.00	0.07
416	000050	深天马 A	6,000	63,900.00	0.07
417	600497	驰宏锌锗	12,600	63,630.00	0.07
418	002831	裕同科技	2,300	63,273.00	0.07
419	688538	和辉光电	26,000	63,180.00	0.07
420	601933	永辉超市	22,400	63,168.00	0.07
421	000069	华侨城 A	20,243	62,955.73	0.07
422	601179	中国西电	12,700	62,611.00	0.06
423	002262	恩华药业	2,300	62,376.00	0.06
424	603486	科沃斯	1,500	62,160.00	0.06
425	000937	冀中能源	8,700	62,118.00	0.06
426	000987	越秀资本	10,277	61,867.54	0.06
427	600970	中材国际	6,600	61,644.00	0.06
428	600398	海澜之家	8,300	61,586.00	0.06
429	688065	凯赛生物	1,120	61,577.60	0.06
430	600699	均胜电子	3,400	61,064.00	0.06
431	002444	巨星科技	2,700	60,804.00	0.06
432	002385	大北农	10,181	60,678.76	0.06
433	600060	海信视像	2,900	60,610.00	0.06
434	000703	恒逸石化	9,010	60,547.20	0.06
435	000729	燕京啤酒	7,000	60,410.00	0.06
436	000893	亚钾国际	2,300	60,352.00	0.06
437	600549	厦门钨业	3,500	60,130.00	0.06
438	688120	华海清科	320	60,064.00	0.06
439	002607	中公教育	14,700	59,976.00	0.06
440	603712	七一二	1,900	59,869.00	0.06
441	002797	第一创业	10,300	59,843.00	0.06
442	603707	健友股份	3,983	59,745.00	0.06
443	300251	光线传媒	7,300	59,495.00	0.06
444	600655	豫园股份	9,500	58,995.00	0.06
445	600848	上海临港	5,860	58,893.00	0.06
446	688082	盛美上海	560	58,469.60	0.06
447	600380	健康元	4,700	58,421.00	0.06
448	600021	上海电力	6,900	58,374.00	0.06

449	688536	思瑞浦	398	58,227.40	0.06
450	002966	苏州银行	9,000	58,140.00	0.06
451	002044	美年健康	9,653	58,014.53	0.06
452	600378	昊华科技	1,900	57,912.00	0.06
453	600637	东方明珠	7,700	57,904.00	0.06
454	600895	张江高科	3,000	57,900.00	0.06
455	002372	伟星新材	4,000	57,880.00	0.06
456	600038	中直股份	1,500	57,795.00	0.06
457	600004	白云机场	5,900	57,702.00	0.06
458	688002	睿创微纳	1,304	57,662.88	0.06
459	000960	锡业股份	4,000	57,280.00	0.06
460	600704	物产中大	12,900	57,147.00	0.06
461	601866	中远海发	24,400	57,096.00	0.06
462	300604	长川科技	1,500	56,985.00	0.06
463	300558	贝达药业	1,100	56,705.00	0.06
464	002176	江特电机	4,200	56,700.00	0.06
465	601991	大唐发电	23,300	56,386.00	0.06
466	002624	完美世界	4,744	56,168.96	0.06
467	002244	滨江集团	7,700	55,979.00	0.06
468	600129	太极集团	1,200	55,752.00	0.06
469	300487	蓝晓科技	1,050	55,713.00	0.06
470	002558	巨人网络	5,000	55,700.00	0.06
471	600563	法拉电子	600	55,560.00	0.06
472	603160	汇顶科技	800	55,280.00	0.06
473	002153	石基信息	5,673	55,255.02	0.06
474	688521	芯原股份	1,105	55,205.80	0.06
475	000032	深桑达 A	2,600	55,068.00	0.06
476	300699	光威复材	2,060	54,940.20	0.06
477	600511	国药股份	1,900	54,378.00	0.06
478	600673	东阳光	7,400	54,242.00	0.06
479	000709	河钢股份	25,429	54,163.77	0.06
480	002056	横店东磁	4,000	54,160.00	0.06
481	002120	韵达股份	7,250	54,085.00	0.06
482	002138	顺络电子	2,000	54,020.00	0.06
483	002456	欧菲光	6,200	54,002.00	0.06
484	600072	中船科技	2,900	53,766.00	0.06
485	002517	恺英网络	4,800	53,616.00	0.06
486	000591	太阳能	9,600	53,568.00	0.06
487	600521	华海药业	3,650	53,545.50	0.06
488	000021	深科技	3,300	53,493.00	0.06
489	300212	易华录	1,700	53,465.00	0.06
490	600872	中炬高新	1,900	53,390.00	0.06
491	603456	九洲药业	2,200	53,262.00	0.06

492	002299	圣农发展	3,100	53,258.00	0.06
493	300676	华大基因	1,100	52,800.00	0.05
494	603728	鸣志电器	800	52,680.00	0.05
495	600598	北大荒	4,400	52,668.00	0.05
496	000825	太钢不锈	14,100	52,593.00	0.05
497	000513	丽珠集团	1,500	52,515.00	0.05
498	300390	天华新能	2,070	52,474.50	0.05
499	688005	容百科技	1,318	52,456.40	0.05
500	002240	盛新锂能	2,300	52,325.00	0.05
501	002508	老板电器	2,400	52,272.00	0.05
502	000683	远兴能源	8,900	52,243.00	0.05
503	300347	泰格医药	950	52,221.50	0.05
504	601162	天风证券	16,900	52,221.00	0.05
505	688385	复旦微电	1,347	52,034.61	0.05
506	600559	老白干酒	2,300	51,865.00	0.05
507	002405	四维图新	5,800	51,620.00	0.05
508	600977	中国电影	4,200	51,408.00	0.05
509	600170	上海建工	21,900	51,246.00	0.05
510	603077	和邦生物	21,700	51,212.00	0.05
511	600688	上海石化	17,900	51,194.00	0.05
512	300118	东方日升	2,900	51,185.00	0.05
513	300395	菲利华	1,400	51,184.00	0.05
514	600141	兴发集团	2,800	51,100.00	0.05
515	002531	天顺风能	4,400	51,040.00	0.05
516	600499	科达制造	4,800	50,640.00	0.05
517	002595	豪迈科技	1,700	50,609.00	0.05
518	002926	华西证券	6,500	50,440.00	0.05
519	603185	弘元绿能	1,509	50,219.52	0.05
520	601928	凤凰传媒	5,700	50,217.00	0.05
521	688063	派能科技	471	49,926.00	0.05
522	002850	科达利	591	49,915.86	0.05
523	300073	当升科技	1,300	49,660.00	0.05
524	300595	欧普康视	2,191	49,472.78	0.05
525	000519	中兵红箭	3,500	49,140.00	0.05
525	600166	福田汽车	18,000	49,140.00	0.05
526	300568	星源材质	3,181	49,051.02	0.05
527	600988	赤峰黄金	3,500	49,035.00	0.05
528	603444	吉比特	200	49,024.00	0.05
529	600516	方大炭素	9,312	48,794.88	0.05
530	002065	东华软件	7,906	48,780.02	0.05
531	002281	光迅科技	1,700	48,450.00	0.05
532	600383	金地集团	11,100	48,396.00	0.05
533	002271	东方雨虹	2,500	48,000.00	0.05



534	600100	同方股份	6,500	47,775.00	0.05
535	300373	扬杰科技	1,300	47,710.00	0.05
536	601016	节能风电	15,900	47,700.00	0.05
537	002500	山西证券	8,802	47,442.78	0.05
538	002268	电科网安	2,100	47,166.00	0.05
539	000830	鲁西化工	4,700	47,141.00	0.05
540	600839	四川长虹	8,900	47,081.00	0.05
541	688567	孚能科技	2,860	46,646.60	0.05
542	605358	立昂微	1,700	46,563.00	0.05
543	000998	隆平高科	3,300	46,530.00	0.05
544	603858	步长制药	2,733	46,488.33	0.05
545	300769	德方纳米	760	46,382.80	0.05
546	601636	旗滨集团	6,600	45,144.00	0.05
547	603529	爱玛科技	1,800	45,072.00	0.05
548	600392	盛和资源	4,400	44,792.00	0.05
549	000739	普洛药业	2,900	44,631.00	0.05
550	603893	瑞芯微	700	44,380.00	0.05
551	002266	浙富控股	13,000	44,200.00	0.05
552	600258	首旅酒店	2,800	43,736.00	0.05
553	603517	绝味食品	1,600	42,976.00	0.04
554	600056	中国医药	3,720	41,552.40	0.04
555	000401	冀东水泥	6,500	41,535.00	0.04
556	002407	多氟多	2,680	40,789.60	0.04
557	603613	国联股份	1,834	40,366.34	0.04
558	600481	双良节能	4,600	38,916.00	0.04
559	002541	鸿路钢构	1,730	37,592.90	0.04
560	600885	宏发股份	1,340	37,037.60	0.04

### 8.3.2 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	688548	广钢气体	450	5,737.50	0.01
2	688627	精智达	64	5,614.08	0.01
3	688592	司南导航	108	5,457.24	0.01
4	688549	中巨芯	662	5,355.58	0.01
5	688582	芯动联科	116	4,485.72	0.00
6	688563	航材股份	72	4,355.28	0.00
7	688591	泰凌微	155	4,343.10	0.00
8	688603	天承科技	56	4,151.84	0.00
9	688671	碧兴物联	119	4,081.70	0.00
10	688652	京仪装备	77	4,023.25	0.00
11	688573	信宇人	139	4,003.20	0.00
12	688720	艾森股份	80	3,987.20	0.00
13	688610	埃科光电	71	3,621.00	0.00

14	688653	康希通信	224	3,581.76	0.00
15	688702	盛科通信	72	3,468.96	0.00
16	688651	盛邦安全	75	3,453.75	0.00
17	688648	中邮科技	150	3,214.50	0.00
18	688602	康鹏科技	270	2,986.20	0.00
19	601096	宏盛华源	705	2,862.30	0.00
20	688716	中研股份	78	2,838.42	0.00
21	688693	锆威特	65	2,821.65	0.00
22	688646	逸飞激光	75	2,705.25	0.00
23	688719	爱科赛博	42	2,524.20	0.00
24	688612	威迈斯	57	2,164.29	0.00
25	688657	浩辰软件	25	1,955.75	0.00
26	688450	光格科技	50	1,821.00	0.00
27	601083	锦江航运	156	1,726.92	0.00
28	603273	天元智能	87	1,650.39	0.00
29	603270	金帝股份	54	1,597.32	0.00
30	603004	鼎龙科技	50	1,559.50	0.00
31	603119	浙江荣泰	61	1,456.07	0.00
32	603373	安邦护卫	41	1,424.75	0.00
33	603062	麦加芯彩	24	1,387.44	0.00
34	603275	众辰科技	32	1,270.40	0.00
35	603107	上海汽配	67	1,218.73	0.00
36	603276	恒兴新材	47	1,169.36	0.00
37	603193	润本股份	67	1,116.22	0.00
38	603075	热威股份	46	1,072.26	0.00
39	603231	索宝蛋白	43	925.79	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000858	五粮液	1,454,245.00	0.28
2	601888	中国中免	674,666.00	0.13
3	601816	京沪高铁	650,813.00	0.13
4	600436	片仔癀	575,690.00	0.11
5	603288	海天味业	558,889.00	0.11
6	600036	招商银行	410,988.00	0.08
7	002594	比亚迪	387,117.00	0.07
8	603260	合盛硅业	364,839.00	0.07
9	600900	长江电力	312,441.00	0.06
10	601318	中国平安	301,317.00	0.06
11	688515	裕太微	285,844.00	0.06
12	688041	海光信息	279,433.60	0.05

13	601669	中国电建	262,178.00	0.05
14	600309	万华化学	259,963.00	0.05
15	600886	国投电力	254,570.00	0.05
16	601111	中国国航	247,011.00	0.05
17	002475	立讯精密	246,645.00	0.05
18	002920	德赛西威	240,289.00	0.05
19	600703	三安光电	234,182.00	0.05
20	688271	联影医疗	231,214.00	0.04

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	300750	宁德时代	11,644,272.02	2.24
2	000858	五粮液	9,815,419.00	1.89
3	002594	比亚迪	5,981,939.00	1.15
4	300760	迈瑞医疗	4,106,405.00	0.79
5	000568	泸州老窖	3,673,060.00	0.71
6	300059	东方财富	3,217,926.00	0.62
7	000001	平安银行	3,112,878.00	0.60
8	002714	牧原股份	3,026,176.00	0.58
9	002352	顺丰控股	2,978,754.00	0.57
10	002304	洋河股份	2,737,135.00	0.53
11	002475	立讯精密	2,630,459.00	0.51
12	300015	爱尔眼科	2,396,924.25	0.46
13	600519	贵州茅台	2,331,151.00	0.45
14	002142	宁波银行	2,310,706.14	0.44
15	300124	汇川技术	2,194,434.00	0.42
16	300014	亿纬锂能	2,071,920.00	0.40
17	300274	阳光电源	1,913,731.00	0.37
18	000002	万科 A	1,907,717.00	0.37
19	000725	京东方 A	1,686,500.00	0.32
20	300122	智飞生物	1,625,069.00	0.31

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	39,033,960.80
卖出股票收入（成交）总额	225,500,866.64

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。

## 8.5 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。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，农业银行（601288）在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	758,054.21
2	应收清算款	14,737.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	772,791.69

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 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	688548	广钢气体	5,737.50	0.01	新股锁定期内
2	688627	精智达	5,614.08	0.01	新股锁定期内
3	688592	司南导航	5,457.24	0.01	新股锁定期内
4	688549	中巨芯	5,355.58	0.01	新股锁定期内
5	688582	芯动联科	4,485.72	0.00	新股锁定期内

#### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		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（%）

2,054	45,304.96	9,614,824.00	10.33	67,731,429.00	72.79	15,710,141.00	16.88
-------	-----------	--------------	-------	---------------	-------	---------------	-------

## 9.2 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	广发证券股份有限公司	5,310,187.00	5.71
2	李景	1,821,700.00	1.96
3	华泰证券股份有限公司	1,359,450.00	1.46
4	王丹红	1,172,900.00	1.26
5	中国银河证券股份有限公司	1,135,100.00	1.22
6	徐红	1,026,100.00	1.10
7	胡峰	1,016,400.00	1.09
8	张民明	1,009,600.00	1.08
9	中国国际金融股份有限公司	923,365.00	0.99
10	宋军	825,000.00	0.89

## 9.3 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

## 9.4 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月26日） 基金份额总额	1,547,056,394.00
本报告期期初基金份额总额	453,056,394.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	363,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	93,056,394.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本报告期内，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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 6 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 11 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	私募资产管理业务与投资顾问业务未能有效分离
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控

制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	1	149,194,580.03	57.21	21,097.62	17.23	-
华泰证券	5	52,443,199.78	20.11	46,258.65	37.77	-
安信证券	3	50,243,420.90	19.27	46,792.28	38.21	-
华西证券	1	8,889,188.16	3.41	8,317.74	6.79	-
粤开证券	1	3,570.00	0.00	3.34	0.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-



宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	4	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
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，新增东海证券、东莞证券、山西证券、世纪证券、银泰证券、金元证券、财通证券、中金财富证券、长城证券、中航证券、江海证券、平安证券和华福证券的交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	39,475.16	31.84	-	-	-	-
安信证券	71,401.34	57.58	-	-	-	-
华西证券	13,120.80	10.58	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-

世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月26日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与贵州省贵文文化基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023年12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12月01日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于运用	证监会规定报刊和网站	2023年11月08日

	固有资金投资旗下公募基金的公告		
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年09月20日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止尚智逢源(北京)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年09月19日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年09月07日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年09月07日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年09月07日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023年08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08月11日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023年08月10日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023年08月08日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023年08月05日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年07月12日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与浙商银行股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2023年06月28日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023年06月27日
18	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06月21日

19	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 06 月 03 日
20	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 05 月 09 日
21	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 04 月 29 日
22	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 04 月 19 日
23	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 04 月 11 日
24	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 03 月 30 日
25	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 03 月 22 日
26	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 03 月 21 日
27	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 03 月 18 日
28	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 02 月 23 日
29	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 02 月 15 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与博时财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 02 月 08 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

联接基金	1	20230101-20230207;	374,081,441.00	288,870,000.00	647,241,300.00	15,710,141.00	16.88
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>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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 层及托管人住所

### 13.3 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

2024 年 3 月 30 日