

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 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 5 月 18 日（基金合同生效日）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	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
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	13
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	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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
§ 5 托管人报告	16
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	16
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	61

8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末上市基金前十名持有人	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	央企红利
场内简称	央企红利（扩位证券简称：央企红利 ETF）
基金主代码	561580
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 5 月 18 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	716,870,668.00 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	2023 年 5 月 30 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	1、股票的投资策略；2、存托凭证的投资策略；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	中证中央企业红利指数收益率
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	证券时报
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 5 月 18 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	21,409,706.48
本期利润	-14,163,805.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0180
本期加权平均净值利润率	-1.82%
本期基金份额净值增长率	-5.49%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	-39,391,248.78
期末可供分配基金份额利润	-0.0549
期末基金资产净值	677,479,419.22
期末基金份额净值	0.9451
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-5.49%

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

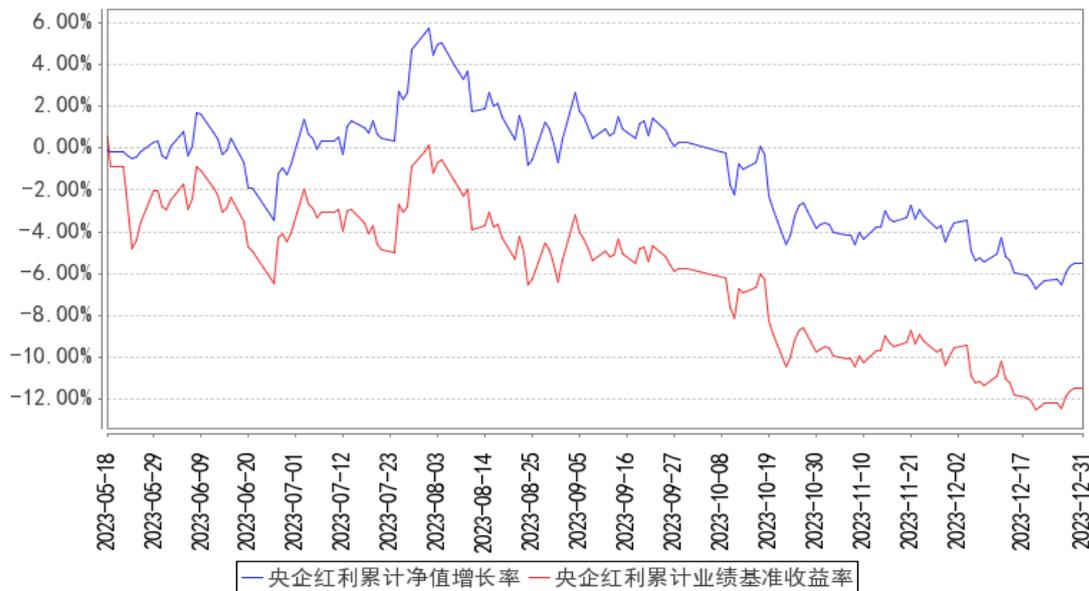
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.73%	0.66%	-6.06%	0.67%	0.33%	-0.01%

过去六个月	-4.80%	0.78%	-7.75%	0.80%	2.95%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-5.49%	0.78%	-11.46%	0.85%	5.97%	-0.07%

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

央企红利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

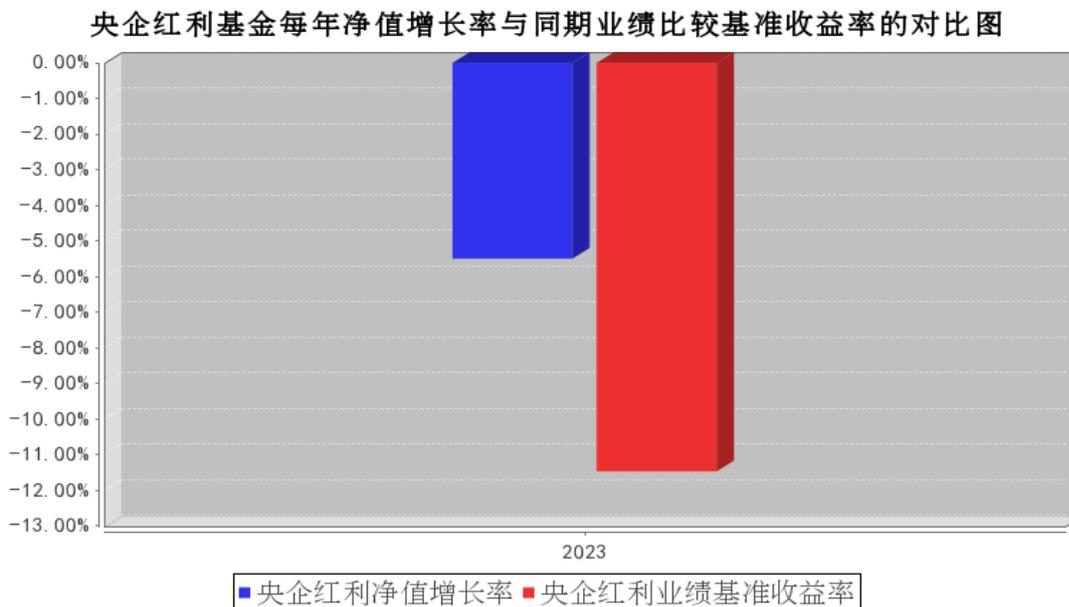


注：1、图示日期为 2023 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

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



注：本基金合同自 2023 年 5 月 18 日起生效，2023 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		
李茜	本基金的基金经理	2023 年 5 月 18 日	-	8 年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019 年 11 月至 2022 年 12 月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰

				<p>柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金和华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、计算机、电子的表现相对较好，涨跌幅分别为 25.75%、16.80%、8.97%和 7.25%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为-11.38%、-7.42%、-6.28%和-19.41%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-4.10%和-21.85%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

2023 年，在疫情对经济的边际影响逐渐退出以后，国内经济呈现渐进式复苏。在总量驱动、库存周期及中美经济周期错位的驱动下，市场呈现震荡走势，以结构性机会为主。中证央企红利全收益指数表现十分亮眼，上涨 6.91%，表现出较强的防御性。

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 0.039%，期间日跟踪误差为 0.069%，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 0.9451 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.49%，业绩比较基准收益率为-11.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，投资者会在政策预期与实际兑现之间博弈，市场波动仍然会震荡加剧，红利策略的防御属性仍将是资金的“避风港”。同时，国内经济在 2024 年将继续温和复苏，确定性较高的驱动因素在于国内积极财政政策的前置下，财政政策将对基建发力形成积极支撑。在私人部门缺乏加杠杆的情况下，政府部门加杠杆或成为信用周期的最主要抓手。红利策略在稳增长板块暴露较高，再次成为攻守兼备的标的的重要抓手。

同时，我们始终认为在“中特估”行情下，高分红特点的央国企是一条重要且清晰的投资思路。因此，以“股息率”为筛选标准的红利策略在央国企行情下具备天然优势，具有估值重塑的投资机会。我们认为“中特估”机会仍然是全年投资主线之一，为获得更强的 Beta，可以加大高股息策略的配置权重作为“杠铃配置”中的重要一头。当前中证央企红利指数处于右侧布局合理区间。从估值的角度看，当前处于 30%以下的估值分位数水平，属于合理偏低的位置，仍具有配置价值。

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，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4

次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。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基金份额净值低于面值。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-39,391,248.78 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”）在对华泰柏瑞中证中央企业红利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中央企业红利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中央企业红利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 22139 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	华泰柏瑞中证中央企业红利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	(一) 我们审计的内容 我们审计了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(以下简称“华泰柏瑞中证中央企业红利 ETF 基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，

	<p>2023 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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中央企业红利 ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于华泰柏瑞中证中央企业红利 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>华泰柏瑞中证中央企业红利 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中央企业红利 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中央企业红利 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中央企业红利 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、</p>

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

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证中央企业红利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
资产：		
货币资金	7.4.7.1	5,140,538.30
结算备付金		212,566.73
存出保证金		377,719.07
交易性金融资产	7.4.7.2	670,520,389.94
其中：股票投资		670,520,389.94

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		4,409,967.45
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	21,440.04
资产总计		680,682,621.53
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		172,313.30
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		179,530.71
应付赎回款		-
应付管理人报酬		233,688.10
应付托管费		46,737.58
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	2,570,932.62
负债合计		3,203,202.31
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	716,870,668.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-39,391,248.78
净资产合计		677,479,419.22
负债和净资产总计		680,682,621.53

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9451 元，基金份额总额 716,870,668.00 份。

2、本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 5 月 18 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-10,989,421.29
1. 利息收入		1,314,879.13
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,077,083.71
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		237,795.42
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,288,187.41
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-11,996,844.18
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	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	-
股利收益	7.4.7.19	33,285,031.59
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	-35,573,512.42
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	1,981,024.59
减：二、营业总支出		3,174,384.65
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,403,320.59
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	480,664.06
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		-
8. 其他费用	7.4.7.23	290,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,163,805.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,163,805.94
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-14,163,805.94

7.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2023年5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年5月18日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,999,870,668.00	-	-	1,999,870,668.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,283,000,000.00	-	-39,391,248.78	-1,322,391,248.78
（一）、综合收益总额	-	-	-14,163,805.94	-14,163,805.94
（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）	-1,283,000,000.00	-	-25,227,442.84	-1,308,227,442.84
其中：1. 基金申购款	348,000,000.00	-	-11,065,698.66	336,934,301.34
2. 基金赎回款	-1,631,000,000.00	-	-14,161,744.18	-1,645,161,744.18

	.00			8
(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	716,870,668.00	-	-39,391,248.78	677,479,419.22

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

华泰柏瑞中证中央企业红利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[2023]660号《关于准予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《华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,999,870,668.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第0296号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2023年5月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,999,870,668.00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”)自律监管决定书[2023]113号核准,本基金1,999,870,668.00份基金份额于2023年5月30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《华泰柏瑞中证中央企业红利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(含存托凭证)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、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、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及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。本基金的业绩比较基准为中证中央企业红利指数收益率。

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(以下简称“华泰柏瑞中央企业红利 ETF 发起式联接基金”)。华泰柏瑞中央企业红利 ETF 发起式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》、《华泰柏瑞中证中央企业红利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 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的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 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券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。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

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

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数

同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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
活期存款	5,140,538.30
等于：本金	5,138,051.08
加：应计利息	2,487.22

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	5,140,538.30

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	706,093,902.36	-	670,520,389.94	-35,573,512.42
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	706,093,902.36	-	670,520,389.94	-35,573,512.42

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
应收利息	-
其他应收款	21,440.04
待摊费用	-
合计	21,440.04

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
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	267,331.14
其中：交易所市场	267,331.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	190,000.00
应退退补款	2,113,601.48
合计	2,570,932.62

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,999,870,668.00	1,999,870,668.00
本期申购	348,000,000.00	348,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,631,000,000.00	-1,631,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	716,870,668.00	716,870,668.00

注：1. 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。

2. 本基金自从 2023 年 5 月 4 日至 2023 年 5 月 12 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,999,870,668.00 元，折合为 1,999,870,668.00 份基金份额。本基金设立募集期内认购资金未产生利息收入。

3. 根据《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基金合同》、《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招募说明书》及《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开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2023 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 5 月 29 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务和赎回业务自 2023 年 5 月 30 日起开始办理。

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
基金合同生效	-	-	-

日			
加： 会计 政策 变更	-	-	-
前 期差 错更 正	-	-	-
其他	-	-	-
本期 期初	-	-	-
本期 利润	21,409,706.48	-35,573,512.42	-14,163,805.94
本期 基金 份额 交易 产生 的变 动数	-12,630,577.57	-12,596,865.27	-25,227,442.84
其 中： 基金 申购 款	5,808,500.12	-16,874,198.78	-11,065,698.66
金赎 回款	-18,439,077.69	4,277,333.51	-14,161,744.18
本期 已分 配利 润	-	-	-
本期 末	8,779,128.91	-48,170,377.69	-39,391,248.78

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	895,459.33
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	170,464.92

其他	11,159.46
合计	1,077,083.71

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5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,851,974.18
股票投资收益——赎回差价收入	855,130.00
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	-11,996,844.18

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5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	540,581,939.27
减：卖出股票成本总额	550,253,130.70
减：交易费用	3,180,782.75
买卖股票差价收入	-12,851,974.18

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5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,645,161,744.18
减：现金支付赎回款总额	400,584,385.18
减：赎回股票成本总额	1,243,722,229.00
减：交易费用	-
赎回差价收入	855,130.00

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

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
	2023年5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	33,285,031.59
其中：证券出借权益补偿收入	763,540.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	33,285,031.59

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5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	-35,573,512.42
股票投资	-35,573,512.42
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	-35,573,512.42

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,469,304.17
其他	511,720.42
合计	1,981,024.59

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 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
注册登记费	100,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00
合计	290,400.00

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（“央企红利联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中信证券	2,713,854,418.02	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内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5月18日（基金合同生效日）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	2,505,941.65	100.00	267,331.14	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5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,403,320.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	262,817.78
应支付基金管理人的净管理费	2,140,502.81

注：自 2023 年 5 月 18 日起，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 2023年5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	480,664.06

注：自 2023 年 5 月 18 日起，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 X 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5月18日（基金合同生效日）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	103,815,756.00	1.80 ~ 3.50	1.88	54,941.04	35,158,749.00	9,164.23
中信证券	2,714,256.00	3.20 ~ 3.20	3.20	2,558.15	1,533,136.00	1,067.57

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，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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
华泰证券股份有限公司	4,723,260.00	0.6589
中信证券股份有限公司	52,279,366.00	7.2927

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 5 月 18 日（基金合同生效日）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	688472	阿特斯	网上申购	500	5,550.00
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	688602	康鹏科技	网下申购	10,653	92,254.98
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	688631	莱斯信息	网下申购	3,357	84,864.96
中信证券	688563	航材股份	网下申购	6,657	525,836.43
中信证券	688610	埃科光电	网下申购	2,747	201,437.51
中信证券	301261	恒工精密	网下申购	1,973	72,803.70
中信证券	301371	敷尔佳	网下申购	5,111	284,580.48
中信证券	688450	光格科技	网下申购	1,662	88,235.58
中信证券	301517	陕西华达	网下申购	1,841	49,467.67
中信证券	301558	三态股份	网下申购	14,578	106,856.74
中信证券	301559	中集环科	网下申购	6,459	156,436.98

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内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	2023年8月	6个月	新股锁定	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-

	电子	1 日		期内						
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股 锁定期内	55.68	37.58	512	28,508.16	19,240.96	-
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 汽车	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	171	17,026.47	13,929.66	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定期内	2.66	4.45	8,239	21,915.74	36,663.55	-
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	2023	6个月	新股	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-

	态股份	年9月21日		锁定期内						
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定期内	24.22	18.24	646	15,646.12	11,783.04	-
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	821	9,236.25	9,088.47	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	3,846	6,538.20	15,614.76	-
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	2023	6个月	新股	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-

	江 荣 泰	年7月 21日		锁 定 期 内							
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	179	8,944.63	7,106.30	-	
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	2,843	28,060.41	36,248.25	-	
688549	中 巨 芯	2023 年8月 30日	6个月	新 股 锁 定 期 内	5.18	8.09	3,779	19,575.22	30,572.11	-	
688563	航 材	2023 年7月	6个月	新 股 锁 定	78.99	60.49	666	52,607.34	40,286.34	-	

	股份	12 日		期内							
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	2023 年 7 月	6 个月	新股 锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-	

	安全	19 日		期内							
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	415	17,703.90	19,994.70	-	
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	000708	中信特钢	2024年1月4日-2024年1月12日	14.04	77,900	1,093,716.00
2	000717	中南股份	2024年1月4日-2024年1月12日	2.54	598,400	1,519,936.00
3	000778	新兴铸管	2024年1月4日-2024年1月12日	3.82	142,200	543,204.00
4	000830	鲁西化工	2024年1月4日-2024年1月12日	10.03	194,200	1,947,826.00
5	000877	天山股份	2024年1月4日-2024年1月12日	6.68	119,500	798,260.00
6	000928	中钢国际	2024年1月3日-2024年1月12日	5.83	83,200	485,056.00
7	001965	招商公路	2024年1月2日-2024年1月12日	9.77	202,100	1,974,517.00
8	001979	招商蛇口	2024年1月4日-2024年1月12日	9.53	124,500	1,186,485.00
9	002128	电投能源	2024年1月4日-2024年1月12日	14.27	55,700	794,839.00

10	003816	中国广核	2024年1月1日-2024年1月12日	3.11	176,100	547,671.00
11	600019	宝钢股份	2024年1月4日-2024年1月9日	5.93	509,800	3,023,114.00
12	600028	中国石化	2024年1月4日-2024年1月12日	5.58	610,300	3,405,474.00
13	600036	招商银行	2024年1月4日-2024年1月12日	27.82	18,000	500,760.00
14	600048	保利发展	2024年1月4日-2024年1月12日	9.9	119,200	1,180,080.00
15	600062	华润双鹤	2024年1月4日-2024年1月12日	18.6	11,800	219,480.00
16	600236	桂冠电力	2024年1月3日-2024年1月12日	5.54	295,000	1,634,300.00
17	600328	中盐化工	2024年1月1日-2024年1月12日	7.82	191,700	1,499,094.00
18	600390	五矿资本	2024年1月4日-2024年1月12日	4.68	82,100	384,228.00
19	600449	宁夏建材	2024年1月4日-2024年1月12日	17.93	51,600	925,188.00
20	600508	上海能源	2024年1月1日-2024年1月12日	13.86	96,500	1,337,490.00
21	600582	天地科技	2024年1月4日-2024年1月12日	5.44	113,800	619,072.00
22	600705	中航产融	2024年1月2日-2024年1月12日	3.11	560,200	1,742,222.00
23	600710	苏美达	2024年1月1日-2024年1月12日	7.09	104,900	743,741.00
24	600782	新钢股份	2024年1月1日-2024年1月12日	3.49	273,600	954,864.00
25	600808	马钢股份	2024年1月4日-2024年1月12日	2.72	272,500	741,200.00
26	600900	长江电力	2024年1月4日-2024年1月12日	23.34	55,900	1,304,706.00
27	600999	招商证券	2024年1月4日-2024年1月12日	13.64	17,200	234,608.00
28	601006	大秦铁路	2024年1月1日-2024年1月9日	7.21	468,900	3,380,769.00
29	601088	中国神华	2024年1月4日-2024年1月12日	31.35	23,700	742,995.00
30	601128	常熟银行	2024年1月4日-2024年1月12日	6.39	36,400	232,596.00
31	601186	中国铁建	2024年1月4日-2024年1月12日	7.61	133,300	1,014,413.00

32	601288	农业银行	2024年1月4日-2024年1月12日	3.64	745,000	2,711,800.00
33	601319	中国人保	2024年1月4日-2024年1月12日	4.84	49,600	240,064.00
34	601328	交通银行	2024年1月4日-2024年1月12日	5.74	493,100	2,830,394.00
35	601336	新华保险	2024年1月4日-2024年1月12日	31.13	36,800	1,145,584.00
36	601390	中国中铁	2024年1月4日-2024年1月12日	5.68	219,200	1,245,056.00
37	601398	工商银行	2024年1月4日-2024年1月12日	4.78	433,800	2,073,564.00
38	601598	中国外运	2024年1月1日-2024年1月12日	5.24	177,700	931,148.00
39	601658	邮储银行	2024年1月4日-2024年1月12日	4.35	322,900	1,404,615.00
40	601668	中国建筑	2024年1月4日-2024年1月12日	4.81	173,400	834,054.00
41	601766	中国中车	2024年1月4日-2024年1月12日	5.26	188,700	992,562.00
42	601818	光大银行	2024年1月4日-2024年1月12日	2.9	959,900	2,783,710.00
43	601857	中国石油	2024年1月4日-2024年1月12日	7.06	275,400	1,944,324.00
44	601866	中远海发	2024年1月4日-2024年1月12日	2.34	261,600	612,144.00
45	601898	中煤能源	2024年1月4日-2024年1月12日	9.69	159,800	1,548,462.00
46	601939	建设银行	2024年1月4日-2024年1月12日	6.51	368,500	2,398,935.00
47	601988	中国银行	2024年1月4日-2024年1月12日	3.99	747,700	2,983,323.00
48	601998	中信银行	2024年1月4日-2024年1月12日	5.29	412,100	2,180,009.00
49	688009	中国通号	2024年1月4日-2024年1月22日	4.38	237,700	1,041,126.00
合计	-	-	-	-	12,083,100	66,612,778.00

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。

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	5,140,538.30	-	-	-	-	-	5,140,538.30
结算备付金	212,566.73	-	-	-	-	-	212,566.73
存出保证金	377,719.07	-	-	-	-	-	377,719.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	670,520,389.94	670,520,389.94
应收清算款	-	-	-	-	-	4,409,967.45	4,409,967.45
其他资产	-	-	-	-	-	21,440.04	21,440.04
资产总计	5,730,824.10	-	-	-	-	674,951,797.43	680,682,621.53
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	172,313.30	172,313.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	233,688.10	233,688.10
应付托管费	-	-	-	-	-	46,737.58	46,737.58
应付清算款	-	-	-	-	-	179,530.71	179,530.71
其他负债	-	-	-	-	-	2,570,932.62	2,570,932.62
负债总计	-	-	-	-	-	3,203,202.31	3,203,202.31

利率敏感度缺口	5,730,824.10	-	-	-	-671,748,595.12	677,479,419.22
---------	--------------	---	---	---	-----------------	----------------

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	670,520,389.94	98.97
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	-172,313.30	-0.03
合计	670,348,076.64	98.95

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证中央企业红利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）
	中证中央企业红利指数上升5%	31,869,186.82
	中证中央企业红利指数下降5%	-31,869,186.82

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
第一层次	669,401,133.57
第二层次	-
第三层次	1,119,256.37
合计	670,520,389.94

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5月18日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	961,188.16	961,188.16
转出第三层次	-	18,607.18	18,607.18
当期利得或损失总额	-	176,675.39	176,675.39
其中：计入损益的利得或损失	-	176,675.39	176,675.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,119,256.37	1,119,256.37
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	-	173,205.49	173,205.49

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5月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间，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	1,119,256.37	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1962~2.1988	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。

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 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 336,934,301.34 元，其中包括以股票支付的申购款 261,842,803.00 元和以现金支付的申购款 75,091,498.34 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	670,520,389.94	98.51
	其中：股票	670,520,389.94	98.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,353,105.03	0.79
8	其他各项资产	4,809,126.56	0.71
9	合计	680,682,621.53	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 66,612,778.00 元，占本基金期末资产净值的 9.83%。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 36,691,885.00 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	96,287,720.62	14.21
C	制造业	183,284,606.22	27.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,489,824.00	4.65
E	建筑业	42,875,620.23	6.33
F	批发和零售业	12,356,452.00	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	59,283,108.16	8.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	220,226,670.00	32.51
K	房地产业	23,072,073.00	3.41
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	668,876,074.23	98.73

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	1,441,552.74	0.21
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	9,088.47	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,561.85	0.02
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	1,644,315.71	0.24

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	601088	中国神华	869,301	27,252,586.35	4.02
2	600028	中国石化	4,197,067	23,419,633.86	3.46
3	601006	大秦铁路	3,104,900	22,386,329.00	3.30
4	000830	鲁西化工	2,230,800	22,374,924.00	3.30
5	601328	交通银行	3,823,700	21,948,038.00	3.24
6	601288	农业银行	5,588,100	20,340,684.00	3.00
7	601988	中国银行	5,072,900	20,240,871.00	2.99
8	601398	工商银行	3,934,900	18,808,822.00	2.78
9	601818	光大银行	6,445,200	18,691,080.00	2.76
10	601939	建设银行	2,845,400	18,523,554.00	2.73
11	601998	中信银行	3,351,600	17,729,964.00	2.62
12	600019	宝钢股份	2,970,400	17,614,472.00	2.60

13	600782	新钢股份	4,477,600	15,626,824.00	2.31
14	601857	中国石油	2,100,000	14,826,000.00	2.19
15	601658	邮储银行	3,375,200	14,682,120.00	2.17
16	600808	马钢股份	5,141,000	13,983,520.00	2.06
17	601668	中国建筑	2,863,100	13,771,511.00	2.03
18	601866	中远海发	5,557,800	13,005,252.00	1.92
19	603013	亚普股份	719,400	12,431,232.00	1.83
20	600582	天地科技	2,282,900	12,418,976.00	1.83
21	600048	保利发展	1,254,200	12,416,580.00	1.83
22	600710	苏美达	1,742,800	12,356,452.00	1.82
23	601598	中国外运	2,313,284	12,121,608.16	1.79
24	600900	长江电力	519,300	12,120,462.00	1.79
25	001965	招商公路	1,204,700	11,769,919.00	1.74
26	000708	中信特钢	825,900	11,595,636.00	1.71
27	600036	招商银行	411,600	11,450,712.00	1.69
28	002128	电投能源	765,323	10,921,159.21	1.61
29	601898	中煤能源	1,124,680	10,898,149.20	1.61
30	688009	中国通号	2,433,572	10,659,045.36	1.57
31	001979	招商蛇口	1,118,100	10,655,493.00	1.57
32	600449	宁夏建材	593,524	10,641,885.32	1.57
33	600705	中航产融	3,408,800	10,601,368.00	1.56
34	600390	五矿资本	2,228,700	10,430,316.00	1.54
35	000778	新兴铸管	2,726,200	10,414,084.00	1.54
36	601336	新华保险	333,000	10,366,290.00	1.53
37	600236	桂冠电力	1,804,300	9,995,822.00	1.48
38	601766	中国中车	1,893,531	9,959,973.06	1.47
39	000928	中钢国际	1,692,281	9,865,998.23	1.46
40	601390	中国中铁	1,721,500	9,778,120.00	1.44
41	000717	中南股份	3,733,800	9,483,852.00	1.40
42	601186	中国铁建	1,243,100	9,459,991.00	1.40
43	003816	中国广核	3,014,000	9,373,540.00	1.38
44	600328	中盐化工	1,168,110	9,134,620.20	1.35
45	600508	上海能源	647,200	8,970,192.00	1.32
46	000877	天山股份	1,336,671	8,928,962.28	1.32
47	601319	中国人保	1,832,600	8,869,784.00	1.31
48	600999	招商证券	650,100	8,867,364.00	1.31
49	601128	常熟银行	1,357,700	8,675,703.00	1.28
50	600062	华润双鹤	431,000	8,016,600.00	1.18

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	301291	明阳电气	12,054	341,851.44	0.05
2	688657	浩辰软件	1,008	82,656.17	0.01
3	603270	金帝股份	1,943	59,431.70	0.01
4	603193	润本股份	3,022	54,479.40	0.01
5	603075	热威股份	1,812	43,802.52	0.01
6	688563	航材股份	666	40,286.34	0.01
7	301526	国际复材	8,239	36,663.55	0.01
8	688548	广钢气体	2,843	36,248.25	0.01
9	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
10	688549	中巨芯	3,779	30,572.11	0.00
11	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
12	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
13	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
14	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
15	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
16	688702	盛科通信	415	19,994.70	0.00
17	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
18	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
19	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
20	301371	敷尔佳	512	19,240.96	0.00
21	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
22	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
23	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
24	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
25	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
26	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
27	601096	宏盛华源	3,846	15,614.76	0.00
28	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
29	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
30	301525	儒竞科技	171	13,929.66	0.00
31	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
32	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
33	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
34	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
35	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
36	301559	中集环科	646	11,783.04	0.00
37	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
38	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
39	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
40	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
41	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
42	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
43	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00

44	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
45	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
46	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
47	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
48	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
49	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
50	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
51	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
52	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
53	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
54	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
55	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
56	601083	锦江航运	821	9,088.47	0.00
57	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
58	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
59	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
60	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
61	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
62	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
63	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
64	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
65	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
66	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
67	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
68	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
69	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
70	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
71	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
72	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
73	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
74	603275	众辰科技	179	7,106.30	0.00
75	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
76	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
77	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
78	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
79	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
80	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
81	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
82	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
83	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
84	001326	联域股份	99	4,815.36	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	115,253,374.16	17.01
2	601818	光大银行	75,348,941.00	11.12
3	601328	交通银行	75,055,833.00	11.08
4	601006	大秦铁路	70,546,013.42	10.41
5	601988	中国银行	69,557,404.20	10.27
6	601288	农业银行	65,852,235.00	9.72
7	000830	鲁西化工	64,788,071.00	9.56
8	002128	电投能源	64,543,613.66	9.53
9	601998	中信银行	59,333,926.29	8.76
10	600019	宝钢股份	56,347,146.00	8.32
11	601398	工商银行	55,573,437.00	8.20
12	601939	建设银行	54,148,596.00	7.99
13	600449	宁夏建材	47,552,617.26	7.02
14	601658	邮储银行	46,438,395.00	6.85
15	600808	马钢股份	42,441,541.00	6.26
16	601857	中国石油	42,398,547.00	6.26
17	001979	招商蛇口	42,235,964.00	6.23
18	000877	天山股份	41,178,894.69	6.08
19	000778	新兴铸管	40,426,952.00	5.97
20	603013	亚普股份	39,784,057.05	5.87
21	000717	中南股份	38,810,837.59	5.73
22	601668	中国建筑	37,333,022.00	5.51
23	688009	中国通号	36,983,210.25	5.46
24	600720	祁连山	35,103,977.60	5.18
25	601336	新华保险	35,040,815.00	5.17
26	600048	保利发展	35,011,124.06	5.17
27	600710	苏美达	34,652,942.00	5.11
28	600970	中材国际	34,481,603.00	5.09
29	601866	中远海发	33,669,003.00	4.97
30	000898	鞍钢股份	33,584,933.00	4.96
31	601598	中国外运	33,553,487.52	4.95
32	000708	中信特钢	33,512,278.43	4.95

33	600582	天地科技	33,389,820.00	4.93
34	600705	中航产融	33,272,440.00	4.91
35	601390	中国中铁	33,226,340.00	4.90
36	002419	天虹股份	32,002,993.00	4.72
37	003816	中国广核	31,816,928.00	4.70
38	601766	中国中车	31,061,993.26	4.58
39	600390	五矿资本	30,094,194.00	4.44
40	600900	长江电力	29,378,954.00	4.34
41	000069	华侨城 A	29,343,230.00	4.33
42	600036	招商银行	29,114,551.00	4.30
43	600236	桂冠电力	28,846,440.53	4.26
44	000883	湖北能源	28,771,660.00	4.25
45	601898	中煤能源	24,401,752.20	3.60
46	601186	中国铁建	23,500,293.00	3.47
47	000928	中钢国际	21,338,305.97	3.15
48	601088	中国神华	20,996,390.80	3.10
49	000059	华锦股份	19,725,799.00	2.91
50	600409	三友化工	19,694,430.00	2.91
51	000617	中油资本	15,872,201.00	2.34

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002128	电投能源	53,130,295.56	7.84
2	000830	鲁西化工	41,809,255.88	6.17
3	000898	鞍钢股份	33,166,914.00	4.90
4	002419	天虹股份	30,977,459.00	4.57
5	000877	天山股份	30,094,248.46	4.44
6	001979	招商蛇口	29,796,558.02	4.40
7	000928	中钢国际	29,702,160.68	4.38
8	000778	新兴铸管	29,281,988.61	4.32
9	000717	中南股份	29,254,361.00	4.32
10	000883	湖北能源	27,668,981.00	4.08
11	000069	华侨城 A	26,845,409.50	3.96
12	000617	中油资本	22,754,313.99	3.36
13	003816	中国广核	22,050,117.00	3.25
14	000708	中信特钢	21,341,540.10	3.15
15	000059	华锦股份	19,383,521.08	2.86
16	600028	中国石化	13,403,950.00	1.98
17	600720	祁连山	9,532,752.00	1.41
18	601818	光大银行	8,635,867.00	1.27
19	600449	宁夏建材	7,295,308.00	1.08

20	600970	中材国际	7,055,103.56	1.04
----	--------	------	--------------	------

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	2,182,880,696.06
卖出股票收入（成交）总额	540,581,939.27

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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行（601988）在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，建设银行（601939）在报告编制日前一年内曾受到

中国银保监会的处罚。

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

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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	377,719.07
2	应收清算款	4,409,967.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	21,440.04
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,809,126.56

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	600028	中国石化	3,405,474.00	0.50	转融通证券出借
2	601006	大秦铁路	3,380,769.00	0.50	转融通证券出借
3	601988	中国银行	2,983,323.00	0.44	转融通证券出借
4	601328	交通银行	2,830,394.00	0.42	转融通证券出借
5	601818	光大银行	2,783,710.00	0.41	转融通证券出借
6	601288	农业银行	2,711,800.00	0.40	转融通证券出借
7	601939	建设银行	2,398,935.00	0.35	转融通证券出借
8	601398	工商银行	2,073,564.00	0.31	转融通证券出借
9	000830	鲁西化工	1,947,826.00	0.29	转融通证券出借
10	601088	中国神华	742,995.00	0.11	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	301291	明阳电气	34,202.16	0.01	新股锁定期内
2	688657	浩辰软件	7,901.23	0.00	新股锁定期内
3	603270	金帝股份	5,768.10	0.00	新股锁定期内
4	603193	润本股份	5,047.98	0.00	新股锁定期内
5	603075	热威股份	4,242.42	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 (%)
14,025	51,113.77	265,271,220.00	37.00	451,599,448.00	63.00	0.00	0.00

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	广发证券股份有限公司	58,010,046.00	8.09
2	中信证券股份有限公司	52,279,366.00	7.29
3	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	19,245,472.00	2.68
4	招商证券股份有限公司	18,618,594.00	2.60
5	中信建投证券有限责任公司	14,286,449.00	1.99
6	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	14,139,500.00	1.97

7	中量投资管理有限公司—中量投尊享1号私募证券投资基金	10,500,000.00	1.46
8	海通证券股份有限公司	10,347,042.00	1.44
9	浙商证券股份有限公司	10,144,836.00	1.42
10	东北证券股份有限公司	8,457,000.00	1.18

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年5月18日）基金份额总额	1,999,870,668.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	348,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,631,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	716,870,668.00

§ 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 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 1 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	2,713,854,418.02	100.00	2,505,941.65	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、上述交易单元均系本报告期内租用。

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	-	-	-	-	-	-

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	关于同意中信证券股份有限公司为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提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月27日
2	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
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月23日
4	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
5	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12月13日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
6	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
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	关于同意浙商证券股份有限公司为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提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 10 月 11 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 10 月 10 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 27 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 22 日
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
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
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 17 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 11 日

	公告		
20	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
21	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
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
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 25 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 18 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 13 日
26	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
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	关于同意兴业证券股份有限公司为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提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 09 日
30	关于同意海通证券股份有限公司为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提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 06 日
31	关于同意华泰证券股份有限公司为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提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 31 日
32	关于同意方正证券股份有限公司为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提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 30 日

33	关于同意广发证券股份有限公司为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提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 30 日
34	关于同意招商证券股份有限公司为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提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 30 日
35	关于同意中信建投证券股份有限公司为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提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 30 日
36	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上市交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 30 日
37	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上市交易提示性公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 30 日
38	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开放日常申购、赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 25 日
39	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上市交易公告书提示性公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 25 日
40	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基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 19 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