

华泰柏瑞沪深 300 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§ 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、基金净值表现及利润分配情况	6
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	9
§ 4 管理人报告	9
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	14
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	15
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	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
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	18
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	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25

§ 8 投资组合报告	83
8.1 期末基金资产组合情况	83
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	84
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	86
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	95
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	97
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	97
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	97
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	97
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	97
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	97
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	97
8.12 投资组合报告附注	98
§ 9 基金份额持有人信息	100
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	100
9.2 期末上市基金前十名持有人	100
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	100
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	101
§ 10 开放式基金份额变动	101
§ 11 重大事件揭示	101
11.1 基金份额持有人大会决议	101
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	101
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	101
11.4 基金投资策略的改变	102
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	102
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	102
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	102
11.8 其他重大事件	105
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	108
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	108
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	108
§ 13 备查文件目录	108
13.1 备查文件目录	108
13.2 存放地点	108
13.3 查阅方式	109

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF
场内简称	300ETF(扩位证券简称: 沪深 300ETF)
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	37,444,087,690.00 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	2012 年 5 月 28 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。
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	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 股票最低仓位为 95%, 并采用完全复制的被动式投资策略: 一方面, 相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高, 属于股票型基金中高风险、高收益的产品; 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	贾波	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	-2,759,793,487.95	-5,553,712,516.70	4,812,806,598.71
本期利润	-12,085,984,781.81	-9,940,263,108.48	-1,000,246,570.00
加权平均基金份额本期利润	-0.5113	-0.7999	-0.1192
本期加权平均净值利润率	-13.37%	-19.26%	-2.32%
本期基金份额净值增长率	-9.65%	-20.32%	-3.82%
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	30,145,277,033.06	24,418,175,843.72	26,314,519,217.38

期末可供分配基金份额利润	0.8051	1.2400	2.3204
期末基金资产净值	131,086,564,266.62	77,502,503,225.35	56,886,059,237.46
期末基金份额净值	3.5009	3.9358	5.0162
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	53.52%	69.92%	113.24%

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、本基金于 2012 年 5 月 11 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值+基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买沪深 300ETF 后的实际份额净值变动情况。

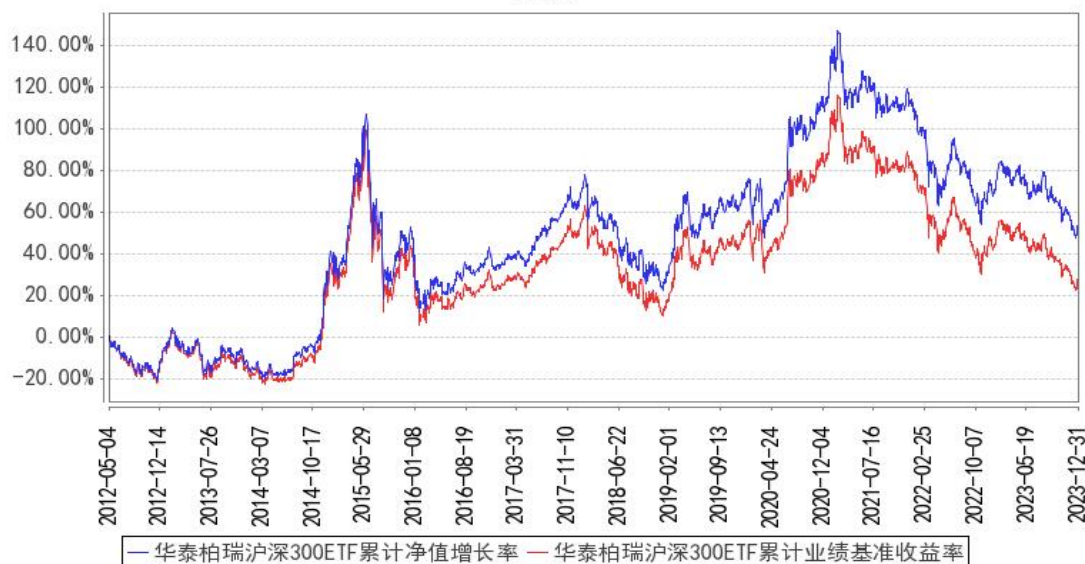
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.92%	0.79%	-7.00%	0.79%	0.08%	0.00%
过去六个月	-9.78%	0.85%	-10.71%	0.85%	0.93%	0.00%
过去一年	-9.65%	0.84%	-11.38%	0.85%	1.73%	-0.01%
过去三年	-30.76%	1.11%	-34.16%	1.11%	3.40%	0.00%
过去五年	23.37%	1.21%	13.97%	1.21%	9.40%	0.00%
自基金合同生效起至今	53.52%	1.37%	27.48%	1.37%	26.04%	0.00%

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

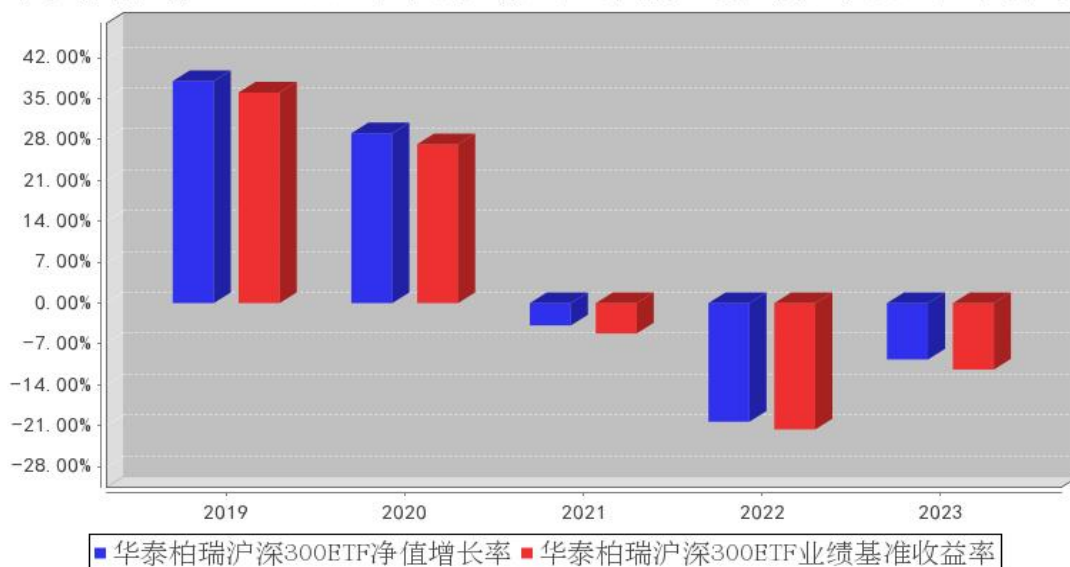
华泰柏瑞沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2012 年 5 月 4 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

华泰柏瑞沪深300ETF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	0.6400	1,193,215,211.55	-	1,193,215,211.55	-
2022 年	0.7500	863,564,082.15	-	863,564,082.15	-
2021 年	0.7200	635,399,113.28	-	635,399,113.28	-
合计	2.1100	2,692,178,406.98	-	2,692,178,406.98	-

§ 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	2012 年 5 月 4 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 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞

					<p>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。</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中的公平交易模块，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。

2023 年全年来看，A 股呈现先扬后抑，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，市场的表现在全年震荡的走势中不及预期。

中央经济工作会议分析指出“进一步推动经济回升向好需要克服一些挑战与困难，主要是有效需求不足、部分行业产能过剩、社会预期偏弱、风险隐患仍然较多”，并定调要“稳中求进、以进促稳、先立后破，多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策”。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.013%，期间日跟踪误差为 0.027%，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 3.5009 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.65%，业绩比较基准收益率为-11.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历本年度连续回调后，资产价格或已经反映投资者过于悲观的预期，国内经济修复进程、改革加码方向及力度、海外美债利率趋势拐点、并同步配合着积极财政政策的前置，或将对 A 股

市场表现及预期带来正向影响。

展望 2024 年，在当前 A 股仍然位于历史偏底部水平、与全球市场相比处于相对偏低水平的估值下，有望迎来估值修复行情，权益市场“均值回归”是大势所趋，在纵向及横向对比均具备较强的中短期配置投资机会。

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，本基金符合分红条件，于 2023 年 1 月 16 日进行分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.64 元，利润分配合计 1,193,215,211.55 元。

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

本报告期内，本基金托管人在对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，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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 22099 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	华泰柏瑞沪深 300 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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞沪深 300 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沪深 300 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>

<p>形成审计意见的基础</p>	<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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞沪深 300 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沪深 300 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沪深 300 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沪深 300 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能对华泰柏瑞沪深 300 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</p>

	<p>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的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞沪深 300 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 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 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
资产：			
货币资金	7.4.7.1	557,763,846.81	155,603,662.35
结算备付金		1,178,798,737.04	1,179,756,245.63
存出保证金		150,070,827.81	113,458,113.95
交易性金融资产	7.4.7.2	129,302,062,860.16	76,183,605,477.34
其中：股票投资		129,302,062,860.16	76,183,605,477.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		292,464,049.18	2,829,488.24
应收股利		74,250.20	329,237.44
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	1,054,977.37	1,122,995.87
资产总计		131,482,289,548.57	77,636,705,220.82
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		2,096,681.51	30,652.12
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	53,830,041.48
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		47,802,161.66	30,555,976.07
应付托管费		9,560,432.32	6,111,195.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	11.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	336,266,006.46	43,674,118.72
负债合计		395,725,281.95	134,201,995.47
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	100,941,287,233.56	53,084,327,381.63
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	30,145,277,033.06	24,418,175,843.72
净资产合计		131,086,564,266.62	77,502,503,225.35
负债和净资产总计		131,482,289,548.57	77,636,705,220.82

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.5009 元，基金份额总额 37,444,087,690.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 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
----	-----	---------------------------------	--------------------------------------

一、营业总收入		-11,516,585,282.45	-9,614,693,720.31
1. 利息收入		68,212,911.68	61,140,765.01
其中：存款利息收入	7.4.7.13	15,639,796.17	15,991,574.47
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		52,573,115.51	45,149,190.54
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,293,775,209.01	-5,316,802,755.26
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-4,014,234,612.09	-6,115,280,837.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	6,661,422.85	12,025,722.73
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-158,133,685.88	-229,759,415.22
股利收益	7.4.7.19	1,871,931,666.11	1,016,211,774.64
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	-9,326,191,293.86	-4,386,550,591.78
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	35,168,308.74	27,518,861.72
减：二、营业总支出		569,399,499.36	325,569,388.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	451,435,295.24	258,135,795.38
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	90,287,058.98	51,627,159.00
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		17,923.40	39.32
8. 其他费用	7.4.7.23	27,659,221.74	15,806,394.47
三、利润总额（亏损		-12,085,984,781.81	-9,940,263,108.48

总额以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,085,984,781.81	-9,940,263,108.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,085,984,781.81	-9,940,263,108.48

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 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	53,084,327,381.63	-	24,418,175,843.72	77,502,503,225.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	53,084,327,381.63	-	24,418,175,843.72	77,502,503,225.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	47,856,959,851.93	-	5,727,101,189.34	53,584,061,041.27
（一）、综合收益总额	-	-	-12,085,984,781.81	-12,085,984,781.81
（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）	47,856,959,851.93	-	19,006,301,182.70	66,863,261,034.63
其中：1. 基金申购款	95,075,826,926.93	-	40,283,455,101.23	135,359,282,028.16
2. 基金赎回款	-47,218,867,07	-	-21,277,153,91	-68,496,020,993

	5.00		8.53	.53
(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)	-	-	-1,193,215,211.55	-1,193,215,211.55
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	100,941,287,233.56	-	30,145,277,033.06	131,086,564,266.62
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	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	22,512,787,361.55	-	-1,896,343,373.66	20,616,443,987.89
(一)、综合收益总额	-	-	-9,940,263,108.48	-9,940,263,108.48
(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)	22,512,787,361.55	-	8,907,483,816.97	31,420,271,178.52
其中：1. 基金申购款	69,083,856,794.64	-	36,075,203,038.81	105,159,059,833.45
2. 基金赎回款	-46,571,069,43	-	-27,167,719,22	-73,738,788,654

	3.09		1.84	.93
(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)	-	-	-863,564,082.15	-863,564,082.15
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	53,084,327,381.63	-	24,418,175,843.72	77,502,503,225.35

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：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 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[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》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《华泰柏瑞沪深 300 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 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,297,269.00 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300

交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933，并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证基字[2012]14 号文审核同意，本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 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《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数沪深 300 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新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证、债券、权证、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。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 95%。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沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）。华泰柏瑞沪深 300ETF 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》、《华泰柏瑞沪深 300 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商业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商业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、资产支持证券投资 and 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。本基金的基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金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%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，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和债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日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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	557,763,846.81	155,603,662.35
等于：本金	557,702,844.31	155,582,321.34
加：应计利息	61,002.50	21,341.01
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	557,763,846.81	155,603,662.35

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	143,220,517,991.29	-	129,302,062,860.16	-13,918,455,131.13
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		143,220,517,991.29	-	129,302,062,860.16	-13,918,455,131.13
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		80,745,303,515.26	-	76,183,605,477.34	-4,561,698,037.92
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		80,745,303,515.26	-	76,183,605,477.34	-4,561,698,037.92

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	1,172,765,460.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,172,765,460.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,172,765,460.00	-	-	-
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	918,287,940.00	-	-	-
其中：股指期货投资	918,287,940.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	918,287,940.00	-	-	-

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
IF2401	沪深 300 股指期货 2401	1,150.00	1,186,731,000.00	13,965,540.00
合计				13,965,540.00
减：可抵销期货暂收款				13,965,540.00
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

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
应收利息	-	-
其他应收款	1,054,977.37	1,122,995.87
待摊费用	-	-
合计	1,054,977.37	1,122,995.87

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	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	9,096,721.25	3,121,318.42
其中：交易所市场	9,096,721.25	3,121,318.42
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	416,575.28	270,000.00
应付指数使用费	8,884,926.97	4,659,394.85
应退退补款	317,367,782.96	35,123,405.45
合计	336,266,006.46	43,674,118.72

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	19,691,587,690.00	53,084,327,381.63
本期申购	35,268,300,000.00	95,075,826,926.93
本期赎回（以“-”号填列）	-17,515,800,000.00	-47,218,867,075.00
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	37,444,087,690.00	100,941,287,233.56

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：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 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	64,973,333,076.08	-40,555,157,232.36	24,418,175,843.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	64,973,333,076.08	-40,555,157,232.36	24,418,175,843.72
本期利润	-2,759,793,487.95	-9,326,191,293.86	-12,085,984,781.81
本期基金份额交易产生的变动数	57,387,145,563.12	-38,380,844,380.42	19,006,301,182.70
其中：基金申购款	114,051,375,861.62	-73,767,920,760.39	40,283,455,101.23
基金赎回款	-56,664,230,298.50	35,387,076,379.97	-21,277,153,918.53
本期已分配利润	-1,193,215,211.55	-	-1,193,215,211.55
本期末	118,407,469,939.70	-88,262,192,906.64	30,145,277,033.06

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	1,321,822.26	882,907.64
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	14,200,460.86	14,991,250.54
其他	117,513.05	117,416.29
合计	15,639,796.17	15,991,574.47

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 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,153,134,378.88	-3,620,066,765.68
股票投资收益——赎回差价收入	-861,100,233.21	-2,495,214,071.73
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	-4,014,234,612.09	-6,115,280,837.41

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 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
卖出股票成交总额	37,430,048,216.20	36,817,120,319.82
减：卖出股票成本总额	40,524,296,393.72	40,381,079,177.39
减：交易费用	58,886,201.36	56,107,908.11
买卖股票差价收入	-3,153,134,378.88	-3,620,066,765.68

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	68,496,020,993.53	73,738,788,654.93
减：现金支付赎回款总额	28,767,495,349.53	31,722,424,822.93

减：赎回股票成本总额	40,589,625,877.21	44,511,577,903.73
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-861,100,233.21	-2,495,214,071.73

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	6,410.20	12,356.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,655,012.65	12,013,366.36
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	6,661,422.85	12,025,722.73

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	43,282,046.82	65,583,286.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	36,618,700.00	53,556,400.00

减：应计利息总额	6,602.40	12,684.08
减：交易费用	1,731.77	836.18
买卖债券差价收入	6,655,012.65	12,013,366.36

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：本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

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	-158,133,685.88	-229,759,415.22

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	1,871,931,666.11	1,016,211,774.64
其中：证券出借权益补偿收入	26,323,002.00	36,029,729.17
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,871,931,666.11	1,016,211,774.64

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	-9,356,757,093.21	-4,395,004,608.58
股票投资	-9,356,757,093.21	-4,395,004,608.58
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	30,383,280.00	8,425,680.00
权证投资	-	-
期货投资	30,383,280.00	8,425,680.00
3. 其他	182,519.35	28,336.80
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-9,326,191,293.86	-4,386,550,591.78

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

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	-	-
替代损益	35,026,858.17	27,518,861.72
其他	141,450.57	-
合计	35,168,308.74	27,518,861.72

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	170,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	27,086,117.73	15,488,147.68
注册登记费	276,575.28	42,328.88
银行划款手续费	6,528.73	5,917.91

合计	27,659,221.74	15,806,394.47
----	---------------	---------------

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

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

本基金的基金管理人于 2024 年 1 月 11 日宣告 2023 年度第一次分红，向截至 2024 年 1 月 17 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.6900 元。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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（“华泰柏瑞沪深 300ETF 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	22,319,506,206.01	22.07	12,431,878,258.66	14.25

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	8,176,593.04	38.48	7,449,305.49	81.89
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	1,699,651.56	14.15	-	-

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	451,435,295.24	258,135,795.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	451,435,295.24	258,135,795.38

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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	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	90,287,058.98	51,627,159.00

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	6,740,715,504.00	5,745,076.90	-	-

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	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	14,458,871,596.00	10,685,021.23	851,135,092.00	326,166.32

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	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	11,835,404,780.00	1.00~5.33	3.09	14,149,838.40	605,327,214.00	475,236.89
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	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	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	2,992,389,119.00	3.10~3.60	3.39	4,116,135.99	235,461,538.00	134,357.68

注：上年度可比期间数据，已根据中国证监会于 2024 年 1 月颁布的修订后的《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>》的格式要求调整披露信息。

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（%）
华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	733,226,365.00	1.9582	1,145,234,077.00	5.8159
华泰证券股份有限公司	279,125,506.00	0.7454	515,934,470.00	2.6201

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
中国工商银行	557,763,846.81	1,321,822.26	155,603,662.35	882,907.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本期 2023年1月1日至2023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	118031	天23转债	网上配售	147,310	14,731,000.00
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	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	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20

华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688602	康鹏科技	网下申购	10,653	92,254.98
华泰联合证券	301487	盟固利	网下申购	8,662	46,081.84
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	301421	波长光电	网下申购	3,315	97,394.70
华泰联合证券	688693	锆威特	网下申购	1,773	72,391.59
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合证券	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
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	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	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
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	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
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	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	4,358	428,609.30
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	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	301327	华宝新能	网下申购	2,417	574,037.50
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	301290	东星医疗	网下申购	3,291	145,100.19
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68

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 38,047,705 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 567,491,812.16 元，估值总额为人民币 530,765,484.75 元，占基金净资产的比例为 0.40% (2022 年 12 月 31 日：本基金持有 21,127,905 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 288,480,415.79 元，估值总额为人民币 269,169,509.70 元，占基金净资产的比例为 0.35%)。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 261,897,957 股中国工商银行的普通股，成本总额为人民币 1,220,373,461.42 元，估值总额为人民币 1,251,872,234.46 元，占基金净资产的比例为 0.96% (2022 年 12 月 31 日：本基金持有 143,359,957 股中国工商银行的普通股，成本总额为人民币 639,741,301.90 元，估值总额为人民币 622,182,213.38 元，占基金净资产的比例为 0.80%)。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 01 月 13 日	2023 年 1 月 16 日	-	0.6400	1,193,215,211.55	-	1,193,215,211.55	-
合计	-	-	-	0.6400	1,193,215,211.55	-	1,193,215,211.55	-

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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-

301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定期内	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定期内	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定期内	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定期内	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定期内	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定期内	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股锁定期内	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定期内	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股锁定期内	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定期内	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-

301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定期内	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定期内	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定期内	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定期内	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股锁定期内	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期内	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股锁定期内	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期内	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股锁定期内	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-

301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股锁定期内	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股锁定期内	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股锁定期内	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股锁定期内	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定期内	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股锁定期内	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股锁定期内	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股锁定期内	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定期内	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定期内	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股锁定期内	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-

301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定期内	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定期内	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定期内	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定期内	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定期内	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定期内	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定期内	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定期内	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股锁定期内	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定期内	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定期内	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-

301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定期内	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定期内	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定期内	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定期内	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定期内	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定期内	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定期内	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定期内	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-

603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股锁定期内	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定期内	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定期内	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定期内	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股锁定期内	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定期内	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定期内	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股锁定期内	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股锁定期内	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-

688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股锁定期内	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	新股锁定期内	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股锁定期内	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期内	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股锁定期内	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股锁定期内	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定期内	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股锁定期内	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定期内	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定期内	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-

688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定期内	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定期内	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股锁定期内	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定期内	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股锁定期内	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定期内	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股锁定期内	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股锁定期内	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

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

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	000001	平安银行	2024年1月1日-2024年1月5日	9.39	921,100.00	8,649,129.00
2	000002	万科A	2024年1月1日	10.46	44,800.00	468,608.00
3	000063	中兴通讯	2024年1月1日-2024年1月12日	26.48	530,800.00	14,055,584.00
4	000069	华侨城A	2024年1月1日-2024年1月9日	3.11	318,000.00	988,980.00
5	000100	TCL科技	2024年1月1日	4.3	136,900.00	588,670.00
6	000157	中联重科	2024年1月1日	6.53	85,100.00	555,703.00
7	000166	申万宏源	2024年1月1日	4.44	125,100.00	555,444.00
8	000301	东方盛虹	2024年1月1日	9.6	50,600.00	485,760.00
9	000333	美的集团	2024年1月1日	54.63	10,100.00	551,763.00
10	000338	潍柴动	2024年1月1日	13.65	42,900.00	585,585.00

		力				0
11	000408	藏格矿业	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	25.34	435,400.00	11,033,036.00
12	000425	徐工机械	2024 年 1 月 1 日	5.46	76,200.00	416,052.00
13	000538	云南白药	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 2 日	49.15	312,300.00	15,349,545.00
14	000568	泸州老窖	2024 年 1 月 1 日	179.42	3,700.00	663,854.00
15	000596	古井贡酒	2024 年 1 月 1 日	232.8	3,300.00	768,240.00
16	000617	中油资本	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 2 日	5.4	224,400.00	1,211,760.00
17	000625	长安汽车	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 22 日	16.83	2,795,700.00	47,051,631.00
18	000651	格力电器	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 5 日	32.17	20,300.00	653,051.00
19	000661	长春高新	2024 年 1 月 1 日	145.8	4,500.00	656,100.00
20	000708	中信特钢	2024 年 1 月 1 日	14.04	36,600.00	513,864.00
21	000725	京东方 A	2024 年 1 月 1 日	3.9	140,700.00	548,730.00
22	000733	振华科技	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 9 日	58.84	193,300.00	11,373,772.00
23	000768	中航西飞	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 8 日	22.37	60,800.00	1,360,096.00
24	000776	广发证券	2024 年 1 月 1 日	14.29	37,700.00	538,733.00
25	000786	北新建材	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	23.36	203,100.00	4,744,416.00
26	000792	盐湖股份	2024 年 1 月 1 日	15.95	122,100.00	1,947,495.00
27	000800	一汽解放	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	8.5	568,300.00	4,830,550.00
28	000858	五粮液	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	140.31	7,000.00	982,170.00
29	000876	新希望	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 8 日	9.32	201,700.00	1,879,844.00
30	000877	天山股份	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	6.68	898,400.00	6,001,312.00
31	000895	双汇发展	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	26.71	93,900.00	2,508,069.00
32	000938	紫光股	2024 年 1 月 1 日-2024 年	19.35	193,000.00	3,734,550

		份	1月12日			.00
33	000963	华东医药	2024年1月1日-2024年1月5日	41.46	17,500.00	725,550.00
34	000977	浪潮信息	2024年1月1日-2024年1月12日	33.2	1,288,700.00	42,784,840.00
35	000983	山西焦煤	2024年1月1日-2024年1月10日	9.88	346,000.00	3,418,480.00
36	001289	龙源电力	2024年1月1日-2024年1月12日	19.81	154,800.00	3,066,588.00
37	001979	招商蛇口	2024年1月1日-2024年1月12日	9.53	4,243,900.00	40,444,367.00
38	002001	新和成	2024年1月1日	16.96	35,600.00	603,776.00
39	002007	华兰生物	2024年1月1日	22.13	25,100.00	555,463.00
40	002027	分众传媒	2024年1月1日-2024年1月4日	6.32	172,700.00	1,091,464.00
41	002049	紫光国微	2024年1月1日-2024年1月12日	67.45	128,400.00	8,660,580.00
42	002050	三花智控	2024年1月1日	29.4	20,600.00	605,640.00
43	002074	国轩高科	2024年1月1日	21.5	23,300.00	500,950.00
44	002129	TCL中环	2024年1月1日-2024年1月5日	15.64	79,000.00	1,235,560.00
45	002142	宁波银行	2024年1月1日	20.11	22,000.00	442,420.00
46	002179	中航光电	2024年1月1日	39	13,600.00	530,400.00
47	002180	纳思达	2024年1月1日	22.63	20,600.00	466,178.00
48	002202	金风科技	2024年1月1日-2024年1月11日	8	103,200.00	825,600.00
49	002230	科大讯飞	2024年1月1日-2024年1月11日	46.38	1,165,600.00	54,060,528.00
50	002236	大华股份	2024年1月1日-2024年1月12日	18.45	146,800.00	2,708,460.00
51	002241	歌尔股份	2024年1月1日-2024年1月12日	21.01	1,264,000.00	26,556,640.00
52	002252	上海莱士	2024年1月1日	8	82,100.00	656,800.00
53	002271	东方雨虹	2024年1月1日-2024年1月11日	19.2	107,800.00	2,069,760.00
54	002304	洋河股	2024年1月1日-2024年	109.9	12,500.00	1,373,750

		份	1月8日			.00
55	002311	海大集团	2024年1月1日	44.91	121,400.00	5,452,074.00
56	002352	顺丰控股	2024年1月1日-2024年1月3日	40.4	20,800.00	840,320.00
57	002371	北方华创	2024年1月1日	245.71	3,400.00	835,414.00
58	002410	广联达	2024年1月1日	17.14	25,100.00	430,214.00
59	002415	海康威视	2024年1月1日	34.72	15,900.00	552,048.00
60	002459	晶澳科技	2024年1月1日-2024年1月9日	20.72	48,800.00	1,011,136.00
61	002460	赣锋锂业	2024年1月1日-2024年1月12日	42.8	581,000.00	24,866,800.00
62	002466	天齐锂业	2024年1月1日-2024年1月12日	55.79	113,700.00	6,343,323.00
63	002475	立讯精密	2024年1月1日	34.45	17,300.00	595,985.00
64	002493	荣盛石化	2024年1月1日-2024年1月12日	10.35	140,300.00	1,452,105.00
65	002555	三七互娱	2024年1月1日-2024年1月9日	18.81	34,800.00	654,588.00
66	002594	比亚迪	2024年1月1日	198	3,500.00	693,000.00
67	002601	龙佰集团	2024年1月1日-2024年1月8日	17.13	48,800.00	835,944.00
68	002648	卫星化学	2024年1月1日-2024年1月10日	14.75	52,000.00	767,000.00
69	002709	天赐材料	2024年1月1日	25.08	18,400.00	461,472.00
70	002714	牧原股份	2024年1月1日	41.18	14,200.00	584,756.00
71	002736	国信证券	2024年1月1日-2024年1月11日	8.54	85,100.00	726,754.00
72	002812	恩捷股份	2024年1月1日-2024年1月12日	56.82	413,800.00	23,512,116.00
73	002821	凯莱英	2024年1月1日-2024年1月3日	116.1	9,200.00	1,068,120.00
74	002841	视源股份	2024年1月1日	45.76	10,400.00	475,904.00
75	002916	深南电路	2024年1月1日	70.99	7,700.00	546,623.00
76	002920	德赛西	2024年1月1日-2024年	129.51	406,100.00	52,594,01

		威	1月12日			1.00
77	002938	鹏鼎控 股	2024年1月1日-2024年 1月12日	22.32	26,800.00	598,176.0 0
78	003816	中国广 核	2024年1月1日-2024年 1月10日	3.11	770,400.00	2,395,944 .00
79	300014	亿纬锂 能	2024年1月1日-2024年 1月11日	42.2	28,800.00	1,215,360 .00
80	300015	爱尔眼 科	2024年1月1日	15.82	30,300.00	479,346.0 0
81	300033	同花顺	2024年1月1日-2024年 1月17日	156.87	17,500.00	2,745,225 .00
82	300059	东方财 富	2024年1月1日	14.04	37,400.00	525,096.0 0
83	300122	智飞生 物	2024年1月1日-2024年 1月9日	61.11	11,600.00	708,876.0 0
84	300124	汇川技 术	2024年1月1日	63.14	8,800.00	555,632.0 0
85	300142	沃森生 物	2024年1月1日	23.51	23,400.00	550,134.0 0
86	300223	北京君 正	2024年1月1日	64.65	7,000.00	452,550.0 0
87	300274	阳光电 源	2024年1月1日	87.59	6,200.00	543,058.0 0
88	300308	中际旭 创	2024年1月1日-2024年 1月9日	112.91	55,700.00	6,289,087 .00
89	300316	晶盛机 电	2024年1月1日-2024年 1月5日	44.09	12,800.00	564,352.0 0
90	300347	泰格医 药	2024年1月1日-2024年 1月2日	54.97	9,500.00	522,215.0 0
91	300408	三环集 团	2024年1月1日	29.45	17,900.00	527,155.0 0
92	300413	芒果超 媒	2024年1月1日	25.2	55,100.00	1,388,520 .00
93	300433	蓝思科 技	2024年1月1日	13.2	45,100.00	595,320.0 0
94	300450	先导智 能	2024年1月1日	25.6	19,500.00	499,200.0 0
95	300454	深信服	2024年1月1日	72.29	6,300.00	455,427.0 0
96	300496	中科创 达	2024年1月1日	80.06	267,600.00	21,424,05 6.00
97	300498	温氏股 份	2024年1月1日	20.06	30,500.00	611,830.0 0
98	300628	亿联网	2024年1月1日-2024年	29.55	21,000.00	620,550.0

		络	1月8日			0
99	300661	圣邦股份	2024年1月1日-2024年1月11日	89.01	26,200.00	2,332,062.00
100	300750	宁德时代	2024年1月1日	163.26	3,900.00	636,714.00
101	300751	迈为股份	2024年1月1日-2024年1月12日	129.51	34,300.00	4,442,193.00
102	300759	康龙化成	2024年1月1日-2024年1月11日	28.98	47,600.00	1,379,448.00
103	300760	迈瑞医疗	2024年1月1日	290.6	3,300.00	958,980.00
104	300763	锦浪科技	2024年1月1日-2024年1月22日	69.9	236,900.00	16,559,310.00
105	300782	卓胜微	2024年1月1日	141	4,600.00	648,600.00
106	300896	爱美客	2024年1月1日-2024年1月12日	294.33	78,000.00	22,957,740.00
107	300919	中伟股份	2024年1月1日-2024年1月9日	49.13	36,300.00	1,783,419.00
108	300957	贝泰妮	2024年1月1日-2024年1月11日	68.17	205,000.00	13,974,850.00
109	300979	华利集团	2024年1月1日-2024年1月10日	52.64	117,200.00	6,169,408.00
110	300999	金龙鱼	2024年1月1日-2024年1月4日	33.38	17,700.00	590,826.00
111	301269	华大九天	2024年1月9日	105.85	8,200.00	867,970.00
112	600000	浦发银行	2024年1月1日	6.62	81,600.00	540,192.00
113	600009	上海机场	2024年1月1日-2024年1月9日	32.78	27,200.00	891,616.00
114	600010	宝钢股份	2024年1月1日-2024年1月11日	1.46	4,686,100.00	6,841,706.00
115	600011	华能国际	2024年1月1日-2024年1月10日	7.7	144,900.00	1,115,730.00
116	600015	华夏银行	2024年1月1日	5.62	102,900.00	578,298.00
117	600016	民生银行	2024年1月1日	3.74	154,000.00	575,960.00
118	600018	上港集团	2024年1月1日	4.9	112,700.00	552,230.00
119	600019	宝钢股份	2024年1月1日-2024年1月12日	5.93	144,700.00	858,071.00
120	600025	华能水	2024年1月1日-2024年	8.63	414,400.00	3,576,272

		电	1月9日			.00
121	600028	中国石化	2024年1月1日	5.58	101,600.00	566,928.00
122	600029	南方航空	2024年1月1日	5.76	109,000.00	627,840.00
123	600030	中信证券	2024年1月1日	20.37	8,200.00	167,034.00
124	600031	三一重工	2024年1月1日	13.77	36,200.00	498,474.00
125	600036	招商银行	2024年1月1日	27.82	17,700.00	492,414.00
126	600039	四川路桥	2024年1月1日	7.49	66,100.00	495,089.00
127	600048	保利发展	2024年1月1日-2024年1月4日	9.9	4,442,600.00	43,981,740.00
128	600050	中国联通	2024年1月1日-2024年1月5日	4.38	259,800.00	1,137,924.00
129	600061	国投资本	2024年1月1日-2024年1月3日	6.74	103,700.00	698,938.00
130	600085	同仁堂	2024年1月1日-2024年1月5日	53.7	15,100.00	810,870.00
131	600089	特变电工	2024年1月1日-2024年1月11日	13.8	144,000.00	1,987,200.00
132	600104	上汽集团	2024年1月1日-2024年1月10日	13.53	41,200.00	557,436.00
133	600111	北方稀土	2024年1月1日-2024年1月11日	19.34	1,875,400.00	36,270,236.00
134	600115	中国东航	2024年1月1日-2024年1月10日	3.88	337,400.00	1,309,112.00
135	600132	重庆啤酒	2024年1月1日	66.45	33,400.00	2,219,430.00
136	600150	中国船舶	2024年1月1日-2024年1月8日	29.44	146,100.00	4,301,184.00
137	600176	中国巨石	2024年1月1日	9.83	45,500.00	447,265.00
138	600183	生益科技	2024年1月1日-2024年1月12日	18.31	350,900.00	6,424,979.00
139	600188	兖矿能源	2024年1月1日-2024年1月11日	19.81	696,300.00	13,793,703.00
140	600196	复星医药	2024年1月1日-2024年1月5日	25.03	57,600.00	1,441,728.00
141	600219	南山铝业	2024年1月1日	2.94	184,500.00	542,430.00
142	600233	圆通速	2024年1月1日	12.29	40,000.00	491,600.00

		递				0
143	600276	恒瑞医药	2024 年 1 月 1 日	45.23	12,600.00	569,898.00
144	600309	万华化学	2024 年 1 月 1 日	76.82	6,200.00	476,284.00
145	600332	白云山	2024 年 1 月 1 日	28.6	18,300.00	523,380.00
146	600346	恒力石化	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 9 日	13.17	133,600.00	1,759,512.00
147	600362	江西铜业	2024 年 1 月 1 日	17.86	30,200.00	539,372.00
148	600372	中航机载	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 10 日	13.18	9,600.00	126,528.00
149	600406	国电南瑞	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 8 日	22.32	30,200.00	674,064.00
150	600426	华鲁恒升	2024 年 1 月 1 日	27.59	17,600.00	485,584.00
151	600436	片仔癀	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 5 日	241.99	4,400.00	1,064,756.00
152	600438	通威股份	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	25.03	391,100.00	9,789,233.00
153	600460	士兰微	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 9 日	22.83	630,400.00	14,392,032.00
154	600519	贵州茅台	2024 年 1 月 1 日	1,726.00	2,200.00	3,797,200.00
155	600547	山东黄金	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	22.87	74,900.00	1,712,963.00
156	600570	恒生电子	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	28.76	19,500.00	560,820.00
157	600584	长电科技	2024 年 1 月 1 日	29.86	18,300.00	546,438.00
158	600585	海螺水泥	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	22.56	44,100.00	994,896.00
159	600588	用友网络	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	17.79	38,100.00	677,799.00
160	600600	青岛啤酒	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	74.75	13,300.00	994,175.00
161	600606	绿地控股	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	2.3	757,600.00	1,742,480.00
162	600660	福耀玻璃	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 10 日	37.39	144,900.00	5,417,811.00
163	600674	川投能源	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	15.12	380,700.00	5,756,184.00
164	600690	海尔智	2024 年 1 月 1 日	21	27,800.00	583,800.00

		家				0
165	600732	爱旭股份	2024年1月1日-2024年1月12日	17.64	703,700.00	12,413,268.00
166	600741	华域汽车	2024年1月1日	16.28	31,500.00	512,820.00
167	600745	闻泰科技	2024年1月1日-2024年1月8日	42.31	255,200.00	10,797,512.00
168	600754	锦江酒店	2024年1月1日	29.9	15,200.00	454,480.00
169	600760	中航沈飞	2024年1月1日-2024年1月4日	42.18	15,200.00	641,136.00
170	600795	国电电力	2024年1月1日	4.16	157,900.00	656,864.00
171	600803	新奥股份	2024年1月1日-2024年1月4日	16.82	68,600.00	1,153,852.00
172	600809	山西汾酒	2024年1月1日-2024年1月5日	230.73	243,800.00	56,251,974.00
173	600837	海通证券	2024年1月1日	9.37	57,800.00	541,586.00
174	600845	宝信软件	2024年1月1日	48.8	12,700.00	619,760.00
175	600875	东方电气	2024年1月1日-2024年1月4日	14.62	99,100.00	1,448,842.00
176	600886	国投电力	2024年1月1日-2024年1月5日	13.18	60,300.00	794,754.00
177	600887	伊利股份	2024年1月1日	26.75	21,000.00	561,750.00
178	600893	航发动力	2024年1月1日-2024年1月5日	37.38	32,500.00	1,214,850.00
179	600900	长江电力	2024年1月1日	23.34	26,200.00	611,508.00
180	600905	三峡能源	2024年1月1日-2024年1月11日	4.37	1,152,100.00	5,034,677.00
181	600918	中泰证券	2024年1月1日	6.86	78,500.00	538,510.00
182	600926	杭州银行	2024年1月1日	10.01	51,300.00	513,513.00
183	600938	中国海油	2024年1月9日	20.97	60,700.00	1,272,879.00
184	600941	中国移动	2024年1月1日-2024年1月10日	99.48	13,000.00	1,293,240.00
185	600958	东方证券	2024年1月1日	8.7	61,400.00	534,180.00
186	600989	宝丰能	2024年1月1日	14.77	40,800.00	602,616.00

		源				0
187	600999	招商证 券	2024 年 1 月 1 日	13.64	40,200.00	548,328.0 0
188	601006	大秦铁 路	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 15 日	7.21	7,251,800. 00	52,285,47 8.00
189	601009	南京银 行	2024 年 1 月 1 日	7.38	71,500.00	527,670.0 0
190	601012	隆基绿 能	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	22.9	3,021,500. 00	69,192,35 0.00
191	601021	春秋航 空	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 5 日	50.2	17,000.00	853,400.0 0
192	601059	信达证 券	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	17.99	447,000.00	8,041,530 .00
193	601066	中信建 投	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 3 日	23.66	13,200.00	312,312.0 0
194	601088	中国神 华	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 3 日	31.35	49,200.00	1,542,420 .00
195	601100	恒立液 压	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 10 日	54.68	28,600.00	1,563,848 .00
196	601111	中国国 航	2024 年 1 月 1 日	7.34	322,600.00	2,367,884 .00
197	601117	中国化 学	2024 年 1 月 1 日	6.36	75,700.00	481,452.0 0
198	601138	工业富 联	2024 年 1 月 1 日	15.12	46,700.00	706,104.0 0
199	601155	新城控 股	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	11.41	393,800.00	4,493,258 .00
200	601166	兴业银 行	2024 年 1 月 1 日	16.21	36,000.00	583,560.0 0
201	601169	北京银 行	2024 年 1 月 1 日	4.53	127,100.00	575,763.0 0
202	601186	中国铁 建	2024 年 1 月 1 日	7.61	64,600.00	491,606.0 0
203	601211	国泰君 安	2024 年 1 月 1 日	14.88	38,700.00	575,856.0 0
204	601225	陕西煤 业	2024 年 1 月 1 日	20.89	34,200.00	714,438.0 0
205	601229	上海银 行	2024 年 1 月 1 日	5.97	95,100.00	567,747.0 0
206	601236	红塔证 券	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	7.59	887,100.00	6,733,089 .00
207	601238	广汽集 团	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 8 日	8.75	163,900.00	1,434,125 .00
208	601288	农业银	2024 年 1 月 1 日	3.64	162,500.00	591,500.0

		行				0
209	601318	中国平安	2024 年 1 月 1 日	40.3	11,900.00	479,570.00
210	601319	中国人保	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 2 日	4.84	183,000.00	885,720.00
211	601328	交通银行	2024 年 1 月 1 日	5.74	102,300.00	587,202.00
212	601336	新华保险	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 10 日	31.13	20,300.00	631,939.00
213	601360	三六零	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 23 日	9.01	4,381,000.00	39,472,810.00
214	601377	兴业证券	2024 年 1 月 1 日	5.87	88,600.00	520,082.00
215	601390	中国中铁	2024 年 1 月 1 日	5.68	84,600.00	480,528.00
216	601398	工商银行	2024 年 1 月 1 日	4.78	122,900.00	587,462.00
217	601600	中国铝业	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	5.64	118,500.00	668,340.00
218	601601	中国太保	2024 年 1 月 1 日	23.78	19,900.00	473,222.00
219	601607	上海医药	2024 年 1 月 1 日	16.73	30,800.00	515,284.00
220	601615	明阳智能	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	12.54	204,500.00	2,564,430.00
221	601618	中国中冶	2024 年 1 月 1 日	3.06	159,500.00	488,070.00
222	601628	中国人寿	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	28.35	20,300.00	575,505.00
223	601633	长城汽车	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	25.22	550,400.00	13,881,088.00
224	601658	邮储银行	2024 年 1 月 1 日	4.35	120,100.00	522,435.00
225	601668	中国建筑	2024 年 1 月 1 日	4.81	104,000.00	500,240.00
226	601669	中国电建	2024 年 1 月 1 日	4.89	104,600.00	511,494.00
227	601688	华泰证券	2024 年 1 月 1 日	13.95	24,300.00	338,985.00
228	601689	拓普集团	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 3 日	73.5	18,100.00	1,330,350.00
229	601698	中国卫通	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	17.31	793,600.00	13,737,216.00
230	601699	潞安环	2024 年 1 月 1 日-2024 年	21.91	55,900.00	1,224,769

		能	1月3日			.00
231	601728	中国电信	2024年1月1日-2024年1月8日	5.41	118,500.00	641,085.00
232	601766	中国中车	2024年1月1日	5.26	97,800.00	514,428.00
233	601788	光大证券	2024年1月1日-2024年1月4日	15.42	136,400.00	2,103,288.00
234	601799	星宇股份	2024年1月1日-2024年1月18日	131.11	104,100.00	13,648,551.00
235	601800	中国交建	2024年1月1日	7.6	61,700.00	468,920.00
236	601808	中海油服	2024年1月1日-2024年1月3日	14.62	120,500.00	1,761,710.00
237	601816	京沪高铁	2024年1月1日	4.92	111,700.00	549,564.00
238	601818	光大银行	2024年1月1日	2.9	192,300.00	557,670.00
239	601838	成都银行	2024年1月1日	11.26	34,300.00	386,218.00
240	601857	中国石油	2024年1月1日	7.06	77,900.00	549,974.00
241	601865	福莱特	2024年1月1日-2024年1月16日	26.7	744,700.00	19,883,490.00
242	601868	中国能建	2024年1月1日-2024年1月12日	2.1	13,730,900.00	28,834,890.00
243	601872	招商轮船	2024年1月1日-2024年1月12日	5.88	557,700.00	3,279,276.00
244	601877	正泰电器	2024年1月1日	21.51	23,100.00	496,881.00
245	601878	浙商证券	2024年1月1日-2024年1月11日	10.43	281,800.00	2,939,174.00
246	601881	中国银河	2024年1月1日-2024年1月10日	12.05	669,100.00	8,062,655.00
247	601888	中国中免	2024年1月1日-2024年1月10日	83.69	18,000.00	1,506,420.00
248	601898	中煤能源	2024年1月1日	9.69	68,600.00	664,734.00
249	601899	紫金矿业	2024年1月1日	12.46	45,600.00	568,176.00
250	601901	方正证券	2024年1月1日-2024年1月8日	8.06	149,300.00	1,203,358.00
251	601916	浙商银行	2024年1月3日	2.52	1,300.00	3,276.00
252	601919	中远海	2024年1月1日-2024年	9.58	167,400.00	1,603,692

		控	1月8日			.00
253	601939	建设银行	2024年1月1日-2024年1月12日	6.51	195,400.00	1,272,054.00
254	601985	中国核电	2024年1月1日	7.5	79,100.00	593,250.00
255	601988	中国银行	2024年1月1日	3.99	150,400.00	600,096.00
256	601989	中国重工	2024年1月1日	4.13	133,600.00	551,768.00
257	601995	中金公司	2024年1月1日-2024年1月11日	38.05	345,300.00	13,138,665.00
258	601998	中信银行	2024年1月1日-2024年1月8日	5.29	337,200.00	1,783,788.00
259	603019	中科曙光	2024年1月1日-2024年1月8日	39.49	58,900.00	2,325,961.00
260	603195	公牛集团	2024年1月1日-2024年1月12日	95.65	9,600.00	918,240.00
261	603259	药明康德	2024年1月1日	72.76	6,700.00	487,492.00
262	603260	合盛硅业	2024年1月1日-2024年1月12日	51	349,300.00	17,814,300.00
263	603288	海天味业	2024年1月1日	37.95	22,200.00	842,490.00
264	603290	斯达半导	2024年1月1日-2024年1月12日	181	57,900.00	10,479,900.00
265	603369	今世缘	2024年1月1日-2024年1月2日	48.75	48,400.00	2,359,500.00
266	603392	万泰生物	2024年1月1日-2024年1月15日	75.13	356,600.00	26,791,358.00
267	603486	科沃斯	2024年1月1日-2024年1月8日	41.44	135,700.00	5,623,408.00
268	603501	韦尔股份	2024年1月1日	106.71	5,400.00	576,234.00
269	603659	璞泰来	2024年1月1日	20.93	19,200.00	401,856.00
270	603799	华友钴业	2024年1月1日	32.93	13,600.00	447,848.00
271	603806	福斯特	2024年1月1日	24.27	19,800.00	480,546.00
272	603833	欧派家居	2024年1月1日-2024年1月12日	69.61	222,000.00	15,453,420.00
273	603899	晨光股份	2024年1月1日-2024年1月12日	37.55	140,200.00	5,264,510.00
274	603986	兆易创	2024年1月1日-2024年	92.39	9,400.00	868,466.00

		新	1月12日			0
275	603993	洛阳钼业	2024年1月1日-2024年1月12日	5.2	312,500.00	1,625,000.00
276	605117	德业股份	2024年1月1日-2024年1月12日	83.9	192,500.00	16,150,750.00
277	605499	东鹏饮料	2024年1月1日-2024年1月11日	182.51	55,000.00	10,038,050.00
278	688008	澜起科技	2024年1月1日-2024年1月4日	58.76	90,400.00	5,311,904.00
279	688012	中微公司	2024年1月1日	153.6	4,300.00	660,480.00
280	688036	传音控股	2024年1月1日	138.4	4,600.00	636,640.00
281	688065	凯赛生物	2024年1月1日-2024年1月8日	54.98	50,900.00	2,798,482.00
282	688111	金山办公	2024年1月1日-2024年1月10日	316.2	22,200.00	7,019,640.00
283	688126	沪硅产业	2024年1月1日	17.32	29,800.00	516,136.00
284	688187	时代电气	2024年1月1日-2024年1月22日	36.33	41,600.00	1,511,328.00
285	688223	晶科能源	2024年1月1日-2024年1月12日	8.86	1,558,000.00	13,803,880.00
286	688256	寒武纪-U	2024年1月8日-2024年1月9日	134.96	4,400.00	593,824.00
287	688303	大全能源	2024年1月1日-2024年1月22日	29.57	45,500.00	1,345,435.00
288	688363	华熙生物	2024年1月1日-2024年1月22日	66.93	195,400.00	13,078,122.00
289	688396	华润微	2024年1月1日-2024年1月22日	44.69	118,900.00	5,313,641.00
290	688561	奇安信-U	2024年1月1日-2024年1月2日	40.09	14,800.00	593,332.00
291	688599	天合光能	2024年1月1日	28.53	17,400.00	496,422.00
292	688981	中芯国际	2024年1月1日	53.02	10,500.00	556,710.00
合计	-	-	-	-	87,641,000	1,386,460,450.00

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工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所

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

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

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 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	557,763,846.81	-	-	-	-	-	557,763,846.81

结算备付金	1,178,798,737.04	-	-	-	-	-	1,178,798,737.04
存出保证金	7,663,107.81	-	-	-	-	142,407,720.00	150,070,827.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	129,302,062,860.16	129,302,062,860.16
应收股利	-	-	-	-	-	74,250.20	74,250.20
应收清算款	-	-	-	-	-	292,464,049.18	292,464,049.18
其他资产	-	-	-	-	-	1,054,977.37	1,054,977.37
资产总计	1,744,225,691.66	-	-	-	-	129,738,063,856.91	131,482,289,548.57
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	2,096,681.51	2,096,681.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,802,161.66	47,802,161.66
应付托管费	-	-	-	-	-	9,560,432.32	9,560,432.32
其他负债	-	-	-	-	-	336,266,006.46	336,266,006.46
负债总计	-	-	-	-	-	395,725,281.95	395,725,281.95
利率敏感度缺口	1,744,225,691.66	-	-	-	-	129,342,338,574.96	131,086,564,266.62
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	155,603,662.35	-	-	-	-	-	155,603,662.35
结算备付金	1,179,756,245.63	-	-	-	-	-	1,179,756,245.63
存出保证金	5,233,689.95	-	-	-	-	108,224,424.00	113,458,113.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,183,605,477.34	76,183,605,477.34
应收股利	-	-	-	-	-	329,237.44	329,237.44
应收清算款	-	-	-	-	-	2,829,488.24	2,829,488.24
其他资产	-	-	-	-	-	1,122,995.87	1,122,995.87
资产总计	1,340,593,597.93	-	-	-	-	76,296,111,622.89	77,636,705,220.82
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	30,652.12	30,652.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,555,976.07	30,555,976.07
应付托管费	-	-	-	-	-	6,111,195.25	6,111,195.25
应付清算款	-	-	-	-	-	53,830,041.48	53,830,041.48
应交税费	-	-	-	-	-	11.83	11.83
其他负债	-	-	-	-	-	43,674,118.72	43,674,118.72
负债总计	-	-	-	-	-	134,201,995.47	134,201,995.47
利率敏感度缺口	1,340,593,597.93	-	-	-	-	76,161,909,627.42	77,502,503,225.35

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：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 年 12 月 31 日：同)。

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	129,302,062,860.16	98.64	76,183,605,477.34	98.30
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	-2,096,681.51	-0.00	-30,652.12	0.00

合计	129,299,966,178.65	98.64	76,183,574,825.22	98.30
----	--------------------	-------	-------------------	-------

注：其他包含：1、可退替代款。2、在期货交易所交易的期货投资(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	除沪深 300 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）
	沪深 300 指数上升 5%	6,494,416,013.28	3,831,464,307.45
沪深 300 指数下降 5%	-6,494,416,013.28	-3,831,464,307.45	

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	129,300,832,868.14	76,181,672,587.51
第二层次	-	-

第三层次	1, 229, 992. 02	1, 932, 889. 83
合计	129, 302, 062, 860. 16	76, 183, 605, 477. 34

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	-	1, 932, 889. 83	1, 932, 889. 83
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2, 821, 317. 59	2, 821, 317. 59
转出第三层次	-	4, 697, 799. 55	4, 697, 799. 55
当期利得或损失总额	-	1, 173, 584. 15	1, 173, 584. 15
其中：计入损益的利得或损失	-	1, 173, 584. 15	1, 173, 584. 15
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1, 229, 992. 02	1, 229, 992. 02
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	-	159, 407. 39	159, 407. 39

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	-	4,058,988.63	4,058,988.63
转出第三层次	-	4,273,739.27	4,273,739.27
当期利得或损失总额	-	2,147,640.47	2,147,640.47
其中：计入损益的利得或损失	-	2,147,640.47	2,147,640.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,932,889.83	1,932,889.83
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	-	269,864.73	269,864.73

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	1,229,992.02	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	采用的估	不可观察输入值		

	价值	值技术	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	1,932,889.83	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 135,359,282,028.16 元(2022 年度：105,159,059,833.45 元)，其中包括以股票支付的申购款 79,841,614,082.16 元和以现金支付的申购款 55,517,667,946.00 元(2022 年度：其中包括以股票支付的申购款 59,562,854,288.89 元和以现金支付的申购款 45,596,205,544.56 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	129,302,062,860.16	98.34
	其中：股票	129,302,062,860.16	98.34
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	1,736,562,583.85	1.32
8	其他各项资产	443,664,104.56	0.34
9	合计	131,482,289,548.57	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 1,386,460,450.00 元，占本基金期末资产净值的 1.06%。其中，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 605,327,214.00 元。

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	1,639,432,022.98	1.25
B	采矿业	6,181,460,494.89	4.72
C	制造业	70,774,700,008.78	53.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,347,181,679.50	3.32
E	建筑业	2,674,611,270.63	2.04
F	批发和零售业	414,864,715.34	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	4,048,047,014.85	3.09
H	住宿和餐饮业	103,652,117.40	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,075,240,292.10	4.63
J	金融业	28,022,771,423.09	21.38
K	房地产业	1,701,089,717.60	1.30
L	租赁和商务服务业	1,094,951,446.33	0.84
M	科学研究和技术服务业	1,536,096,160.39	1.17
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	549,568,812.66	0.42

R	文化、体育和娱乐业	137,165,691.60	0.10
S	综合	-	-
	合计	129,300,832,868.14	98.64

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	1,090,634.93	0.00
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	36,490.19	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,263.03	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,229,992.02	0.00

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	4,611,361	7,959,209,086.00	6.07
2	601318	中国平安	80,509,362	3,244,527,288.60	2.48
3	300750	宁德时代	19,768,309	3,227,374,127.34	2.46
4	600036	招商银行	92,354,989	2,569,315,793.98	1.96
5	000858	五粮液	14,619,209	2,051,221,214.79	1.56
6	000333	美的集团	36,747,733	2,007,528,653.79	1.53
7	601166	兴业银行	108,488,610	1,758,600,368.10	1.34
8	600900	长江电力	73,168,653	1,707,756,361.02	1.30
9	601899	紫金矿业	123,057,029	1,533,290,581.34	1.17
10	600276	恒瑞医药	33,319,250	1,507,029,677.50	1.15
11	600030	中信证券	72,985,068	1,486,705,835.16	1.13
12	002594	比亚迪	6,860,057	1,358,291,286.00	1.04
13	300059	东方财富	94,743,056	1,330,192,506.24	1.01
14	300760	迈瑞医疗	4,504,449	1,308,992,879.40	1.00
15	002475	立讯精密	37,324,637	1,285,833,744.65	0.98
16	600887	伊利股份	47,708,323	1,276,197,640.25	0.97
17	601398	工商银行	261,897,957	1,251,872,234.46	0.95
18	601328	交通银行	205,250,332	1,178,136,905.68	0.90
19	603259	药明康德	15,446,608	1,123,895,198.08	0.86
20	000725	京东方 A	279,759,747	1,091,063,013.30	0.83
21	000651	格力电器	33,588,921	1,080,555,588.57	0.82
22	600309	万华化学	13,979,678	1,073,918,863.96	0.82
23	601012	隆基绿能	44,562,231	1,020,475,089.90	0.78
24	300124	汇川技术	15,969,104	1,008,289,226.56	0.77
25	000568	泸州老窖	5,414,235	971,422,043.70	0.74
26	002415	海康威视	27,936,656	969,960,696.32	0.74
27	600919	江苏银行	136,239,747	911,443,907.43	0.70
28	601816	京沪高铁	182,934,190	900,036,214.80	0.69
29	601288	农业银行	238,425,506	867,868,841.84	0.66
30	600809	山西汾酒	3,694,340	852,395,068.20	0.65
31	002714	牧原股份	20,422,781	841,010,121.58	0.64
32	300498	温氏股份	39,801,690	798,421,901.40	0.61

33	600028	中国石化	141,742,630	790,923,875.40	0.60
34	688981	中芯国际	14,859,936	787,873,806.72	0.60
35	601088	中国神华	24,637,835	772,396,127.25	0.59
36	601668	中国建筑	155,984,345	750,284,699.45	0.57
37	002352	顺丰控股	18,157,095	733,546,638.00	0.56
38	600016	民生银行	185,388,317	693,352,305.58	0.53
39	300274	阳光电源	7,815,158	684,529,689.22	0.52
40	000001	平安银行	72,629,538	681,991,361.82	0.52
41	600941	中国移动	6,833,317	679,778,375.16	0.52
42	600837	海通证券	72,237,280	676,863,313.60	0.52
43	600406	国电南瑞	29,869,184	666,680,186.88	0.51
44	000792	盐湖股份	40,617,616	647,850,975.20	0.49
45	002230	科大讯飞	13,721,785	636,416,388.30	0.49
46	000063	中兴通讯	23,863,254	631,898,965.92	0.48
47	601988	中国银行	157,201,169	627,232,664.31	0.48
48	601728	中国电信	115,809,651	626,530,211.91	0.48
49	600050	中国联通	142,629,301	624,716,338.38	0.48
50	000625	长安汽车	37,082,244	624,094,166.52	0.48
51	601888	中国中免	7,396,185	618,986,722.65	0.47
52	600031	三一重工	44,425,275	611,736,036.75	0.47
53	601601	中国太保	25,507,040	606,557,411.20	0.46
54	601225	陕西煤业	28,930,207	604,352,024.23	0.46
55	000100	TCL 科技	140,174,630	602,750,909.00	0.46
56	601857	中国石油	84,771,814	598,489,006.84	0.46
57	600690	海尔智家	28,324,929	594,823,509.00	0.45
58	002142	宁波银行	29,548,020	594,210,682.20	0.45
59	600000	浦发银行	87,612,402	579,994,101.24	0.44
60	600436	片仔癀	2,391,974	578,833,788.26	0.44
61	603501	韦尔股份	5,361,199	572,093,545.29	0.44
62	000338	潍柴动力	40,575,086	553,849,923.90	0.42
63	300015	爱尔眼科	34,738,863	549,568,812.66	0.42
64	300122	智飞生物	8,896,307	543,653,320.77	0.41
65	300308	中际旭创	4,731,765	534,263,586.15	0.41
66	000002	万科 A	50,756,927	530,917,456.42	0.41
67	601688	华泰证券	38,047,705	530,765,484.75	0.40
68	600048	保利发展	53,606,585	530,705,191.50	0.40
69	601985	中国核电	70,405,240	528,039,300.00	0.40
70	600089	特变电工	37,693,992	520,177,089.60	0.40
71	600438	通威股份	20,221,917	506,154,582.51	0.39
72	688111	金山办公	1,584,587	501,046,409.40	0.38
73	601169	北京银行	110,581,631	500,934,788.43	0.38
74	601211	国泰君安	33,593,680	499,873,958.40	0.38
75	688041	海光信息	7,014,676	497,901,702.48	0.38

76	002304	洋河股份	4,480,578	492,415,522.20	0.38
77	600150	中国船舶	16,657,100	490,385,024.00	0.37
78	002050	三花智控	16,674,197	490,221,391.80	0.37
79	601766	中国中车	90,776,309	477,483,385.34	0.36
80	002027	分众传媒	75,310,874	475,964,723.68	0.36
81	603288	海天味业	12,438,199	472,029,652.05	0.36
82	688012	中微公司	3,066,276	470,979,993.60	0.36
83	600104	上汽集团	34,725,011	469,829,398.83	0.36
84	600905	三峡能源	106,884,100	467,083,517.00	0.36
85	601919	中远海控	47,847,950	458,383,361.00	0.35
86	002371	北方华创	1,864,697	458,174,699.87	0.35
87	603986	兆易创新	4,925,297	455,048,189.83	0.35
88	600660	福耀玻璃	11,995,212	448,500,976.68	0.34
89	601138	工业富联	29,600,288	447,556,354.56	0.34
90	601229	上海银行	73,990,367	441,722,490.99	0.34
91	601390	中国中铁	76,869,471	436,618,595.28	0.33
92	002466	天齐锂业	7,778,357	433,954,537.03	0.33
93	688008	澜起科技	6,903,507	405,650,071.32	0.31
94	300782	卓胜微	2,873,387	405,147,567.00	0.31
95	601818	光大银行	138,734,207	402,329,200.30	0.31
96	600585	海螺水泥	17,829,992	402,244,619.52	0.31
97	600019	宝钢股份	66,029,801	391,556,719.93	0.30
98	300014	亿纬锂能	9,093,674	383,753,042.80	0.29
99	600999	招商证券	27,785,780	378,998,039.20	0.29
100	002129	TCL 中环	24,216,484	378,745,809.76	0.29
101	688271	联影医疗	2,696,928	369,506,105.28	0.28
102	000661	长春高新	2,520,508	367,490,066.40	0.28
103	600111	北方稀土	18,950,136	366,495,630.24	0.28
104	002241	歌尔股份	17,200,093	361,373,953.93	0.28
105	600893	航发动力	9,657,261	360,988,416.18	0.28
106	601658	邮储银行	82,688,800	359,696,280.00	0.27
107	002460	赣锋锂业	8,400,494	359,541,143.20	0.27
108	601628	中国人寿	12,423,033	352,192,985.55	0.27
109	601989	中国重工	85,237,338	352,030,205.94	0.27
110	600760	中航沈飞	8,230,575	347,165,653.50	0.26
111	603019	中科曙光	8,654,975	341,784,962.75	0.26
112	600958	东方证券	38,870,952	338,177,282.40	0.26
113	002049	紫光国微	4,983,051	336,106,789.95	0.26
114	000538	云南白药	6,803,084	334,371,578.60	0.26
115	601600	中国铝业	58,942,129	332,433,607.56	0.25
116	601006	大秦铁路	45,803,633	330,244,193.93	0.25
117	603799	华友钴业	10,001,637	329,353,906.41	0.25
118	000938	紫光股份	17,001,938	328,987,500.30	0.25

119	600570	恒生电子	11,425,837	328,607,072.12	0.25
120	600938	中国海油	15,632,178	327,806,772.66	0.25
121	601939	建设银行	50,013,909	325,590,547.59	0.25
122	600584	长电科技	10,791,000	322,219,260.00	0.25
123	002252	上海莱士	39,801,595	318,412,760.00	0.24
124	601669	中国电建	64,438,785	315,105,658.65	0.24
125	000776	广发证券	21,965,436	313,886,080.44	0.24
126	002179	中航光电	7,937,229	309,551,931.00	0.24
127	600426	华鲁恒升	11,177,407	308,384,659.13	0.24
128	600547	山东黄金	13,429,809	307,139,731.83	0.23
129	601377	兴业证券	51,720,953	303,601,994.11	0.23
130	600009	上海机场	9,237,586	302,808,069.08	0.23
131	688036	传音控股	2,183,467	302,191,832.80	0.23
132	000166	申万宏源	67,058,300	297,738,852.00	0.23
133	002271	东方雨虹	15,237,977	292,569,158.40	0.22
134	600886	国投电力	22,155,399	292,008,158.82	0.22
135	000425	徐工机械	52,992,243	289,337,646.78	0.22
136	300408	三环集团	9,784,030	288,139,683.50	0.22
137	002920	德赛西威	2,199,726	284,886,514.26	0.22
138	002311	海大集团	6,335,749	284,538,487.59	0.22
139	601009	南京银行	38,525,833	284,320,647.54	0.22
140	300142	沃森生物	12,027,654	282,770,145.54	0.22
141	601916	浙商银行	112,009,650	282,264,318.00	0.22
142	600745	闻泰科技	6,605,675	279,486,109.25	0.21
143	600795	国电电力	66,486,597	276,584,243.52	0.21
144	000963	华东医药	6,656,645	275,984,501.70	0.21
145	603993	洛阳钼业	52,825,443	274,692,303.60	0.21
146	002236	大华股份	14,870,530	274,361,278.50	0.21
147	600588	用友网络	15,406,320	274,078,432.80	0.21
148	600085	同仁堂	5,012,089	269,149,179.30	0.21
149	000596	古井贡酒	1,153,087	268,438,653.60	0.20
150	600015	华夏银行	47,748,526	268,346,716.12	0.20
151	600926	杭州银行	26,403,282	264,296,852.82	0.20
152	601186	中国铁建	34,273,650	260,822,476.50	0.20
153	001979	招商蛇口	27,180,514	259,030,298.42	0.20
154	600845	宝信软件	5,288,397	258,073,773.60	0.20
155	000977	浪潮信息	7,730,712	256,659,638.40	0.20
156	002459	晶澳科技	12,374,700	256,403,784.00	0.20
157	601111	中国国航	34,650,502	254,334,684.68	0.19
158	600011	华能国际	32,858,829	253,012,983.30	0.19
159	601995	中金公司	6,641,269	252,700,285.45	0.19
160	600674	川投能源	16,621,174	251,312,150.88	0.19
161	600115	中国东航	63,940,756	248,090,133.28	0.19

162	002812	恩捷股份	4,355,602	247,485,305.64	0.19
163	600010	包钢股份	169,041,468	246,800,543.28	0.19
164	601689	拓普集团	3,342,500	245,673,750.00	0.19
165	601901	方正证券	30,409,247	245,098,530.82	0.19
166	600989	宝丰能源	16,432,800	242,712,456.00	0.19
167	000157	中联重科	37,093,895	242,223,134.35	0.18
168	601360	三六零	26,550,506	239,220,059.06	0.18
169	300033	同花顺	1,521,096	238,614,329.52	0.18
170	600196	复星医药	9,427,225	235,963,441.75	0.18
171	000768	中航西飞	10,507,555	235,054,005.35	0.18
172	002493	荣盛石化	22,623,101	234,149,095.35	0.18
173	600029	南方航空	40,368,941	232,525,100.16	0.18
174	688599	天合光能	8,130,799	231,971,695.47	0.18
175	601633	长城汽车	9,164,175	231,120,493.50	0.18
176	300661	圣邦股份	2,569,595	228,719,650.95	0.17
177	601066	中信建投	9,600,598	227,150,148.68	0.17
178	300496	中科创达	2,832,677	226,784,120.62	0.17
179	601788	光大证券	14,706,724	226,777,684.08	0.17
180	603369	今世缘	4,625,599	225,497,951.25	0.17
181	300896	爱美客	765,134	225,201,890.22	0.17
182	601100	恒立液压	4,012,934	219,427,231.12	0.17
183	002555	三七互娱	11,652,629	219,185,951.49	0.17
184	603392	万泰生物	2,917,085	219,160,596.05	0.17
185	300347	泰格医药	3,937,881	216,465,318.57	0.17
186	002709	天赐材料	8,576,597	215,101,052.76	0.16
187	600489	中金黄金	21,459,785	213,739,458.60	0.16
188	300316	晶盛机电	4,847,452	213,724,158.68	0.16
189	688126	沪硅产业	12,312,699	213,255,946.68	0.16
190	002601	龙佰集团	12,408,145	212,551,523.85	0.16
191	300450	先导智能	8,191,650	209,706,240.00	0.16
192	600600	青岛啤酒	2,802,470	209,484,632.50	0.16
193	600346	恒力石化	15,816,039	208,297,233.63	0.16
194	000895	双汇发展	7,792,834	208,146,596.14	0.16
195	601868	中国能建	97,007,200	203,715,120.00	0.16
196	600188	兖矿能源	10,242,075	202,895,505.75	0.15
197	601800	中国交建	26,422,000	200,807,200.00	0.15
198	300433	蓝思科技	14,986,889	197,826,934.80	0.15
199	601336	新华保险	6,351,702	197,728,483.26	0.15
200	002001	新和成	11,617,759	197,037,192.64	0.15
201	002821	凯莱英	1,686,032	195,748,315.20	0.15
202	300759	康龙化成	6,754,163	195,735,643.74	0.15
203	601881	中国银河	16,134,603	194,421,966.15	0.15
204	601699	潞安环能	8,859,728	194,116,640.48	0.15

205	600741	华域汽车	11,810,544	192,275,656.32	0.15
206	600372	中航机载	14,578,878	192,149,612.04	0.15
207	000301	东方盛虹	19,835,169	190,417,622.40	0.15
208	688256	寒武纪	1,407,676	189,979,952.96	0.14
209	600515	海南机场	50,722,008	187,671,429.60	0.14
210	601021	春秋航空	3,703,208	185,901,041.60	0.14
211	002648	卫星化学	12,537,161	184,923,124.75	0.14
212	002736	国信证券	21,406,000	182,807,240.00	0.14
213	003816	中国广核	58,548,600	182,086,146.00	0.14
214	002007	华兰生物	8,198,668	181,436,522.84	0.14
215	000786	北新建材	7,613,111	177,842,272.96	0.14
216	000733	振华科技	3,005,938	176,869,391.92	0.13
217	600176	中国巨石	17,803,284	175,006,281.72	0.13
218	601117	中国化学	27,467,644	174,694,215.84	0.13
219	601877	正泰电器	8,030,121	172,727,902.71	0.13
220	002074	国轩高科	7,988,494	171,752,621.00	0.13
221	002180	纳思达	7,470,199	169,050,603.37	0.13
222	002410	广联达	9,857,708	168,961,115.12	0.13
223	601615	明阳智能	13,440,831	168,548,020.74	0.13
224	000983	山西焦煤	16,871,390	166,689,333.20	0.13
225	688396	华润微	3,716,063	166,070,855.47	0.13
226	002202	金风科技	20,613,714	164,909,712.00	0.13
227	601618	中国中冶	53,348,480	163,246,348.80	0.12
228	600183	生益科技	8,704,800	159,384,888.00	0.12
229	601838	成都银行	14,120,511	158,996,953.86	0.12
230	000876	新希望	16,883,985	157,358,740.20	0.12
231	600233	圆通速递	12,764,500	156,875,705.00	0.12
232	600219	南山铝业	52,537,530	154,460,338.20	0.12
233	601878	浙商证券	14,620,736	152,494,276.48	0.12
234	301269	华大九天	1,424,385	150,771,152.25	0.12
235	000999	华润三九	3,020,610	150,214,935.30	0.11
236	600332	白云山	5,190,192	148,439,491.20	0.11
237	300223	北京君正	2,279,567	147,374,006.55	0.11
238	002603	以岭药业	6,378,865	147,160,415.55	0.11
239	300999	金龙鱼	4,407,200	147,112,336.00	0.11
240	000408	藏格矿业	5,793,400	146,804,756.00	0.11
241	002841	视源股份	3,203,210	146,578,889.60	0.11
242	600460	士兰微	6,340,086	144,744,163.38	0.11
243	601238	广汽集团	16,537,920	144,706,800.00	0.11
244	601872	招商轮船	24,373,804	143,317,967.52	0.11
245	600918	中泰证券	20,772,900	142,502,094.00	0.11
246	603260	合盛硅业	2,790,230	142,301,730.00	0.11
247	600732	爱旭股份	8,010,471	141,304,708.44	0.11

248	600362	江西铜业	7,779,929	138,949,531.94	0.11
249	601607	上海医药	8,301,268	138,880,213.64	0.11
250	603659	璞泰来	6,554,213	137,179,678.09	0.10
251	300413	芒果超媒	5,443,083	137,165,691.60	0.10
252	600023	浙能电力	29,738,358	137,093,830.38	0.10
253	688303	大全能源	4,544,388	134,377,553.16	0.10
254	688223	晶科能源	15,098,679	133,774,295.94	0.10
255	601898	中煤能源	13,526,059	131,067,511.71	0.10
256	601799	星宇股份	998,892	130,964,730.12	0.10
257	600061	国投资本	19,321,544	130,227,206.56	0.10
258	300454	深信服	1,769,227	127,897,419.83	0.10
259	603806	福斯特	5,268,833	127,874,576.91	0.10
260	300919	中伟股份	2,599,164	127,696,927.32	0.10
261	300751	迈为股份	971,958	125,878,280.58	0.10
262	601998	中信银行	23,074,866	122,066,041.14	0.09
263	600875	东方电气	8,287,103	121,157,445.86	0.09
264	600803	新奥股份	7,020,900	118,091,538.00	0.09
265	300763	锦浪科技	1,680,700	117,480,930.00	0.09
266	601319	中国人保	23,916,200	115,754,408.00	0.09
267	000069	华侨城 A	36,794,329	114,430,363.19	0.09
268	600025	华能水电	13,252,200	114,366,486.00	0.09
269	600132	重庆啤酒	1,711,613	113,736,683.85	0.09
270	601865	福莱特	4,228,525	112,901,617.50	0.09
271	002938	鹏鼎控股	5,047,100	112,651,272.00	0.09
272	300628	亿联网络	3,797,395	112,213,022.25	0.09
273	603290	斯达半导	598,311	108,294,291.00	0.08
274	603899	晨光股份	2,851,939	107,090,309.45	0.08
275	000708	中信特钢	7,582,144	106,453,301.76	0.08
276	600754	锦江酒店	3,466,626	103,652,117.40	0.08
277	000617	中油资本	19,012,979	102,670,086.60	0.08
278	600018	上港集团	20,813,042	101,983,905.80	0.08
279	605117	德业股份	1,204,364	101,046,139.60	0.08
280	002916	深南电路	1,396,640	99,147,473.60	0.08
281	605499	东鹏饮料	540,000	98,555,400.00	0.08
282	600039	四川路桥	12,900,719	96,626,385.31	0.07
283	688363	华熙生物	1,358,904	90,951,444.72	0.07
284	688065	凯赛生物	1,602,025	88,079,334.50	0.07
285	603833	欧派家居	1,255,301	87,381,502.61	0.07
286	603195	公牛集团	896,662	85,765,720.30	0.07
287	000877	天山股份	12,836,400	85,747,152.00	0.07
288	300957	贝泰妮	1,198,000	81,667,660.00	0.06
289	601236	红塔证券	10,688,126	81,122,876.34	0.06
290	601698	中国卫通	4,623,195	80,027,505.45	0.06

291	601155	新城控股	6,865,467	78,334,978.47	0.06
292	688561	奇安信	1,907,853	76,485,826.77	0.06
293	600606	绿地控股	31,604,596	72,690,570.80	0.06
294	688187	时代电气	1,829,637	66,470,712.21	0.05
295	603486	科沃斯	1,566,400	64,911,616.00	0.05
296	601808	中海油服	4,368,100	63,861,622.00	0.05
297	000800	一汽解放	7,008,300	59,570,550.00	0.05
298	300979	华利集团	982,384	51,712,693.76	0.04
299	601059	信达证券	2,670,193	48,036,772.07	0.04
300	001289	龙源电力	996,818	19,746,964.58	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
2	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
3	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
4	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
5	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
6	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
7	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
8	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
9	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
10	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
11	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
12	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
13	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
14	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
15	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
16	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
17	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
18	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
19	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
20	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
21	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
22	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
23	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
24	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
25	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00

26	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
27	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
28	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
29	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
30	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
31	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
32	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
33	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
34	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
35	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
36	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
37	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
38	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
39	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
40	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
41	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
42	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
43	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
44	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
45	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
46	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
47	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
48	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
49	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
50	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
51	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
52	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
53	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
54	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
55	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
56	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
57	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
58	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
59	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
60	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
61	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
62	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
63	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
64	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
65	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
66	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
67	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
68	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00

69	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
70	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
71	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
72	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
73	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
74	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
75	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
76	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
77	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
78	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
79	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
80	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
81	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
82	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
83	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
84	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
85	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
86	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
87	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
88	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
89	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
90	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	300750	宁德时代	4,314,854,741.77	5.57
2	000858	五粮液	2,642,249,146.22	3.41
3	000333	美的集团	1,982,416,802.07	2.56
4	002594	比亚迪	1,941,543,781.85	2.51
5	300059	东方财富	1,540,797,494.35	1.99
6	300760	迈瑞医疗	1,370,428,974.99	1.77
7	002415	海康威视	1,198,972,517.41	1.55
8	000651	格力电器	1,146,321,534.42	1.48
9	002475	立讯精密	1,136,503,291.33	1.47
10	000725	京东方 A	1,090,789,935.86	1.41

11	000568	泸州老窖	1,075,143,946.64	1.39
12	300124	汇川技术	959,103,699.81	1.24
13	002352	顺丰控股	904,502,993.20	1.17
14	002714	牧原股份	847,532,856.11	1.09
15	000001	平安银行	825,208,818.27	1.06
16	300274	阳光电源	802,320,931.02	1.04
17	000063	中兴通讯	777,929,849.18	1.00
18	000792	盐湖股份	751,057,767.40	0.97
19	002142	宁波银行	745,403,926.14	0.96
20	300498	温氏股份	731,704,594.91	0.94

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	2,427,677,166.14	3.13
2	000858	五粮液	1,625,534,541.52	2.10
3	002594	比亚迪	1,214,362,200.48	1.57
4	000333	美的集团	1,019,032,567.10	1.31
5	002415	海康威视	905,234,890.57	1.17
6	300059	东方财富	901,530,191.81	1.16
7	300760	迈瑞医疗	654,665,934.67	0.84
8	000651	格力电器	605,638,345.19	0.78
9	000725	京东方 A	592,863,631.79	0.76
10	002475	立讯精密	579,987,467.14	0.75
11	000568	泸州老窖	553,232,678.58	0.71
12	002352	顺丰控股	549,622,304.65	0.71
13	000661	长春高新	479,725,227.69	0.62
14	000001	平安银行	470,495,353.54	0.61
15	002714	牧原股份	465,553,885.30	0.60
16	300274	阳光电源	449,066,721.02	0.58
17	600519	贵州茅台	441,084,405.00	0.57
18	000792	盐湖股份	437,752,876.19	0.56
19	300124	汇川技术	433,749,681.68	0.56
20	002142	宁波银行	420,992,978.87	0.54

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	63,747,522,664.80
卖出股票收入（成交）总额	37,430,048,216.20

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

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。

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。

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	150,070,827.81
2	应收清算款	292,464,049.18
3	应收股利	74,250.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,054,977.37
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	443,664,104.56

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

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	600519	贵州茅台	3,797,200.00	0.00	转融通证券出借
2	000858	五粮液	982,170.00	0.00	转融通证券出借
3	300750	宁德时代	636,714.00	0.00	转融通证券出借
4	600900	长江电力	611,508.00	0.00	转融通证券出借
5	601166	兴业银行	583,560.00	0.00	转融通证券出借
6	600276	恒瑞医药	569,898.00	0.00	转融通证券出借
7	601899	紫金矿业	568,176.00	0.00	转融通证券出借
8	000333	美的集团	551,763.00	0.00	转融通证券出借
9	600036	招商银行	492,414.00	0.00	转融通证券出借
10	601318	中国平安	479,570.00	0.00	转融通证券出借

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	688563	航材股份	90,795.49	0.00	新股锁定期内
2	688548	广钢气体	51,612.00	0.00	新股锁定期内
3	301526	国际复材	43,267.35	0.00	新股锁定期内
4	301487	盟固利	35,512.32	0.00	新股锁定期内
5	688549	中巨芯	34,738.46	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 (%)
611,000	61,283.29	24,242,259,512.00	64.74	12,468,601,813.00	33.30	733,226,365.00	1.96

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	中央汇金投资有限责 任公司	6,247,371,001.00	16.68
2	国泰君安证券股份有 限公司	1,077,837,248.00	2.88
3	中信证券股份有限公 司	761,932,007.00	2.03
4	广发证券股份有限公 司	694,256,047.00	1.85
5	中国人寿保险股份有 限公司	445,531,636.00	1.19
6	申万宏源证券有限公 司	423,757,484.00	1.13
7	中国国际金融股份有 限公司	340,226,061.00	0.91
8	国联证券股份有限公 司	313,306,367.00	0.84
9	安信证券股份有限公 司	309,465,128.00	0.83
10	海通证券股份有限公 司	307,567,448.00	0.82

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	10,000.00	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、基金投资和研究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（2012 年 5 月 4 日）基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	19,691,587,690.00
本报告期基金总申购份额	35,268,300,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	17,515,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	37,444,087,690.00

§ 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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。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 170,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供 12 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：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。

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 (%)	
广发证券	6	50,042,648,641.14	49.47	6,998,588.43	32.94	-
华泰证券	2	22,319,506,2	22.07	8,176,593.04	38.48	-

		06.01				
招商证券	2	19,466,629,820.49	19.25	2,768,534.50	13.03	-
中信建投	2	4,783,231,907.50	4.73	675,884.30	3.18	-
方正证券	2	2,042,479,815.06	2.02	318,420.09	1.50	-
华宝证券	1	1,362,340,067.06	1.35	1,255,126.99	5.91	-
安信证券	1	672,431,382.24	0.66	619,511.46	2.92	-
中金公司	2	462,230,208.31	0.46	433,633.19	2.04	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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

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。

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(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	21,756,022.30	50.27	-	-	-	-
中信建投	17,268,668.08	39.90	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	4,257,356.44	9.84	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证	-	-	-	-	-	-

券						
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

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 23 日
3	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
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 12 月 13 日

	公告		
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 12 月 01 日
6	关于同意中国银河证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 10 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 08 日
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	关于同意中信建投证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 05 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
15	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 17 日
16	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
17	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
18	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	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 05 日

	有限公司费率优惠活动的公告		
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 08 月 02 日
20	关于同意国金证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 19 日
21	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
22	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
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 06 月 21 日
24	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 16 日
25	关于同意东海证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 08 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 06 月 03 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
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 04 月 29 日
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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

	公告		
34	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
35	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
36	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
37	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 01 月 09 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

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。

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
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