

华泰柏瑞中证科技 100 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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>66</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	66
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	67
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 .....	68
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
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 .....	75
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 .....	75
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 .....	75
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 .....	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75
8.12 投资组合报告附注 .....	75
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
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 .....	77
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>78</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
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 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>83</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	84
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>84</b>
13.1 备查文件目录 .....	84
13.2 存放地点 .....	84
13.3 查阅方式 .....	84

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证科技 100ETF
场内简称	中证科技（扩位证券简称：科技 100ETF）
基金主代码	515580
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 27 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	614,031,444.00 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	2019 年 10 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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	1、股票的投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货的投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证科技 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持一致。

### 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	杨军智
	联系电话	021-38601777	010-60834299
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-888-0001	010-60836588
传真		021-38601799	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层

邮政编码	200135	100125
法定代表人	贾波	张佑君

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-5,437,326.59	-56,369,803.67	243,408,928.81
本期利润	16,928,294.13	-160,635,303.93	104,877,870.96
加权平均基金份额本期利润	0.0277	-0.2365	0.2487
本期加权平均净值利润率	3.55%	-30.37%	16.22%
本期基金份额净值增长率	-0.69%	-25.88%	17.84%
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	133,337,366.41	208,873,983.52	266,639,249.58
期末可供分配基金份额利润	0.2172	0.2222	0.4744
期末基金资产净值	440,353,088.89	678,889,705.88	547,654,971.58
期末基金份额净值	0.7172	0.7222	0.9744

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	43.44%	44.44%	94.88%

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

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

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

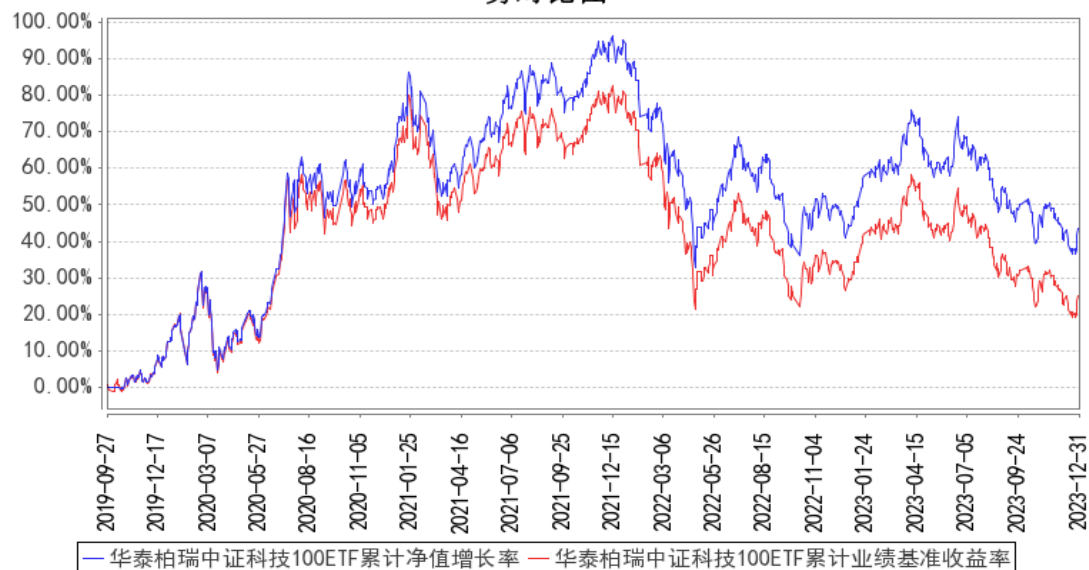
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.58%	1.09%	-5.03%	1.12%	0.45%	-0.03%
过去六个月	-15.00%	1.10%	-16.39%	1.13%	1.39%	-0.03%
过去一年	-0.69%	1.12%	-3.40%	1.14%	2.71%	-0.02%
过去三年	-13.26%	1.32%	-21.45%	1.35%	8.19%	-0.03%
自基金合同生效起至今	43.44%	1.44%	25.31%	1.47%	18.13%	-0.03%

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

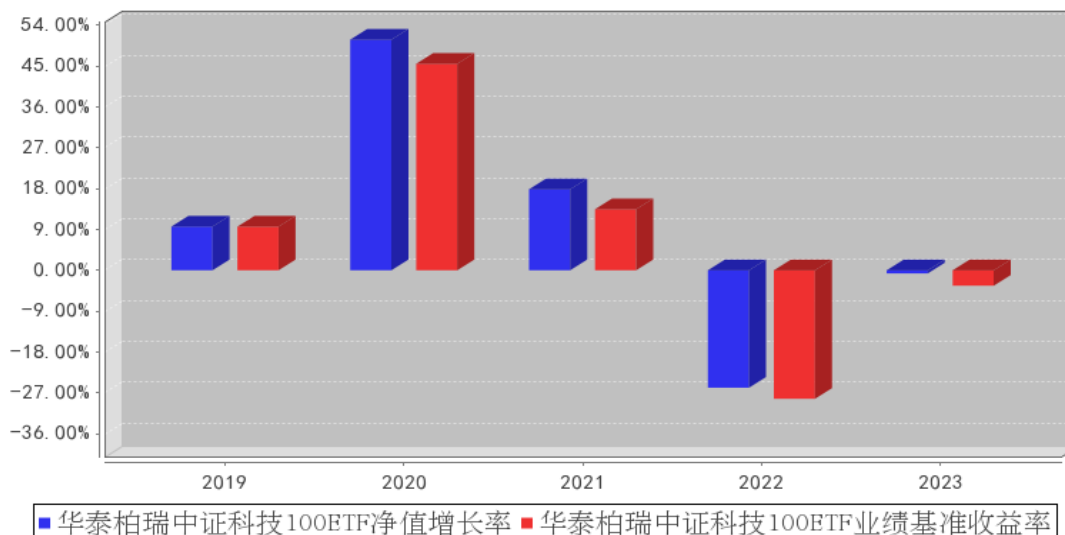
华泰柏瑞中证科技100ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2019 年 9 月 27 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

华泰柏瑞中证科技 100ETF 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



注：本基金合同自 2019 年 9 月 27 日起生效，2019 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、



华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞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		
谭弘翔	指数投资部 副总监、本基金的基金经理	2021 年 4 月 29 日	-	7 年	美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融工程专业硕士。曾任上海证券交易所产品创新中心基金业务部经理。2020 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部副总监。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月起任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 6 月起任华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞创业板科技交易型开

					<p>放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起任华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 8 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 20 次，其中 4 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 16 次为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、煤炭、家电、石油石化的表现相对较好，涨跌幅分别为 24.78%、19.84%、13.39%、9.13%和 9.03%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-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 成长（-15.12%）亦显著跑输中证 500 价值（-2.81%）。

2023 年，A 股市场经历了国内外经济预期的分化与波动，主要宽基指数普遍调整，“杠铃”式配置成为主流，小盘与红利策略表现相对占优。行业方面，受益于多重产业催化，TMT 板块与汽车行业全年领涨，AIGC、消费电子、新能源汽车、智能汽车产业链表现亮眼，相较而言，新能源、线下消费、房地产表现较弱。中证科技 100 指数中，电子、电力设备及新能源、医药、计算机、通信等行业占比较高，2023 年累计下跌 3.40%。

复盘 2023 年影响 A 股科技投资的重要事件，包括但不限于：1 月 8 日新冠正式实施“乙类乙

管”，1月23日微软追加投资 OpenAI，2月17日全面注册制落地实施，3月5日政府工作报告指向轻总量重结构调整，3月8日硅谷银行暴雷，3月17日央行降准 25BP，4月29日政治局会议布局加快建设现代化产业体系，5月17日人民币汇率破“7”，5月末美债上行风险扰动加大，6月20日一年期与五年期 LPR 利率下调 10BP，7月24日政治局会议要求加大逆周期调节、“活跃资本市场”，8月15日一年期 MLF 利率下调 15BP，8月27日证监会活跃资本市场一揽子举措落地，8月29日华为发售新机 Mate60，9月14日央行降准 25BP，10月19日十年期美债利率升破 5%，10月底中央金融工作会议召开，11月15日中美元首会晤，12月14日美联储议息会议表示降息讨论“逐步进入视野”，12月中央经济工作会议将“科技创新引领现代化体系建设”列为 2024 年经济工作首要任务。

与整体偏向积极的产业和政策层面不同，二季度以来资金层面偏向消极，带来较大抛压，背后主要是国内经济复苏斜率放缓与美联储加息预期反复两重不确定性的演绎。尤其在房地产长期形成的结构性问题和部分地方政府债务高企拖累内需增长的情况下，投资者风险偏好收缩，存量博弈下资金由成长板块向高股息价值板块流动。

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 0.028%，期间日跟踪误差为 0.039%，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 0.7172 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.69%，业绩比较基准收益率为-3.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年，外部环境来看：1) 发达经济体制造业库存触底对冲财政红利减退和高利率，2) 新兴市场外需情况在海外去库存周期结束的背景下逐步走向正常化，意味着海外高利率缓和的背景下，汇率和投资环境有望走向正常化；内部环境来看：1) 海外库存周期回升对应中国出口中枢修复，2) 因城施策、城中村、保障房等各种力量共同作用下，地产对经济拖累减小，3) 财政呈现出更为积极的特征，从新一轮化债及增发万亿国债来看，2024 年狭广义财政空间可能会适度扩张，出口、地产、化债有望成为带动实际增长逐步正常化、名义增长逐步回升的“三驾马车”。

在 2024 年宏观经济整体延续结构性修复的背景下，企业盈利有望持续复苏，结构或延续分化，当前景气持续改善的包括汽车、交运等行业，出现回暖迹象的包括电子、传媒、计算机等行业。

伴随基本面释放与资本催熟，2024 年市场的结构性机会有望增加，一方面是以 TMT 与汽车为代表、受到 AI 技术迭代与华为创新链催化的科技成长板块，另一方面是存在反转逻辑、受创新药

与医药出海双重驱动的医药板块。此外，新能源板块的供需拐点亦逐渐明确，一方面全球需求大概率在 GDA 的顶层引导下进一步加速，光伏、锂电池等具备相对成本优势的领域有望成为我国潜在出口敞口，另一方面供给侧出清现象亦有增多，当前行业集中度已经开始提升，格局提前进入优化阶段，产能增长有望大幅放缓；当下板块估值已处于历史极低水平，若后续产能出清推动产业链利润分配回归合理，板块反转动力或进一步夯实。

当前，A 股市场估值已显著回落至历史低位，股债收益差显示中长期配置价值已充分凸显。科技 100 指数截至 2023 年底处于上市以来 25%左右的历史分位，修复空间较为充足，在整体环境边际向好的情况下，有望扭转过去两年的颓势，去向上争取超越大盘基准的表现。

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，基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的 100%；基金收益分配每年至多 4 次。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 133,337,366.41 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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及



其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期，由华泰柏瑞基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 22195 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	华泰柏瑞中证科技 100 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中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证科技 100 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中证科技 100 ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

	<p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证科技 100 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>华泰柏瑞中证科技 100 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中证科技 100 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中证科技 100 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中证科技 100 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，就可能对华泰柏瑞中证科技 100 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证科技 100 ETF 基金不能持续经营。</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。 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。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	10,014,515.61	12,865,228.44
结算备付金		53,917.42	573,435.82
存出保证金		96,309.64	355,713.77
交易性金融资产	7.4.7.2	433,947,060.28	665,567,638.30
其中: 股票投资		433,947,060.28	665,567,638.30
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		49,339.86	285,049.16
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.8	4,378.22	-
资产总计		444,165,521.03	679,647,065.49
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	1,014.40
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,125,916.80	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		179,715.81	293,349.96
应付托管费		35,943.14	58,670.01
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	470,856.39	404,325.24
负债合计		3,812,432.14	757,359.61
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	307,015,722.48	470,015,722.36
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	133,337,366.41	208,873,983.52
净资产合计		440,353,088.89	678,889,705.88
负债和净资产总计		444,165,521.03	679,647,065.49

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7172 元，基金份额总额 614,031,444.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		20,139,771.34	-157,152,895.60
1. 利息收入		198,798.07	211,256.07
其中：存款利息收入	7.4.7.13	159,159.65	206,656.20
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		39,638.42	4,599.87
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,358,997.29	-53,093,970.92
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-8,289,895.22	-58,555,276.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	348,458.28	127,432.55
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	6,582,439.65	5,333,873.52
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	22,365,620.72	-104,265,500.26
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	-1,065,650.16	-4,680.49
<b>减：二、营业总支出</b>		3,211,477.21	3,482,408.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,407,753.89	2,621,709.38
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	481,550.68	524,341.88
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1.06	0.57
8. 其他费用	7.4.7.23	322,171.58	336,356.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,928,294.13	-160,635,303.93
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,928,294.13	-160,635,303.93
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		16,928,294.13	-160,635,303.93

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证科技 100 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	470,015,722.36	-	208,873,983.52	678,889,705.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	470,015,722.36	-	208,873,983.52	678,889,705.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-162,999,999.88	-	-75,536,617.11	-238,536,616.99
(一)、综合收益总额	-	-	16,928,294.13	16,928,294.13
(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)	-162,999,999.88	-	-92,464,911.24	-255,464,911.12
其中：1. 基金申购款	109,000,000.14	-	69,961,517.69	178,961,517.83
2. 基金赎回款	-272,000,000.02	-	-162,426,428.93	-434,426,428.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	307,015,722.48	-	133,337,366.41	440,353,088.89
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	281,015,722.00	-	266,639,249.58	547,654,971.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	281,015,722.00	-	266,639,249.58	547,654,971.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	189,000,000.36	-	-57,765,266.06	131,234,734.30
(一)、综合收益总额	-	-	-160,635,303.93	-160,635,303.93
(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)	189,000,000.36	-	102,870,037.87	291,870,038.23
其中：1. 基金申购款	318,000,000.41	-	175,875,839.63	493,875,840.04
2. 基金赎回款	-129,000,000.05	-	-73,005,801.76	-202,005,801.81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	470,015,722.36	-	208,873,983.52	678,889,705.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证科技 100 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[2019]1469 号《关于准予华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证科技 100 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 2,120,015,722.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0562 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,120,015,722.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2019]213 号文审核同意,本基金 2,120,015,722.00 份基金份额于 2019 年 10 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《华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证科技 100 指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证科技 100 ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证科技 100 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。



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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证科技 100 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业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于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；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置

资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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	10,014,515.61	12,865,228.44
等于：本金	10,009,930.76	12,859,334.26
加：应计利息	4,584.85	5,894.18
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	10,014,515.61	12,865,228.44

### 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		469,408,611.07	-	433,947,060.28	-35,461,550.79
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		469,408,611.07	-	433,947,060.28	-35,461,550.79
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		723,394,809.81	-	665,567,638.30	-57,827,171.51
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		723,394,809.81	-	665,567,638.30	-57,827,171.51

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 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投资。

##### 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投资。

#### 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	4,378.22	-
待摊费用	-	-
合计	4,378.22	-

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	54,936.78	89,400.09
其中：交易所市场	54,936.78	89,400.09
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	175,000.00	175,000.00
应付指数使用费	35,000.00	48,050.93
应退退补款	205,919.61	91,874.22
合计	470,856.39	404,325.24

#### 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	940,031,444.00	470,015,722.36
本期申购	218,000,000.00	109,000,000.14
本期赎回（以“-”号填列）	-544,000,000.00	-272,000,000.02
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	614,031,444.00	307,015,722.48

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

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	478,221,141.54	-269,347,158.02	208,873,983.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	478,221,141.54	-269,347,158.02	208,873,983.52

本期利润	-5,437,326.59	22,365,620.72	16,928,294.13
本期基金份额交易产生的变动数	-168,155,891.93	75,690,980.69	-92,464,911.24
其中：基金申购款	113,195,427.84	-43,233,910.15	69,961,517.69
金赎回款	-281,351,319.77	118,924,890.84	-162,426,428.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	304,627,923.02	-171,290,556.61	133,337,366.41

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	145,470.51	193,785.56
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	8,728.92	9,775.16
其他	4,960.22	3,095.48
合计	159,159.65	206,656.20

#### 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	-6,013,813.97	-52,651,488.57
股票投资收益——赎回	-2,276,081.25	-5,903,788.42

差价收入		
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	-8,289,895.22	-58,555,276.99

#### 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	639,913,746.23	537,340,074.71
减：卖出股票成本 总额	645,125,751.83	589,117,122.00
减：交易费用	801,808.37	874,441.28
买卖股票差价收 入	-6,013,813.97	-52,651,488.57

#### 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	434,426,428.95	202,005,801.81
减：现金支付赎回款 总额	286,579,875.95	140,995,620.81
减：赎回股票成本总 额	150,122,634.25	66,913,969.42
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-2,276,081.25	-5,903,788.42

#### 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	290.38	151.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	348,167.90	127,281.18
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	348,458.28	127,432.55

#### 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	2,260,057.37	687,464.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,911,500.00	560,000.00
减：应计利息总额	299.11	156.02
减：交易费用	90.36	27.56
买卖债券差价收入	348,167.90	127,281.18

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——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：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——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：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——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衍生工具收益——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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,582,439.65	5,333,873.52
其中：证券出借权益补偿收入	-	8,230.67
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,582,439.65	5,333,873.52

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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



1. 交易性金融资产	22,365,620.72	-104,265,500.26
股票投资	22,365,620.72	-104,265,500.26
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	22,365,620.72	-104,265,500.26

#### 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	-1,065,650.16	-4,680.49
合计	-1,065,650.16	-4,680.49

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：本基金本报告期内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	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	147,171.58	161,356.50
合计	322,171.58	336,356.50

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，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、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（“华泰柏瑞中证科技 100ETF 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（%）
中信证券	1,104,651,804.22	100.00	1,253,775,261.84	100.00

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 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 (%)
中信证券	161,320.00	100.00	54,936.78	100.00
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 (%)
中信证券	176,046.57	100.00	89,400.09	100.00

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,407,753.89	2,621,709.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	2,408.92
应支付基金管理人的净管理费	2,407,753.89	2,619,300.46

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	481,550.68	524,341.88

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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	6,540,848.00	3.10~3.40	3.22	6,658.50	1,765,111.00	829.00
中信证券	1,659,332.00	3.20~3.20	3.20	1,396.52	621,081.00	343.34
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
-	-	-~-	-	-	-	-

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自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 (%)

华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金联接基金	279,606,980.00	45.5363	710,860,880.00	75.6210
华泰证券股份有限公司	4,612,302.00	0.7512	6,831,004.00	0.7267
中信证券股份有限公司	1,442,091.00	0.2349	2,007,256.00	0.2135

#### 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

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

#### 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	10,780	1,078,000.00
中信证券股份有限公司	127089	晶澳转债	网上配售	7,184	718,400.00
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	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	688472	阿特斯	网下申购	18,015	199,966.50
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	47,608	270,889.52
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,028	147,025.76
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	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	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
中信证券	301157	华塑科技	网下申购	1,498	84,637.00
中信证券	603281	江瀚新材	网下申购	863	30,714.17
中信证券	688522	纳睿雷达	网下申购	4,299	200,677.32
中信证券	301373	凌玮科技	网下申购	2,764	93,229.72
中信证券	301439	泓淋电力	网下申购	4,932	98,590.68

中信证券	601133	柏诚股份	网下申购	3,684	42,955.44
中信证券	688539	高华科技	网下申购	4,854	185,519.88
中信证券	301293	三博脑科	网下申购	3,324	98,390.40
中信证券	603162	海通发展	网下申购	523	19,481.75
中信证券	601061	中信金属	网下申购	11,748	77,301.84
中信证券	001286	陕西能源	网下申购	37,667	361,603.20
中信证券	001367	海森药业	网下申购	549	24,419.52
中信证券	301170	锡南科技	网下申购	2,496	84,864.00
中信证券	301323	新莱福	网下申购	2,277	88,939.62
中信证券	688581	安杰思	网下申购	1,062	133,599.60
中信证券	001324	长青科技	网下申购	1,131	21,353.28
中信证券	688523	航天环宇	网下申购	4,717	103,113.62
中信证券	688610	埃科光电	网下申购	2,747	201,437.51
中信证券	688631	莱斯信息	网下申购	3,357	84,864.96
中信证券	688450	光格科技	网下申购	1,662	88,235.58
中信证券	301261	恒工精密	网下申购	1,973	72,803.70
中信证券	688563	航材股份	网下申购	3,263	257,744.37
中信证券	301371	敷尔佳	网下申购	2,705	150,614.40
中信证券	301559	中集环科	网下申购	4,919	119,138.18
中信证券	301558	三态股份	网下申购	14,578	106,856.74
中信证券	301517	陕西华达	网下申购	1,841	49,467.67
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
中信证券	301200	大族数控	网下申购	3,426	262,294.56
中信证券	688171	纬德信息	网下申购	2,821	80,906.28
中信证券	301117	佳缘科技	网下申购	2,616	122,428.80
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	3,136	178,375.68
中信证券	688223	晶科能源	网下申购	50,907	254,535.00
中信证券	001266	宏英智能	网下申购	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	网下申购	575	7,187.50
中信证券	301116	益客食品	网下申购	5,764	65,709.60
中信证券	603132	金徽股份	网下申购	1,342	14,493.60
中信证券	600938	中国海油	网上申购	4,000	43,200.00
中信证券	603209	兴通股份	网下申购	595	12,804.40
中信证券	603051	鹿山新材	网下申购	272	7,014.88
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
中信证券	688150	莱特光电	网下申购	5,626	124,053.30
中信证券	301269	华大九天	网下申购	5,206	170,184.14
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	688253	英诺特	网下申购	4,364	113,725.84

中信证券	301175	中科环保	网下申购	40,339	154,094.98
华泰联合证券	688353	华盛锂电	网下申购	2,233	219,615.55
中信证券	301302	华如科技	网下申购	3,646	189,701.38
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
中信证券	603235	天新药业	网下申购	572	21,095.36
中信证券	301112	信邦智能	网下申购	3,984	109,679.52
中信证券	688047	龙芯中科	网下申购	3,029	181,921.74
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
中信证券	001339	智微智能	网下申购	812	13,690.32
华泰联合证券	688351	微电生理	网下申购	10,946	180,718.46
中信证券	688041	海光信息	网下申购	11,068	398,448.00
中信证券	001330	博纳影业	网下申购	3,564	17,926.92
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35
中信证券	301296	新巨丰	网下申购	10,411	189,376.09
中信证券	688380	中微半导	网下申购	9,277	286,288.22
中信证券	688439	振华风光	网下申购	3,311	221,803.89
中信证券	301171	易点天下	网下申购	8,631	156,911.58
中信证券	688271	联影医疗	网下申购	2,872	315,575.36
中信证券	301349	信德新材	网下申购	1,144	158,878.72
华泰联合证券	301327	华宝新能	网下申购	2,054	487,825.00
中信证券	001322	箭牌家居	网下申购	1,595	20,224.60
中信证券	688114	华大智造	网下申购	2,257	196,765.26
中信证券	688252	天德钰	网下申购	5,201	112,757.68
华泰联合证券	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
中信证券	603151	邦基科技	网下申购	535	9,603.25
中信证券	688409	富创精密	网下申购	2,407	168,465.93
华泰联合证券	301339	通行宝	网下申购	9,127	171,405.06
中信证券	688432	有研硅	网下申购	20,044	198,636.04
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合证券	301290	东星医疗	网下申购	3,291	145,100.19
中信证券	688141	杰华特	网下申购	7,957	304,434.82
华泰联合证券	301277	新天地	网下申购	4,384	118,368.00
中信证券	301230	泓博医药	网下申购	2,687	107,480.00
中信证券	301165	锐捷网络	网下申购	7,237	234,334.06
中信证券	688525	佰维存储	网下申购	4,614	64,549.86
中信证券	123158	宙邦转债	网上配售	2,513	251,300.00
中信证券	688147	微纳米导	网下申购	6,293	152,353.53

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	2023 年 6 月	6 个月	新股锁定期内	38.13	28.36	603	22,992.39	17,101.08	-



	电气	21 日		期内							
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	271	15,089.28	10,184.18	-	
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	197	13,332.96	11,695.89	-	
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	392	14,880.32	11,912.88	-	
301459	丰茂股	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	-	

	份									
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	325	18,739.50	15,356.25	-
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	406	16,235.94	15,756.86	-
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	123	12,247.11	10,019.58	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定期内	2.66	4.45	6,637	17,654.42	29,534.65	-
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	2023	6个月	新股	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-

	德科技	年9月11日		锁定期内						
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	492	11,916.24	8,974.08	-
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	649	7,301.25	7,184.43	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	3,081	5,237.70	12,508.86	-
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	2023	6个月	新股	58.08	57.81	98	5,691.84	5,665.38	-

	加芯彩	年 10 月 31 日		锁定期内						
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	280	3,984.40	5,093.20	-
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	273	4,744.74	4,548.18	-
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	132	6,596.04	5,240.40	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	25.73	24.88	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	2023	6 个月	新股	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-

	格科技	年7月 17日		锁定 期内							
688548	广钢 气体	2023 年8月 8日	6个月	新股 锁定 期内	9.87	12.75	1,921	18,960.27	24,492.75	-	
688549	中巨 芯	2023 年8月 30日	6个月	新股 锁定 期内	5.18	8.09	2,705	14,011.90	21,883.45	-	
688563	航材 股份	2023 年7月 12日	6个月	新股 锁定 期内	78.99	60.49	327	25,829.73	19,780.23	-	
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	491	13,129.34	18,986.97	-	
688591	泰凌 微	2023 年8月 18日	6个月	新股 锁定 期内	24.98	28.02	647	16,162.06	18,128.94	-	
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	257	12,153.53	9,758.29	-	
688627	精	2023	6个月	新股	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-	

	智达	年7月11日		锁定期内						
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	333	10,639.35	17,399.25	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定期内	10.50	15.99	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	302	12,883.32	14,550.36	-
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	2023年9月20日	6个月	新股锁定期内	69.98	60.10	172	12,036.56	10,337.20	-

	博									
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等流通受限股票。

#### 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	000063	中兴通讯	2024年1月9日	26.48	2,300	60,904.00
2	000400	许继电气	2024年1月9日	21.96	2,100	46,116.00
3	000682	东方电	2024年1月10日-2024	8.05	24,000	193,200.0



		子	年 1 月 12 日			0
4	000821	京山轻 机	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 10 日	15.89	13,000	206,570.0 0
5	002020	京新药 业	2024 年 1 月 9 日	12.72	18,000	228,960.0 0
6	002063	远光软 件	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	6.18	23,500	145,230.0 0
7	002130	沃尔核 材	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 25 日	7.55	28,200	212,910.0 0
8	002152	广电运 通	2024 年 1 月 5 日	12.26	9,900	121,374.0 0
9	002156	通富微 电	2024 年 1 月 10 日	23.12	19,600	453,152.0 0
10	002212	天融信	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	9.78	7,200	70,416.00
11	002236	大华股 份	2024 年 1 月 9 日	18.45	1,200	22,140.00
12	002241	歌尔股 份	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 5 日	21.01	6,000	126,060.0 0
13	002262	恩华药 业	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 11 日	27.12	15,000	406,800.0 0
14	002396	星网锐 捷	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	18.07	4,600	83,122.00
15	002422	科伦药 业	2024 年 1 月 12 日	29.05	3,100	90,055.00
16	002745	木林森	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 12 日	8.66	27,000	233,820.0 0
17	002773	康弘药 业	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	18.44	4,800	88,512.00
18	002913	奥士康	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	30.65	3,000	91,950.00
19	300115	长盈精 密	2024 年 1 月 8 日	13.25	25,000	331,250.0 0
20	300118	东方日 升	2024 年 1 月 11 日	17.65	2,500	44,125.00
21	300219	鸿利智 汇	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 9 日	8.42	11,000	92,620.00
22	300418	昆仑万 维	2024 年 1 月 8 日	37.4	21,000	785,400.0 0
23	300482	万孚生 物	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 9 日	30.17	8,100	244,377.0 0
24	300638	广和通	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 2 日	19.03	13,000	247,390.0 0
25	300772	运达股	2024 年 1 月 8 日	10.64	10,000	106,400.0

		份				0
26	300866	安克创新	2024 年 1 月 1 日	88.6	6,000	531,600.00
27	300872	天阳科技	2024 年 1 月 3 日	13.68	1,300	17,784.00
28	301165	锐捷网络	2024 年 1 月 10 日	37.89	1,000	37,890.00
29	600062	华润双鹤	2024 年 1 月 10 日	18.6	12,000	223,200.00
30	600216	浙江医药	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	10.73	8,100	86,913.00
31	600267	海正药业	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 12 日	9.36	25,000	234,000.00
32	600268	国电南自	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	6.97	11,100	77,367.00
33	600312	平高电气	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	12.69	16,100	204,309.00
34	600420	国药现代	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 11 日	9.79	20,000	195,800.00
35	600487	亨通光电	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 11 日	11.94	43,900	524,166.00
36	601126	四方股份	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	14.16	12,000	169,920.00
37	603236	移远通信	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	53.75	2,000	107,500.00
38	603556	海兴电力	2024 年 1 月 11 日	29.03	5,000	145,150.00
39	688223	晶科能源	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 11 日	8.86	4,100	36,326.00
40	688278	特宝生物	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 12 日	52.35	4,000	209,400.00
41	688578	艾力斯	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 11 日	41.66	2,000	83,320.00
42	688608	恒玄科技	2024 年 1 月 2 日	154.27	1,000	154,270.00
43	688687	凯因科技	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 10 日	34.86	3,000	104,580.00
44	688739	成大生物	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 9 日	32.51	5,000	162,550.00
合计	-	-	-	-	485,700	8,038,898.00

## 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信证券开立于交通银行的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平

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

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

于 2023 年 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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	10,014,515.61	-	-	-	-	-	10,014,515.61
结算备付金	53,917.42	-	-	-	-	-	53,917.42
存出保证金	96,309.64	-	-	-	-	-	96,309.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-433,947,060.28	433,947,060.28
应收清算款	-	-	-	-	-	49,339.86	49,339.86
其他资产	-	-	-	-	-	4,378.22	4,378.22
资产总计	10,164,742.67	-	-	-	-	-434,000,778.36	444,165,521.03
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	179,715.81	179,715.81
应付托管费	-	-	-	-	-	35,943.14	35,943.14
应付清算款	-	-	-	-	-	3,125,916.80	3,125,916.80
其他负债	-	-	-	-	-	470,856.39	470,856.39
负债总计	-	-	-	-	-	3,812,432.14	3,812,432.14
利率敏感度缺口	10,164,742.67	-	-	-	-	-430,188,346.22	440,353,088.89
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	12,865,228.44	-	-	-	-	-	12,865,228.44
结算备付金	573,435.82	-	-	-	-	-	573,435.82
存出保证金	355,713.77	-	-	-	-	-	355,713.77
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-665,567,638.30	665,567,638.30
应收清算款	-	-	-	-	-	285,049.16	285,049.16
资产总计	13,794,378.03	-	-	-	-	-665,852,687.46	6679,647,065.49
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,014.40	1,014.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	293,349.96	293,349.96
应付托管费	-	-	-	-	-	58,670.01	58,670.01
其他负债	-	-	-	-	-	404,325.24	404,325.24
负债总计	-	-	-	-	-	757,359.61	757,359.61
利率敏感度缺口	13,794,378.03	-	-	-	-	-665,095,327.85	678,889,705.88

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	433,947,060.28	98.55	665,567,638.30	98.04
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	-	-	-1,014.40	0.00
合计	433,947,060.28	98.55	665,566,623.90	98.04

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证科技 100 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）
	中证科技 100 指数上升 5%	21,192,094.09	32,437,978.66
中证科技 100 指数下降 5%	-21,192,094.09	-32,437,978.66	

#### 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	432,959,723.08	663,283,971.79
第二层次	-	1,306,344.32
第三层次	987,337.20	977,322.19
合计	433,947,060.28	665,567,638.30

##### 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	-	977,322.19	977,322.19
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,781,693.71	1,781,693.71
转出第三层次	-	2,301,805.02	2,301,805.02
当期利得或损失总额	-	530,126.32	530,126.32
其中：计入损益的利得或损	-	530,126.32	530,126.32



失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	987,337.20	987,337.20
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	-	181,478.43	181,478.43
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	-	1,562,512.83	1,562,512.83
转出第三层次	-	602,751.03	602,751.03
当期利得或损失总额	-	17,560.39	17,560.39
其中：计入损益的利得或损失	-	17,560.39	17,560.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	977,322.19	977,322.19
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	-	25,713.32	25,713.32

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	987,337.20	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关

期内的股票					
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	977,322.19	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 178,961,517.83 元(2022 年度：493,875,840.04 元)，其中包括以股票支付的申购款 58,317,017.33 元和以现金支付的申购款 120,644,500.50 元(2022 年度：其中包括以股票支付的申购款 149,773,308.81 元和以现金支付的申购款 344,102,531.23 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	433,947,060.28	97.70
	其中：股票	433,947,060.28	97.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,068,433.03	2.27
8	其他各项资产	150,027.72	0.03
9	合计	444,165,521.03	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 8,038,898.00 元，占本基金期末资产净值的 1.83%。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 2,386,192.00 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	371,364,701.46	84.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,849,097.51	12.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	758,373.00	0.17
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	3,976,338.00	0.90

	合计	432,948,509.97	98.32
--	----	----------------	-------

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	877,890.66	0.20
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	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	7,184.43	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,362.57	0.01
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	0.01
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	998,550.31	0.23

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	000725	京东方 A	5,668,600	22,107,540.00	5.02
2	300750	宁德时代	134,097	21,892,676.22	4.97

3	002415	海康威视	625,531	21,718,436.32	4.93
4	300760	迈瑞医疗	74,200	21,562,520.00	4.90
5	600276	恒瑞医药	475,320	21,498,723.60	4.88
6	300274	阳光电源	176,800	15,485,912.00	3.52
7	600406	国电南瑞	682,748	15,238,935.36	3.46
8	000063	中兴通讯	541,120	14,328,857.60	3.25
9	000100	TCL 科技	3,192,200	13,726,460.00	3.12
10	600089	特变电工	857,370	11,831,706.00	2.69
11	002371	北方华创	44,635	10,967,265.85	2.49
12	300014	亿纬锂能	208,700	8,807,140.00	2.00
13	002241	歌尔股份	407,000	8,551,070.00	1.94
14	000661	长春高新	55,100	8,033,580.00	1.82
15	603019	中科曙光	198,800	7,850,612.00	1.78
16	688036	传音控股	54,912	7,599,820.80	1.73
17	600570	恒生电子	257,652	7,410,071.52	1.68
18	600745	闻泰科技	147,800	6,253,418.00	1.42
19	002236	大华股份	328,300	6,057,135.00	1.38
20	002422	科伦药业	200,600	5,827,430.00	1.32
21	002459	晶澳科技	280,600	5,814,032.00	1.32
22	688599	天合光能	184,457	5,262,558.21	1.20
23	002028	思源电气	100,900	5,250,836.00	1.19
24	300418	昆仑万维	140,000	5,236,000.00	1.19
25	300496	中科创达	60,400	4,835,624.00	1.10
26	300433	蓝思科技	337,700	4,457,640.00	1.01
27	600372	中航机载	318,218	4,194,113.24	0.95
28	002156	通富微电	179,700	4,154,664.00	0.94
29	002384	东山精密	225,100	4,092,318.00	0.93
30	600487	亨通光电	334,900	3,998,706.00	0.91
31	000009	中国宝安	338,700	3,976,338.00	0.90
32	002410	广联达	225,788	3,870,006.32	0.88
33	601877	正泰电器	176,600	3,798,666.00	0.86
34	002074	国轩高科	175,400	3,771,100.00	0.86
35	601615	明阳智能	298,600	3,744,444.00	0.85
36	002202	金风科技	453,500	3,628,000.00	0.82
37	300207	欣旺达	244,600	3,610,296.00	0.82
38	300003	乐普医疗	223,100	3,605,296.00	0.82
39	688099	晶晨股份	54,937	3,440,704.31	0.78
40	002600	领益智造	476,100	3,218,436.00	0.73
41	300866	安克创新	34,300	3,038,980.00	0.69
42	300454	深信服	42,000	3,036,180.00	0.69
43	688223	晶科能源	338,214	2,996,576.04	0.68
44	300601	康泰生物	110,300	2,994,645.00	0.68
45	300118	东方日升	155,100	2,737,515.00	0.62

46	002262	恩华药业	100,100	2,714,712.00	0.62
47	688002	睿创微纳	60,384	2,670,180.48	0.61
48	000997	新大陆	136,000	2,666,960.00	0.61
49	000400	许继电气	120,900	2,654,964.00	0.60
50	002152	广电运通	210,800	2,584,408.00	0.59
51	300001	特锐德	115,500	2,321,550.00	0.53
52	600521	华海药业	151,000	2,215,170.00	0.50
53	000513	丽珠集团	62,500	2,188,125.00	0.50
54	300558	贝达药业	41,900	2,159,945.00	0.49
55	002212	天融信	201,400	1,969,692.00	0.45
56	600380	健康元	158,026	1,964,263.18	0.45
57	300253	卫宁健康	269,200	1,935,548.00	0.44
58	300115	长盈精密	143,000	1,894,750.00	0.43
59	600498	烽火通信	111,300	1,852,032.00	0.42
60	603927	中科软	60,500	1,813,790.00	0.41
61	300624	万兴科技	18,800	1,778,480.00	0.40
62	002056	横店东磁	127,600	1,727,704.00	0.39
63	603236	移远通信	31,428	1,689,255.00	0.38
64	600312	平高电气	127,700	1,620,513.00	0.37
65	688608	恒玄科技	10,204	1,574,171.08	0.36
66	300482	万孚生物	48,800	1,472,296.00	0.33
67	002063	远光软件	238,000	1,470,840.00	0.33
68	002396	星网锐捷	80,800	1,460,056.00	0.33
69	688278	特宝生物	27,734	1,451,874.90	0.33
70	688578	艾力斯	34,228	1,425,938.48	0.32
71	300638	广和通	74,100	1,410,123.00	0.32
72	600267	海正药业	139,800	1,308,528.00	0.30
73	600062	华润双鹤	70,300	1,307,580.00	0.30
74	002745	木林森	150,100	1,299,866.00	0.30
75	002020	京新药业	101,900	1,296,168.00	0.29
76	002130	沃尔核材	171,200	1,292,560.00	0.29
77	603228	景旺电子	56,900	1,283,664.00	0.29
78	600216	浙江医药	114,800	1,231,804.00	0.28
79	300705	九典制药	35,200	1,169,696.00	0.27
80	000821	京山轻机	73,200	1,163,148.00	0.26
81	002773	康弘药业	62,300	1,148,812.00	0.26
82	002653	海思科	49,100	1,136,665.00	0.26
83	600420	国药现代	113,500	1,111,165.00	0.25
84	000682	东方电子	136,200	1,096,410.00	0.25
85	601126	四方股份	70,400	996,864.00	0.23
86	688349	三一重能	34,314	982,066.68	0.22
87	688739	成大生物	29,670	964,571.70	0.22
88	603556	海兴电力	33,100	960,893.00	0.22

89	688798	艾为电子	13,244	914,233.32	0.21
90	603859	能科科技	20,100	758,373.00	0.17
91	300772	运达股份	61,500	654,360.00	0.15
92	688819	天能股份	22,364	624,402.88	0.14
93	688687	凯因科技	17,028	593,596.08	0.13
94	002322	理工能科	44,400	568,320.00	0.13
95	300219	鸿利智汇	61,900	521,198.00	0.12
96	002913	奥士康	17,000	521,050.00	0.12
97	600268	国电南自	71,540	498,633.80	0.11
98	603367	辰欣药业	33,000	483,120.00	0.11
99	300872	天阳科技	35,200	481,536.00	0.11
100	301165	锐捷网络	10,000	378,900.00	0.09

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	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
2	301526	国际复材	6,637	29,534.65	0.01
3	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
4	688548	广钢气体	1,921	24,492.75	0.01
5	688549	中巨芯	2,705	21,883.45	0.00
6	688563	航材股份	327	19,780.23	0.00
7	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
8	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
9	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
10	688582	芯动联科	491	18,986.97	0.00
11	688591	泰凌微	647	18,128.94	0.00
12	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
13	688652	京仪装备	333	17,399.25	0.00
14	301291	明阳电气	603	17,101.08	0.00
15	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
16	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
17	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
18	301498	乖宝宠物	406	15,756.86	0.00
19	301486	致尚科技	325	15,356.25	0.00
20	688702	盛科通信	302	14,550.36	0.00
21	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
22	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
23	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
24	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
25	601096	宏盛华源	3,081	12,508.86	0.00
26	301456	盘古智能	392	11,912.88	0.00

27	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
28	301393	昊帆生物	197	11,695.89	0.00
29	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
30	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
31	301399	英特科技	293	11,213.11	0.00
32	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
33	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
34	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
35	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
36	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
37	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
38	688719	爱科赛博	172	10,337.20	0.00
39	301371	敷尔佳	271	10,184.18	0.00
40	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
41	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
42	301525	儒竞科技	123	10,019.58	0.00
43	688612	威迈斯	257	9,758.29	0.00
44	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
45	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
46	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
47	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
48	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
49	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
50	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
51	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
52	301559	中集环科	492	8,974.08	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	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
69	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00



70	601083	锦江航运	649	7,184.43	0.00
71	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
72	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
73	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
74	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
75	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
76	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
77	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
78	603062	麦加芯彩	98	5,665.38	0.00
79	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
80	603275	众辰科技	132	5,240.40	0.00
81	603107	上海汽配	280	5,093.20	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	603193	润本股份	273	4,548.18	0.00
85	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
86	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
87	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
88	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
89	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
90	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
91	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	000725	京东方 A	27,204,635.00	4.01
2	002475	立讯精密	24,966,207.06	3.68
3	600276	恒瑞医药	22,733,492.80	3.35
4	300750	宁德时代	15,691,803.54	2.31
5	600406	国电南瑞	14,650,443.34	2.16
6	300274	阳光电源	14,040,029.00	2.07
7	000100	TCL 科技	13,292,949.00	1.96
8	300760	迈瑞医疗	11,607,124.00	1.71
9	002049	紫光国微	10,608,600.85	1.56
10	002415	海康威视	9,878,654.33	1.46
11	300122	智飞生物	9,703,034.51	1.43
12	002179	中航光电	9,659,088.20	1.42
13	002241	歌尔股份	9,166,023.75	1.35
14	300014	亿纬锂能	8,648,293.00	1.27

15	002129	TCL 中环	8,099,768.27	1.19
16	000063	中兴通讯	7,694,407.00	1.13
17	300496	中科创达	6,988,982.00	1.03
18	688036	传音控股	6,832,681.77	1.01
19	600745	闻泰科技	6,699,581.00	0.99
20	300033	同花顺	6,345,138.00	0.93

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	000725	京东方 A	42,670,136.00	6.29
2	002230	科大讯飞	30,431,215.04	4.48
3	002475	立讯精密	27,852,314.83	4.10
4	002415	海康威视	24,761,287.00	3.65
5	002129	TCL 中环	24,381,368.34	3.59
6	300750	宁德时代	23,844,415.32	3.51
7	300760	迈瑞医疗	22,681,568.47	3.34
8	688981	中芯国际	15,358,801.56	2.26
9	000063	中兴通讯	14,419,744.45	2.12
10	300142	沃森生物	14,036,588.21	2.07
11	002241	歌尔股份	13,431,398.00	1.98
12	600406	国电南瑞	13,331,341.00	1.96
13	300122	智飞生物	13,275,037.68	1.96
14	601012	隆基绿能	12,795,507.60	1.88
15	300308	中际旭创	12,365,093.72	1.82
16	000977	浪潮信息	11,628,057.38	1.71
17	600438	通威股份	10,571,047.00	1.56
18	000661	长春高新	10,431,073.00	1.54
19	601138	工业富联	10,263,662.00	1.51
20	300496	中科创达	9,456,520.83	1.39

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	482,945,170.01
卖出股票收入（成交）总额	639,913,746.23

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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	96,309.64
2	应收清算款	49,339.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	4,378.22
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150,027.72

### 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	000063	中兴通讯	60,904.00	0.01	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	301487	盟固利	35,512.32	0.01	新股锁定期内
2	301526	国际复材	29,534.65	0.01	新股锁定期内
3	301348	蓝箭电子	27,321.41	0.01	新股锁定期内
4	688548	广钢气体	24,492.75	0.01	新股锁定期内
5	688549	中巨芯	21,883.45	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 (%)
4,155	147,781.33	139,263,956.00	22.68	195,160,508.00	31.78	279,606,980.00	45.54

### 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	招商局仁和人寿保险股份有限公司一分红	42,371,300.00	6.90

	产品 1 号		
2	招商局仁和人寿保险股份有限公司—传统产品 3 号	41,696,500.00	6.79
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	12,351,400.00	2.01
4	招商证券股份有限公司	9,852,303.00	1.60
5	方正证券股份有限公司	6,832,800.00	1.11
6	招商局仁和人寿保险股份有限公司—万能产品 4 号	5,781,700.00	0.94
7	招商局仁和人寿保险股份有限公司—万能产品 2 号	5,146,700.00	0.84
8	赵熹光	4,889,600.00	0.80
9	华泰证券股份有限公司	4,612,302.00	0.75
10	广发证券股份有限公司	2,897,000.00	0.47

### 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	65,600.00	0.0107

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年9月27日）基金份额总额	2,120,015,722.00
本报告期期初基金份额总额	940,031,444.00
本报告期基金总申购份额	218,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	544,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	614,031,444.00

## § 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

基金管理人的重大人事变动：

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。

本基金托管人的专门基金托管部门有如下重大人事变动：

自 2023 年 12 月 28 日起，孙沛涛先生任托管部行政负责人，吴俊文女士不再担任托管部行政负责人。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 55,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 5 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 (%)	
中信证券	5	1,104,651,804.22	100.00	161,320.00	100.00	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本报告期内，基金租用券商交易单元新增中信证券。

#### 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 (%)
中信证券	2,260,057.37	100.00	-	-	-	-

### 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
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	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
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 10 月 10 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 27 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 22 日
10	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
11	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
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	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
14	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
15	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	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 22 日



	告		
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 17 日
17	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
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
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 05 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 02 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 25 日
22	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 07 月 20 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 07 月 18 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 07 月 13 日
25	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
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 30 日
27	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
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 06 月 21 日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 20 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 17 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
31	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
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 06 月 03 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 05 月 30 日
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 05 月 27 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期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 13 日
36	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
37	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
38	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 26 日
39	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
40	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 13 日
41	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
42	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 01 日
43	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 31 日
44	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
45	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 22 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
46	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
47	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 11 日
48	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 02 日
49	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
50	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
51	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
52	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 01 月 30 日
53	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 01 月 21 日
54	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 01 月 18 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	20230101-20231231;	710,860,880.00	300,083,080.00	731,336,980.00	279,606,980.00	45.54
产品特有风险							
本基金报告期内有本基金联接基金持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回,可能导致巨额赎回,从而引发流动性风险,可能对基金产生如下影响:(1)延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时,投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支							

付或暂停赎回的风险。(2) 基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现, 这将对基金资产净值产生不利影响, 同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题, 这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。(3) 基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小, 基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形, 从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。(4) 基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向, 审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响, 同时将完善流动性风险管控机制, 最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日