

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券
投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
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
§ 8 投资组合报告	75

8.1 期末基金资产组合情况	75
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	76
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	77
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	91
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	93
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	93
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	93
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	93
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	93
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
8.12 投资组合报告附注	94
§ 9 基金份额持有人信息	95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
9.2 期末上市基金前十名持有人	95
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
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	96
§ 10 开放式基金份额变动	96
§ 11 重大事件揭示	96
11.1 基金份额持有人大会决议	96
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	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	97
11.4 基金投资策略的改变	97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	97
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	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	97
11.8 其他重大事件	101
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	104
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	104
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	104
§ 13 备查文件目录	105
13.1 备查文件目录	105
13.2 存放地点	105
13.3 查阅方式	105

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
场内简称	ETF500（扩位证券简称：中证 500 指数 ETF）
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	388,429,801.00 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	2015 年 6 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	葛海蛟

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 华泰柏瑞基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 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	-4,284,655.33	-6,530,895.79	116,298,472.05
本期利润	-21,774,900.91	-102,748,323.06	117,052,492.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0640	-0.3129	0.3680
本期加权平均净值利润率	-4.01%	-19.31%	21.91%
本期基金份额净值增长率	-4.14%	-17.17%	22.80%
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	-203,606,418.17	-153,803,087.91	-41,241,709.05
期末可供分配基金份额利润	-0.5242	-0.4599	-0.1382
期末基金资产	577,688,400.33	518,875,141.23	559,025,460.53

产净值			
期末基金份额净值	1.4872	1.5515	1.8732
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	-24.62%	-21.36%	-5.05%

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。

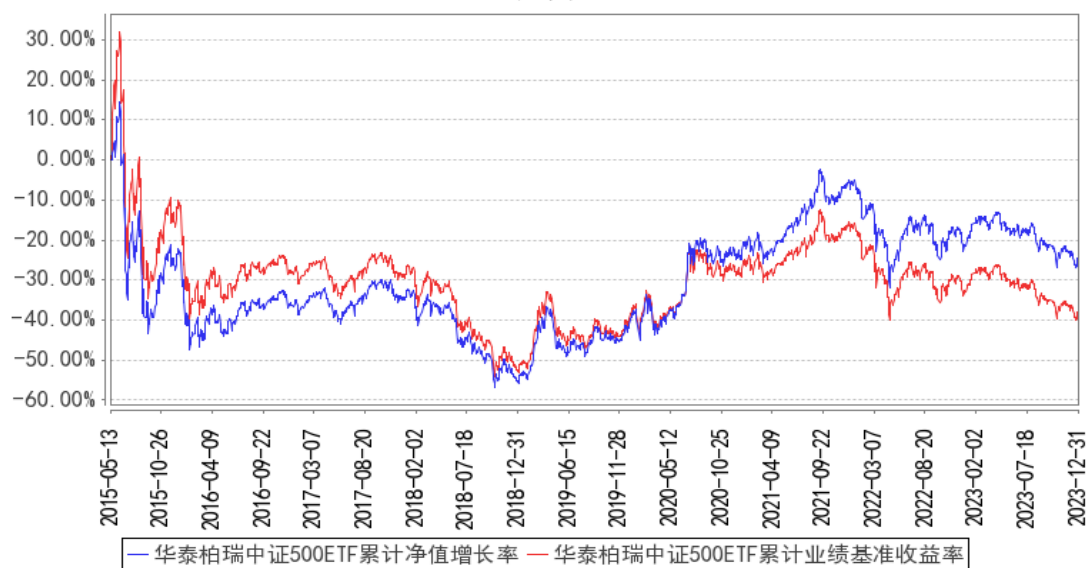
3.2 基金净值表现

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	-4.23%	0.86%	-4.60%	0.86%	0.37%	0.00%
过去六个月	-8.19%	0.85%	-9.49%	0.86%	1.30%	-0.01%
过去一年	-4.14%	0.82%	-7.42%	0.82%	3.28%	0.00%
过去三年	-2.50%	1.08%	-14.73%	1.08%	12.23%	0.00%
过去五年	67.93%	1.28%	30.26%	1.29%	37.67%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-24.62%	1.57%	-37.92%	1.59%	13.30%	-0.02%

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

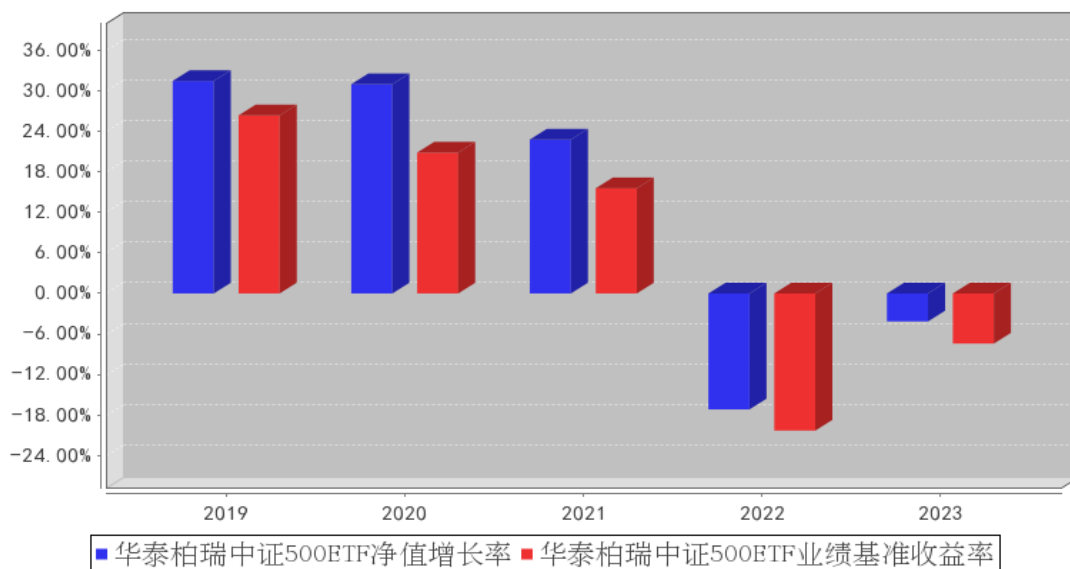
华泰柏瑞中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞基

本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持

有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞致远混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞益享债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦合债券型证券投资基金、华泰柏瑞祥泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞科技创新混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2023 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 3801.46 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2015年5月13日	-	22年	<p>复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰</p>

					<p>柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、计算机、电子的表现相对较好，涨跌幅分别为 25.75%、16.80%、8.97%和 7.25%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为-11.38%、-7.42%、-6.28%和-19.41%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-4.10%和-21.85%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

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

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.020%，期间日跟踪误差为 0.029%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4872 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.14%，业绩比较基准收益率为-7.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先合规性设置，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。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 500 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

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22209 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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500 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</p>

	<p>实务操作编制，公允反映了华泰柏瑞中证 500 ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证 500 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 500 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 500 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 500 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 500 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</p>

	<p>结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞中证 500 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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	9,693,346.18	11,214,820.94
结算备付金		8,013,161.97	8,217,161.09
存出保证金		2,128,670.68	2,650,355.06
交易性金融资产	7.4.7.2	557,967,592.01	496,935,362.39
其中：股票投资		557,931,190.89	496,839,361.13
基金投资		-	-
债券投资		36,401.12	96,001.26
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		282,371.24	243,389.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	18,392.79	1,036.11
资产总计		578,103,534.87	519,262,124.89
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	464.10
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		72,137.29	67,108.22
应付托管费		24,045.77	22,369.43
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	318,951.48	297,041.85
负债合计		415,134.54	386,983.66
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	781,294,818.50	672,678,229.14
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-203,606,418.17	-153,803,087.91
净资产合计		577,688,400.33	518,875,141.23
负债和净资产总计		578,103,534.87	519,262,124.89

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4872 元，基金份额总额 388,429,801.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 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	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
一、营业总收入		-20,341,881.19	-101,342,889.52
1. 利息收入		294,634.16	251,379.33
其中：存款利息收入	7.4.7.13	175,896.29	172,309.96
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		118,737.87	79,069.37
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,172,718.32	-5,862,915.77
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-9,972,900.84	-12,447,482.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	110,108.09	250,618.90
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	-1,488,222.22	-2,243,049.21
股利收益	7.4.7.19	8,178,296.65	8,576,996.61
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	-17,490,245.58	-96,217,427.27
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	26,448.55	486,074.19
减：二、营业总支出		1,433,019.72	1,405,433.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	814,243.36	796,547.06
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	271,414.35	265,515.68
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		840.45	0.84
8. 其他费用	7.4.7.23	346,521.56	343,369.96
三、利润总额（亏损总额		-21,774,900.91	-102,748,323.06

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-21,774,900.91	-102,748,323.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-21,774,900.91	-102,748,323.06

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 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	672,678,229.14	-	-153,803,087.91	518,875,141.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	672,678,229.14	-	-153,803,087.91	518,875,141.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	108,616,589.36	-	-49,803,330.26	58,813,259.10
(一)、综合收益总额	-	-	-21,774,900.91	-21,774,900.91
(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)	108,616,589.36	-	-28,028,429.35	80,588,160.01
其中：1. 基金申购款	187,061,903.90	-	-41,963,903.06	145,098,000.84
2. 基金赎回款	-78,445,314.54	-	13,935,473.71	-64,509,840.83
(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	781,294,818.50	-	-203,606,418.17	577,688,400.33
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	600,267,169.58	-	-41,241,709.05	559,025,460.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	600,267,169.58	-	-41,241,709.05	559,025,460.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	72,411,059.56	-	-112,561,378.86	-40,150,319.30
（一）、综合收益总额	-	-	-102,748,323.06	-102,748,323.06
（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）	72,411,059.56	-	-9,813,055.80	62,598,003.76
其中：1. 基金申购款	311,769,839.84	-	-57,618,928.54	254,150,911.30
2. 基金赎回款	-239,358,780.28	-	47,805,872.74	-191,552,907.54
（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	672,678,229.14	-	-153,803,087.91	518,875,141.23

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 500 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[2015]508 号《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 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 873,771,921.00 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(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 48,140.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2015 年 6 月 3 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.49716235，并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意，本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证

监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业/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、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2019 年 10 月 16 日起，新增投资范围：本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和

重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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	9,693,346.18		11,214,820.94
等于：本金	9,692,284.92		11,213,701.07	
加：应计利息	1,061.26		1,119.87	
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	9,693,346.18		11,214,820.94	

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	636,749,027.16	-	557,931,190.89	-78,817,836.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	36,400.00	1.12	36,401.12
	银行间市场	-	-	-
	合计	36,400.00	1.12	36,401.12
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	636,785,427.16	1.12	557,967,592.01	-78,817,836.27
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	557,566,191.82	-	496,839,361.13	-60,726,830.69
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	96,000.00	1.26	96,001.26	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	96,000.00	1.26	96,001.26	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		557,662,191.82	1.26	496,935,362.39	-60,726,830.69

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	17,563,840.00	-	-	-
其中：股指期货投资	17,563,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	17,563,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	19,635,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	19,635,960.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	19,635,960.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2403	中证 500 股指期货 2403	16.00	17,326,720.00	-237,120.00
合计				-237,120.00
减：可抵销期货暂收款				-237,120.00
净额				-

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

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

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	18,392.79	1,036.11
待摊费用	-	-
合计	18,392.79	1,036.11

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	95,995.65	77,652.70
其中：交易所市场	95,995.65	77,652.70
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
应付指数使用费	42,955.83	39,389.15
合计	318,951.48	297,041.85

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	334,429,801.00	672,678,229.14
本期申购	93,000,000.00	187,061,903.90
本期赎回（以“-”号填列）	-39,000,000.00	-78,445,314.54
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	388,429,801.00	781,294,818.50

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	93,749,152.46	-247,552,240.37	-153,803,087.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	93,749,152.46	-247,552,240.37	-153,803,087.91
本期利润	-4,284,655.33	-17,490,245.58	-21,774,900.91
本期基金份额交易产生的变动数	15,293,437.74	-43,321,867.09	-28,028,429.35
其中：基金申购款	26,302,004.97	-68,265,908.03	-41,963,903.06
基金赎回款	-11,008,567.23	24,944,040.94	13,935,473.71
本期已分配利润	-	-	-
本期	104,757,934.87	-308,364,353.04	-203,606,418.17

末			
---	--	--	--

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	37,541.56	36,312.14
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	137,863.52	135,156.12
其他	491.21	841.70
合计	175,896.29	172,309.96

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,850,170.66	-9,043,547.41
股票投资收益——赎回差价收入	-1,122,730.18	-3,403,934.66
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	-9,972,900.84	-12,447,482.07

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	183,953,387.69	281,332,301.94
减：卖出股票成本总额	192,385,090.78	289,779,740.87
减：交易费用	418,467.57	596,108.48
买卖股票差价收入	-8,850,170.66	-9,043,547.41

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	64,509,840.83	191,552,907.54
减：现金支付赎回款总额	33,974,728.83	98,541,548.54
减：赎回股票成本总额	31,657,842.18	96,415,293.66
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-1,122,730.18	-3,403,934.66

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	81.60	252.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	110,026.49	250,366.36
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	110,108.09	250,618.90

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	571,134.17	1,451,484.95

券到期兑付)成交总额		
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	461,000.00	1,200,800.00
减:应计利息总额	84.83	270.68
减:交易费用	22.85	47.91
买卖债券差价收入	110,026.49	250,366.36

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注:本基金本报告期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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-1,488,222.22	-2,243,049.21

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利 收益	8,178,296.65	8,576,996.61
其中：证券出借权益补 偿收入	26,425.80	19,622.07
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	8,178,296.65	8,576,996.61

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-18,091,005.58	-95,076,787.27
股票投资	-18,091,005.58	-95,066,719.87
债券投资	-	-10,067.40
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	600,760.00	-1,140,640.00
权证投资	-	-
股指期货	600,760.00	-1,140,640.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-17,490,245.58	-96,217,427.27

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	26,448.55	486,074.19
合计	26,448.55	486,074.19

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	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	162,848.74	159,309.41
银行划款手续费	3,338.97	3,901.28
存托服务费	333.85	159.27
合计	346,521.56	343,369.96

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东

苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500 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1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	79,978,601.18	19.95	6,271,790.15	1.07

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（%）
华泰证券	22,778.69	9.42	19,638.53	20.46
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	871.54	0.42	680.57	0.88

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	814,243.36	796,547.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	814,243.36	796,547.06

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	271,414.35	265,515.68

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	17,163,092.00	15,559.62	-	-

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	21,373,240.00	1.80~3.60	3.02	20,846.01	5,759,543.00	3,756.39
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	10,347,930.00	3.40~3.40	3.40	18,942.73	-	-

注：上年度可比期间数据，已根据中国证监会于 2024 年 1 月颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》的格式要求调整披露信息。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	159,845,989.00	41.1518	155,921,989.00	46.6232
华泰证券股份有限公司	488,171.00	0.1257	2,968,892.00	0.8877

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,693,346.18	37,541.56	11,214,820.94	36,312.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	110095	双良转债	网上配售	1,190	119,000.00
华泰联合证券	113066	平煤转债	网上配售	1,290	129,000.00
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	20,311	225,452.10
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	688469	中芯集成	网下申购	59,337	337,627.53
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	688602	康鹏科技	网下申购	10,653	92,254.98
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	688693	锆威特	网下申购	1,773	72,391.59
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	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
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	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
中银国际证券	601112	宏盛华源	网下申购	39,171	66,590.70
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	3,261	185,485.68
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40

华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
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	688353	华盛锂电	网下申购	2,451	241,055.85
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	688253	英诺特	网下申购	4,364	113,725.84
华泰联合证券	688351	微电生理	网下申购	10,946	180,718.46
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35
华泰联合证券	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合证券	301327	华宝新能	网下申购	2,054	487,825.00
华泰联合证券	301339	通行宝	网下申购	9,127	171,405.06
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合证券	301290	东星医疗	网下申购	3,291	145,100.19
华泰联合证券	301277	新天地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合证券	113659	莱克转债	网上配售	190	19,000.00

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

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	2023 年 12 月	6 个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-

	新材	月 14 日		期内						
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	692	26,385.96	19,625.12	-
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	294	16,369.92	11,048.52	-
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	2023	6 个月	新股	67.68	59.37	223	15,092.64	13,239.51	-

	帆生物	年7月5日		锁定期内						
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	369	21,276.54	17,435.25	-
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	2023年8月	6个月	新股锁定	39.99	38.81	450	17,995.50	17,464.50	-

	宠物	9 日		期内						
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	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	-

	学									
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	144	14,338.08	11,730.24	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定期内	2.66	4.45	8,807	23,426.62	39,191.15	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定期内	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定期内	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定期内	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定期内	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定期内	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股锁定期内	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定期内	24.22	18.24	616	14,919.52	11,235.84	-
301566	达利凯	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	-

	普	日								
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	868	9,765.00	9,608.76	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定期内	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定期内	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定期内	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定期内	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定期内	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋	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	-

	白									
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	150	7,495.50	5,955.00	-
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	2,128	21,003.36	27,132.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定期内	5.18	8.09	3,220	16,679.60	26,049.80	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股锁定期内	78.99	60.49	372	29,384.28	22,502.28	-
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	559	14,947.66	21,616.53	-
688591	泰	2023	6个月	新股	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-

	凌微	年8月18日		锁定期内						
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	275	13,004.75	10,441.75	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定期内	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股锁定期内	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定期内	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定期内	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定期内	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-

688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定期内	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股锁定期内	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锴威特	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	367	15,656.22	17,682.06	-
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	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127102	浙建转债	2023年12月25日	1个月	配债未上市	100.00	100.00	364	36,401.12	36,401.12	-

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	000021	深科技	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 10 日	16.21	14,000	226,940.00
2	000039	中集集团	2024 年 1 月 10 日	7.65	1,400	10,710.00
3	000066	中国长城	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 2 日	10.12	23,100	233,772.00
4	000155	川能动力	2024 年 1 月 10 日	13.29	11,000	146,190.00
5	000401	冀东水泥	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 9 日	6.39	10,000	63,900.00
6	000423	东阿阿胶	2024 年 1 月 2 日	49.32	2,800	138,096.00
7	000537	中绿电	2024 年 1 月 11 日	9.63	4,000	38,520.00
8	000539	粤电力 A	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 10 日	4.89	12,000	58,680.00
9	000553	安道麦 A	2024 年 1 月 10 日	6.94	6,000	41,640.00
10	000581	威孚高科	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 10 日	15.07	7,000	105,490.00

11	000623	吉林敖东	2024 年 1 月 11 日	15.14	14,000	211,960.00
12	000629	钒钛股份	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 10 日	3.28	73,000	239,440.00
13	000636	风华高科	2024 年 1 月 12 日	13.66	3,900	53,274.00
14	000703	恒逸石化	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 4 日	6.72	34,000	228,480.00
15	000783	长江证券	2024 年 1 月 11 日	5.38	28,000	150,640.00
16	000831	中国稀土	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	27.67	9,000	249,030.00
17	000937	冀中能源	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 12 日	7.14	16,000	114,240.00
18	000958	电投产融	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 11 日	3.94	9,000	35,460.00
19	000967	盈峰环境	2024 年 1 月 1 日	4.75	8,100	38,475.00
20	000970	中科三环	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	10.35	9,400	97,290.00
21	000975	银泰黄金	2024 年 1 月 9 日	15	4,900	73,500.00
22	000987	越秀资本	2024 年 1 月 10 日	6.02	1,000	6,020.00
23	000988	华工科技	2024 年 1 月 8 日	29.76	15,000	446,400.00
24	000998	隆平高科	2024 年 1 月 9 日	14.1	16,000	225,600.00
25	001286	陕西能源	2024 年 1 月 1 日	8.55	11,000	94,050.00
26	002030	达安基因	2024 年 1 月 3 日	9.68	14,900	144,232.00
27	002080	中材科技	2024 年 1 月 1 日	15.92	10,000	159,200.00
28	002120	韵达股份	2024 年 1 月 12 日	7.46	22,000	164,120.00
29	002131	利欧股份	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	2.28	106,000	241,680.00
30	002138	顺络电子	2024 年 1 月 5 日	27.01	11,000	297,110.00
31	002152	广电运通	2024 年 1 月 5 日	12.26	5,300	64,978.00
32	002156	通富微电	2024 年 1 月 10 日	23.12	10,500	242,760.00

33	002185	华天科技	2024 年 1 月 11 日	8.52	40,000	340,800.00
34	002192	融捷股份	2024 年 1 月 2 日	54.21	3,000	162,630.00
35	002262	恩华药业	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 12 日	27.12	2,600	70,512.00
36	002273	水晶光电	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 10 日	13.54	7,600	102,904.00
37	002281	光迅科技	2024 年 1 月 10 日	28.5	6,000	171,000.00
38	002294	信立泰	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 9 日	32.66	2,700	88,182.00
39	002368	太极股份	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	29.53	6,000	177,180.00
40	002373	千方科技	2024 年 1 月 11 日	11.21	5,600	62,776.00
41	002407	多氟多	2024 年 1 月 9 日	15.22	15,000	228,300.00
42	002408	齐翔腾达	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 11 日	5.28	22,000	116,160.00
43	002423	中粮资本	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 12 日	6.68	14,000	93,520.00
44	002429	兆驰股份	2024 年 1 月 11 日	5.58	34,000	189,720.00
45	002430	杭氧股份	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 10 日	29.21	7,000	204,470.00
46	002432	九安医疗	2024 年 1 月 12 日	37.67	6,000	226,020.00
47	002444	巨星科技	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 3 日	22.52	9,500	213,940.00
48	002463	沪电股份	2024 年 1 月 3 日	22.12	20,000	442,400.00
49	002468	申通快递	2024 年 1 月 5 日	7.79	12,000	93,480.00
50	002487	大金重工	2024 年 1 月 12 日	26.62	1,000	26,620.00
51	002505	鹏都农牧	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 11 日	1.6	60,000	96,000.00
52	002506	协鑫集成	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 4 日	2.74	6,100	16,714.00
53	002507	涪陵榨菜	2024 年 1 月 1 日	14.29	12,000	171,480.00
54	002517	恺英网络	2024 年 1 月 8 日	11.17	15,800	176,486.00

55	002518	科士达	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 2 日	27.6	3,000	82,800.00
56	002532	天山铝业	2024 年 1 月 3 日	6.01	30,300	182,103.00
57	002557	洽洽食品	2024 年 1 月 5 日	34.82	4,000	139,280.00
58	002558	巨人网络	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 10 日	11.14	21,000	233,940.00
59	002563	森马服饰	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 9 日	5.77	12,000	69,240.00
60	002572	索菲亚	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 12 日	15.95	10,000	159,500.00
61	002607	中公教育	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 10 日	4.08	67,000	273,360.00
62	002608	江苏国信	2024 年 1 月 12 日	6.57	11,000	72,270.00
63	002624	完美世界	2024 年 1 月 8 日	11.84	21,000	248,640.00
64	002625	光启技术	2024 年 1 月 11 日-2024 年 1 月 12 日	14.78	23,000	339,940.00
65	002670	国盛金控	2024 年 1 月 11 日	9.32	18,000	167,760.00
66	002738	中矿资源	2024 年 1 月 1 日	37.31	1,100	41,041.00
67	002739	万达电影	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 12 日	13.02	24,000	312,480.00
68	002761	浙江建投	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	10.26	8,000	82,080.00
69	002791	坚朗五金	2024 年 1 月 8 日	40.49	1,000	40,490.00
70	002797	第一创业	2024 年 1 月 11 日	5.81	34,000	197,540.00
71	002831	裕同科技	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 9 日	27.51	5,000	137,550.00
72	002850	科达利	2024 年 1 月 10 日	84.46	2,000	168,920.00
73	002925	盈趣科技	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 12 日	19.47	4,000	77,880.00
74	002936	郑州银行	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	2.01	87,000	174,870.00
75	002945	华林证券	2024 年 1 月 4 日	15.1	4,000	60,400.00
76	003035	南网能源	2024 年 1 月 1 日	5.26	1,200	6,312.00

77	300009	安科生物	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 2 日	10.22	4,000	40,880.00
78	300017	网宿科技	2024 年 1 月 2 日-2024 年 1 月 5 日	7.85	38,000	298,300.00
79	300024	机器人	2024 年 1 月 2 日	11.87	19,000	225,530.00
80	300026	红日药业	2024 年 1 月 10 日	4.24	33,000	139,920.00
81	300037	新宙邦	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	47.3	2,000	94,600.00
82	300058	蓝色光标	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日	7.18	39,000	280,020.00
83	300073	当升科技	2024 年 1 月 11 日	38.2	2,000	76,400.00
84	300118	东方日升	2024 年 1 月 11 日	17.65	1,400	24,710.00
85	300136	信维通信	2024 年 1 月 11 日	23.6	1,600	37,760.00
86	300212	易华录	2024 年 1 月 10 日	31.45	6,000	188,700.00
87	300296	利亚德	2024 年 1 月 1 日	6	19,000	114,000.00
88	300357	我武生物	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 5 日	29	3,800	110,200.00
89	300363	博腾股份	2024 年 1 月 8 日	25.15	5,000	125,750.00
90	300383	光环新网	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 9 日	9.72	22,000	213,840.00
91	300394	天孚通信	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	91.52	4,000	366,080.00
92	300418	昆仑万维	2024 年 1 月 9 日	37.4	13,000	486,200.00
93	300438	鹏辉能源	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 11 日	28.29	5,000	141,450.00
94	300474	景嘉微	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 10 日	70.71	4,000	282,840.00
95	300487	蓝晓科技	2024 年 1 月 10 日	53.06	1,000	53,060.00
96	300502	新易盛	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 11 日	49.32	10,000	493,200.00
97	300604	长川科技	2024 年 1 月 12 日	37.99	6,000	227,940.00
98	300682	朗新科技	2024 年 1 月 1 日	16.39	6,700	109,813.00

99	300699	光威复材	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 4 日	26.67	9,000	240,030.00
100	300748	金力永磁	2024 年 1 月 1 日	20.22	1,400	28,308.00
101	300776	帝尔激光	2024 年 1 月 4 日	60.26	1,000	60,260.00
102	300850	新强联	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 11 日	31.83	3,000	95,490.00
103	300866	安克创新	2024 年 1 月 1 日	88.6	3,000	265,800.00
104	301029	怡合达	2024 年 1 月 9 日	25.78	2,000	51,560.00
105	301236	软通动力	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 10 日	46.2	8,000	369,600.00
106	600008	首创环保	2024 年 1 月 3 日	2.69	30,500	82,045.00
107	600021	上海电力	2024 年 1 月 11 日	8.46	22,000	186,120.00
108	600022	山东钢铁	2024 年 1 月 17 日-2024 年 1 月 19 日	1.37	84,000	115,080.00
109	600032	浙江新能	2024 年 1 月 10 日	8.06	2,200	17,732.00
110	600056	中国医药	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 12 日	11.17	11,000	122,870.00
111	600062	华润双鹤	2024 年 1 月 10 日	18.6	6,000	111,600.00
112	600095	湘财股份	2024 年 1 月 3 日	7.51	1,500	11,265.00
113	600096	云天化	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 12 日	15.6	20,000	312,000.00
114	600118	中国卫星	2024 年 1 月 10 日	25.82	9,000	232,380.00
115	600126	杭钢股份	2024 年 1 月 11 日	5.33	21,000	111,930.00
116	600129	太极集团	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 11 日	46.46	6,000	278,760.00
117	600141	兴发集团	2024 年 1 月 5 日	18.25	12,000	219,000.00
118	600143	金发科技	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 10 日	7.99	29,000	231,710.00
119	600155	华创云信	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 10 日	8.34	34,000	283,560.00
120	600157	永泰能源	2024 年 1 月 17 日-2024 年 1 月 23 日	1.37	349,000	478,130.00
121	600160	巨化股	2024 年 1 月 3 日	16.49	20,000	329,800.00

		份				0
122	600161	天坛生物	2024 年 1 月 9 日	30.94	4,800	148,512.00
123	600166	福田汽车	2024 年 1 月 1 日	2.73	36,000	98,280.00
124	600167	联美控股	2024 年 1 月 12 日	5.67	1,000	5,670.00
125	600170	上海建工	2024 年 1 月 12 日	2.34	97,000	226,980.00
126	600258	首旅酒店	2024 年 1 月 1 日	15.62	10,000	156,200.00
127	600282	南钢股份	2024 年 1 月 9 日	3.7	46,000	170,200.00
128	600329	达仁堂	2024 年 1 月 4 日	33.65	4,000	134,600.00
129	600339	中油工程	2024 年 1 月 2 日	3.03	26,000	78,780.00
130	600348	华阳股份	2024 年 1 月 10 日	9.76	28,000	273,280.00
131	600350	山东高速	2024 年 1 月 11 日	6.94	2,000	13,880.00
132	600373	中文传媒	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 10 日	13.18	10,000	131,800.00
133	600378	昊华科技	2024 年 1 月 1 日	30.48	4,000	121,920.00
134	600398	海澜之家	2024 年 1 月 11 日	7.42	27,000	200,340.00
135	600399	抚顺特钢	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 3 日	9.72	24,000	233,280.00
136	600418	江淮汽车	2024 年 1 月 9 日	16.15	27,000	436,050.00
137	600499	科达制造	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	10.55	24,000	253,200.00
138	600511	国药股份	2024 年 1 月 5 日	28.62	1,700	48,654.00
139	600535	天士力	2024 年 1 月 11 日	17.02	1,400	23,828.00
140	600536	中国软件	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 9 日	36.26	8,900	322,714.00
141	600546	山煤国际	2024 年 1 月 3 日	17.51	10,700	187,357.00
142	600566	济川药业	2024 年 1 月 4 日	31.43	3,500	110,005.00
143	600583	海油工程	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 12 日	5.94	16,200	96,228.00

144	600598	北大荒	2024 年 1 月 1 日	11.97	10,000	119,700.00
145	600637	东方明珠	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 8 日	7.52	5,700	42,864.00
146	600655	豫园股份	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 11 日	6.21	14,600	90,666.00
147	600673	东阳光	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 12 日	7.33	28,000	205,240.00
148	600699	均胜电子	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 10 日	17.96	15,000	269,400.00
149	600707	彩虹股份	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	6.75	22,000	148,500.00
150	600764	中国海防	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 10 日	24.95	4,000	99,800.00
151	600839	四川长虹	2024 年 1 月 9 日	5.29	58,000	306,820.00
152	600859	王府井	2024 年 1 月 1 日	15.97	12,000	191,640.00
153	600867	通化东宝	2024 年 1 月 11 日	10.83	21,000	227,430.00
154	600871	石化油服	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 10 日	1.83	63,000	115,290.00
155	600879	航天电子	2024 年 1 月 1 日	7.71	33,000	254,430.00
156	600901	江苏金租	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 12 日	4.84	22,800	110,352.00
157	600906	财达证券	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 22 日	7.5	15,400	115,500.00
158	600928	西安银行	2024 年 1 月 8 日	3.33	1,100	3,663.00
159	600959	江苏有线	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 9 日	3.14	24,400	76,616.00
160	600968	海油发展	2024 年 1 月 3 日	2.85	31,000	88,350.00
161	600977	中国电影	2024 年 1 月 9 日-2024 年 1 月 11 日	12.24	7,700	94,248.00
162	600995	南网储能	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 12 日	9.86	8,500	83,810.00
163	601016	节能风电	2024 年 1 月 10 日	3	22,000	66,000.00
164	601058	赛轮轮胎	2024 年 1 月 4 日-2024 年 1 月 12 日	11.75	39,000	458,250.00
165	601061	中信金属	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 10 日	7.71	7,000	53,970.00

166	601098	中南传媒	2024 年 1 月 8 日	10.17	2,600	26,442.00
167	601106	中国一重	2024 年 1 月 10 日	2.88	7,400	21,312.00
168	601108	财通证券	2024 年 1 月 8 日	7.76	51,000	395,760.00
169	601139	深圳燃气	2024 年 1 月 5 日	6.89	9,000	62,010.00
170	601156	东航物流	2024 年 1 月 8 日	14.78	1,600	23,648.00
171	601158	重庆水务	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 10 日	5.67	7,900	44,793.00
172	601162	天风证券	2024 年 1 月 12 日	3.09	89,200	275,628.00
173	601179	中国西电	2024 年 1 月 8 日-2024 年 1 月 9 日	4.93	26,800	132,124.00
174	601233	桐昆股份	2024 年 1 月 1 日	15.13	17,000	257,210.00
175	601456	国联证券	2024 年 1 月 10 日	10.84	18,000	195,120.00
176	601568	北元集团	2024 年 1 月 3 日	4.74	18,000	85,320.00
177	601598	中国外运	2024 年 1 月 1 日	5.24	4,200	22,008.00
178	601666	平煤股份	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 10 日	11.56	20,900	241,604.00
179	601696	中银证券	2024 年 1 月 1 日	10.29	25,600	263,424.00
180	601778	晶科科技	2024 年 1 月 12 日	3.5	1,900	6,650.00
181	601828	美凯龙	2024 年 1 月 3 日	3.87	16,000	61,920.00
182	601866	中远海发	2024 年 1 月 11 日-2024 年 1 月 12 日	2.34	3,300	7,722.00
183	601880	辽港股份	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 3 日	1.45	8,000	11,600.00
184	601928	凤凰传媒	2024 年 1 月 5 日-2024 年 1 月 10 日	8.81	10,000	88,100.00
185	601933	永辉超市	2024 年 1 月 5 日	2.82	57,000	160,740.00
186	601958	金铂股份	2024 年 1 月 11 日	9.45	15,000	141,750.00
187	601991	大唐发电	2024 年 1 月 11 日	2.42	1,000	2,420.00
188	601992	金隅集	2024 年 1 月 4 日-2024 年	1.91	65,000	124,150.00

		团	1月5日			0
189	603000	人民网	2024年1月9日	27.98	8,000	223,840.00
190	603077	和邦生物	2024年1月2日-2024年1月5日	2.36	97,000	228,920.00
191	603127	昭衍新药	2024年1月4日-2024年1月11日	23.71	5,000	118,550.00
192	603218	日月股份	2024年1月10日	12.37	7,700	95,249.00
193	603225	新凤鸣	2024年1月9日	14.2	1,000	14,200.00
194	603267	鸿远电子	2024年1月4日	50.2	1,400	70,280.00
195	603305	旭升集团	2024年1月1日	19.73	5,000	98,650.00
196	603338	浙江鼎力	2024年1月5日	51.17	1,600	81,872.00
197	603355	莱克电气	2024年1月5日	22.3	1,000	22,300.00
198	603379	三美股份	2024年1月12日	34	3,000	102,000.00
199	603529	爱玛科技	2024年1月5日-2024年1月10日	25.04	3,100	77,624.00
200	603606	东方电缆	2024年1月1日-2024年1月8日	42.75	6,000	256,500.00
201	603650	彤程新材	2024年1月11日	33.3	3,000	99,900.00
202	603658	安图生物	2024年1月1日-2024年1月12日	57.01	3,000	171,030.00
203	603737	三棵树	2024年1月1日	47.61	3,000	142,830.00
204	603786	科博达	2024年1月9日	71.36	1,000	71,360.00
205	603816	顾家家居	2024年1月8日-2024年1月10日	35	7,000	245,000.00
206	603826	坤彩科技	2024年1月12日	59.03	2,000	118,060.00
207	603866	桃李面包	2024年1月1日	7.66	12,000	91,920.00
208	603939	益丰药房	2024年1月1日-2024年1月10日	40.04	6,000	240,240.00
209	605358	立昂微	2024年1月12日	27.39	8,000	219,120.00
210	688002	睿创微纳	2024年1月2日	44.22	3,500	154,770.00
211	688029	南微医	2024年1月3日	96.8	1,000	96,800.00

		学				
212	688107	安路科技	2024 年 1 月 10 日-2024 年 1 月 11 日	36.78	2,000	73,560.00
213	688114	华大智造	2024 年 1 月 9 日	86.02	1,400	120,428.00
214	688208	道通科技	2024 年 1 月 10 日	23.75	4,000	95,000.00
215	688248	南网科技	2024 年 1 月 10 日	24.97	1,000	24,970.00
216	688331	荣昌生物	2024 年 1 月 10 日	62.06	2,000	124,120.00
217	688387	信科移动-U	2024 年 1 月 4 日	7.21	10,000	72,100.00
218	688425	铁建重工	2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 9 日	3.97	25,000	99,250.00
219	688520	神州细胞-U	2024 年 1 月 4 日	53.87	2,000	107,740.00
220	688538	和辉光电-U	2024 年 1 月 11 日	2.43	1,600	3,888.00
221	688567	孚能科技	2024 年 1 月 8 日	16.31	13,000	212,030.00
222	688690	纳微科技	2024 年 1 月 12 日	27.42	3,000	82,260.00
223	688772	珠海冠宇	2024 年 1 月 2 日	22.01	10,000	220,100.00
224	688778	厦钨新能	2024 年 1 月 3 日-2024 年 1 月 12 日	39.64	2,000	79,280.00
225	689009	九号公司-WD	2024 年 1 月 10 日	29.66	6,000	177,960.00
合计	-	-	-	-	3,780,000	33,627,243.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%(2022 年 12 月 31 日：0.02%)。

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	9,693,346.18	-	-	-	-	-	9,693,346.18
结算备付金	8,013,161.97	-	-	-	-	-	8,013,161.97
存出保证金	49,464.28	-	-	-	-	2,079,206.40	2,128,670.68
交易性金融资产	-	-	-	-36,401.12	557,931,190.89	-	557,967,592.01
应收清算款	-	-	-	-	-	282,371.24	282,371.24
其他资产	-	-	-	-	-	18,392.79	18,392.79
资产总计	17,755,972.43	-	-	-36,401.12	560,311,161.32	578,103,534.87	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,137.29	72,137.29
应付托管费	-	-	-	-	-	24,045.77	24,045.77
其他负债	-	-	-	-	-	318,951.48	318,951.48
负债总计	-	-	-	-	-	415,134.54	415,134.54
利率敏感度缺口	17,755,972.43	-	-	-36,401.12	559,896,026.78	577,688,400.33	
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	11,214,820.94	-	-	-	-	11,214,820.94
结算备付金	8,217,161.09	-	-	-	-	8,217,161.09
存出保证金	18,623.86	-	-	-	2,631,731.20	2,650,355.06
交易性金融资产	-	-	-	-96,001.26	496,839,361.13	496,935,362.39
应收清算款	-	-	-	-	243,389.30	243,389.30
其他资产	-	-	-	-	1,036.11	1,036.11
资产总计	19,450,605.89	-	-	-96,001.26	499,715,517.74	519,262,124.89
负债						
交易性金融负债	-	-	-	-	464.10	464.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	67,108.22	67,108.22
应付托管费	-	-	-	-	22,369.43	22,369.43
应交税费	-	-	-	-	0.06	0.06
其他负债	-	-	-	-	297,041.85	297,041.85
负债总计	-	-	-	-	386,983.66	386,983.66
利率敏感度缺口	19,450,605.89	-	-	-96,001.26	499,328,534.08	518,875,141.23

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%(2022 年 12 月 31 日：0.02%)，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	557,931,190.89	96.58	496,839,361.13	95.75
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	-	-	-464.10	-
合计	557,931,190.89	96.58	496,838,897.03	95.75

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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 500 指数上升 5%	28,499,170.23	25,687,271.22
	中证 500 指数下降 5%	-28,499,170.23	-25,687,271.22

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	556,889,592.37	492,167,404.96
第二层次	36,401.12	1,968,646.26
第三层次	1,041,598.52	2,799,311.17
合计	557,967,592.01	496,935,362.39

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	-	2,799,311.17	2,799,311.17
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,819,337.38	1,819,337.38
转出第三层次	-	4,473,596.05	4,473,596.05
当期利得或损失总额	-	896,546.02	896,546.02
其中：计入损益的利得或损	-	896,546.02	896,546.02

失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,041,598.52	1,041,598.52
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	-	187,720.39	187,720.39
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,749,831.95	3,749,831.95
转出第三层次	-	1,471,812.58	1,471,812.58
当期利得或损失总额	-	521,291.80	521,291.80
其中：计入损益的利得或损失	-	521,291.80	521,291.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,799,311.17	2,799,311.17
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	-	229,716.58	229,716.58

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	1,041,598.52	平均价格 亚式期权	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关

期内的股票		模型			
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	2,799,311.17	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 145,098,000.84 元(2022 年度：254,150,911.30 元)，其中包括以股票支付的申购款 66,714,028.00 元和以现金支付的申购款 78,383,972.84 元(2022 年度：其中包括以股票支付的申购款 114,983,781.00 元和以现金支付的申购款 139,167,130.30 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	557,931,190.89	96.51
	其中：股票	557,931,190.89	96.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,401.12	0.01
	其中：债券	36,401.12	0.01
	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	17,706,508.15	3.06
8	其他各项资产	2,429,434.71	0.42
9	合计	578,103,534.87	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 33,627,243.00 元，占本基金期末资产净值的 5.82%。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 5,759,543.00 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	3,793,225.98	0.66
B	采矿业	21,592,375.30	3.74
C	制造业	351,181,380.77	60.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,186,179.14	3.15
E	建筑业	4,458,959.06	0.77
F	批发和零售业	16,872,503.36	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	10,344,435.58	1.79
H	住宿和餐饮业	915,332.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,993,006.95	7.27
J	金融业	50,514,957.33	8.74
K	房地产业	6,971,105.99	1.21
L	租赁和商务服务业	4,970,884.36	0.86
M	科学研究和技术服务业	5,108,052.82	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	2,968,887.40	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,537,752.00	0.27
Q	卫生和社会工作	4,228,144.57	0.73
R	文化、体育和娱乐业	7,982,514.24	1.38
S	综合	3,269,895.52	0.57
	合计	556,889,592.37	96.40

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	915,382.84	0.16
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	9,608.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,494.27	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	0.00
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	1,041,598.52	0.18

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	300502	新易盛	62,100	3,062,772.00	0.53
2	002422	科伦药业	103,300	3,000,865.00	0.52
3	002028	思源电气	53,916	2,805,788.64	0.49

4	300418	昆仑万维	74,307	2,779,081.80	0.48
5	600157	永泰能源	1,940,100	2,657,937.00	0.46
6	000988	华工科技	87,855	2,614,564.80	0.45
7	002463	沪电股份	116,500	2,576,980.00	0.45
8	601058	赛轮轮胎	218,100	2,562,675.00	0.44
9	601555	东吴证券	349,930	2,557,988.30	0.44
10	000975	银泰黄金	169,840	2,547,600.00	0.44
11	600079	人福医药	99,800	2,481,028.00	0.43
12	600418	江淮汽车	152,500	2,462,875.00	0.43
13	002340	格林美	448,624	2,449,487.04	0.42
14	601168	西部矿业	166,603	2,377,424.81	0.41
15	000933	神火股份	137,700	2,313,360.00	0.40
16	301236	软通动力	49,500	2,286,900.00	0.40
17	601233	桐昆股份	147,500	2,231,675.00	0.39
18	600161	天坛生物	72,000	2,227,680.00	0.39
19	300394	天孚通信	24,200	2,214,784.00	0.38
20	601077	渝农商行	540,800	2,206,464.00	0.38
21	601108	财通证券	283,700	2,201,512.00	0.38
22	000630	铜陵有色	663,900	2,177,592.00	0.38
23	002384	东山精密	119,500	2,172,510.00	0.38
24	300037	新宙邦	45,840	2,168,232.00	0.38
25	002156	通富微电	92,600	2,140,912.00	0.37
26	688122	西部超导	39,722	2,114,402.06	0.37
27	000009	中国宝安	180,083	2,114,174.42	0.37
28	002517	恺英网络	188,400	2,104,428.00	0.36
29	300012	华测检测	147,000	2,087,400.00	0.36
30	002966	苏州银行	320,300	2,069,138.00	0.36
31	600109	国金证券	227,600	2,066,608.00	0.36
32	600988	赤峰黄金	145,400	2,037,054.00	0.35
33	600885	宏发股份	72,884	2,014,513.76	0.35
34	300136	信维通信	84,700	1,998,920.00	0.35
35	002625	光启技术	132,000	1,950,960.00	0.34
36	002465	海格通信	151,677	1,949,049.45	0.34
37	600160	巨化股份	117,992	1,945,688.08	0.34
38	000423	东阿阿胶	39,400	1,943,208.00	0.34
39	300207	欣旺达	130,000	1,918,800.00	0.33
40	688169	石头科技	6,773	1,916,420.35	0.33
41	600352	浙江龙盛	227,200	1,908,480.00	0.33
42	002185	华天科技	223,900	1,907,628.00	0.33
43	002138	顺络电子	70,500	1,904,205.00	0.33
44	600536	中国软件	52,513	1,904,121.38	0.33
45	002738	中矿资源	50,600	1,887,886.00	0.33
46	600298	安琪酵母	53,200	1,871,576.00	0.32

47	601162	天风证券	605,300	1,870,377.00	0.32
48	000932	华菱钢铁	361,660	1,862,549.00	0.32
49	300003	乐普医疗	115,000	1,858,400.00	0.32
50	603596	伯特利	26,600	1,843,380.00	0.32
51	688099	晶晨股份	29,152	1,825,789.76	0.32
52	000783	长江证券	338,200	1,819,516.00	0.31
53	002223	鱼跃医疗	52,455	1,813,893.90	0.31
54	300724	捷佳伟创	24,400	1,805,844.00	0.31
55	300144	宋城演艺	182,800	1,804,236.00	0.31
56	688072	拓荆科技	7,780	1,799,514.00	0.31
57	002078	太阳纸业	146,474	1,782,588.58	0.31
58	002439	启明星辰	66,000	1,782,000.00	0.31
59	603939	益丰药房	44,160	1,768,166.40	0.31
60	000723	美锦能源	264,600	1,762,236.00	0.31
61	600415	小商品城	239,600	1,753,872.00	0.30
62	600096	云天化	112,300	1,751,880.00	0.30
63	002739	万达电影	133,500	1,738,170.00	0.30
64	300568	星源材质	112,100	1,728,582.00	0.30
65	002756	永兴材料	33,100	1,728,151.00	0.30
66	002385	大北农	289,400	1,724,824.00	0.30
67	600765	中航重机	90,086	1,721,543.46	0.30
68	600482	中国动力	95,500	1,719,955.00	0.30
69	600873	梅花生物	179,800	1,717,090.00	0.30
70	000066	中国长城	169,300	1,713,316.00	0.30
71	002532	天山铝业	284,100	1,707,441.00	0.30
72	600839	四川长虹	322,580	1,706,448.20	0.30
73	002797	第一创业	293,700	1,706,397.00	0.30
74	300474	景嘉微	23,900	1,689,969.00	0.29
75	688180	君实生物	40,165	1,680,101.95	0.29
76	300017	网宿科技	212,900	1,671,265.00	0.29
77	603160	汇顶科技	24,100	1,665,310.00	0.29
78	300395	菲利华	45,400	1,659,824.00	0.29
79	002600	领益智造	244,900	1,655,524.00	0.29
80	600155	华创阳安	197,574	1,647,767.16	0.29
81	002273	水晶光电	121,478	1,644,812.12	0.28
82	002044	美年健康	273,500	1,643,735.00	0.28
83	300285	国瓷材料	70,200	1,623,024.00	0.28
84	600862	中航高科	73,089	1,618,921.35	0.28
85	300601	康泰生物	58,700	1,593,705.00	0.28
86	002294	信立泰	48,700	1,590,542.00	0.28
87	600177	雅戈尔	242,600	1,589,030.00	0.28
88	600129	太极集团	34,100	1,584,286.00	0.27
89	300866	安克创新	17,800	1,577,080.00	0.27

90	600497	驰宏锌锗	310,946	1,570,277.30	0.27
91	688114	华大智造	18,213	1,566,682.26	0.27
92	300058	蓝色光标	217,552	1,562,023.36	0.27
93	000728	国元证券	228,500	1,560,655.00	0.27
94	600699	均胜电子	86,340	1,550,666.40	0.27
95	002472	双环传动	59,500	1,548,190.00	0.27
96	603606	东方电缆	36,100	1,543,275.00	0.27
97	601990	南京证券	193,200	1,541,736.00	0.27
98	603882	金域医学	24,600	1,539,222.00	0.27
99	600066	宇通客车	116,100	1,538,325.00	0.27
100	002607	中公教育	376,900	1,537,752.00	0.27
101	600348	华阳股份	157,431	1,536,526.56	0.27
102	000831	中国稀土	55,500	1,535,685.00	0.27
103	002195	岩山科技	500,000	1,535,000.00	0.27
104	601128	常熟银行	239,805	1,532,353.95	0.27
105	002008	大族激光	73,600	1,524,992.00	0.26
106	300146	汤臣倍健	89,200	1,519,076.00	0.26
107	600546	山煤国际	86,700	1,518,117.00	0.26
108	603816	顾家家居	43,100	1,508,500.00	0.26
109	002353	杰瑞股份	53,542	1,505,065.62	0.26
110	601696	中银证券	145,600	1,498,224.00	0.26
111	000893	亚钾国际	56,900	1,493,056.00	0.26
112	002673	西部证券	234,000	1,490,580.00	0.26
113	600529	山东药玻	58,100	1,487,360.00	0.26
114	300604	长川科技	38,200	1,451,218.00	0.25
115	688120	华海清科	7,676	1,440,785.20	0.25
116	600985	淮北矿业	86,400	1,436,832.00	0.25
117	601577	长沙银行	210,400	1,434,928.00	0.25
118	300088	长信科技	214,435	1,434,570.15	0.25
119	600060	海信视像	68,582	1,433,363.80	0.25
120	600499	科达制造	135,800	1,432,690.00	0.25
121	002262	恩华药业	52,700	1,429,224.00	0.25
122	002444	巨星科技	63,433	1,428,511.16	0.25
123	688301	奕瑞科技	4,383	1,425,614.58	0.25
124	600369	西南证券	348,200	1,424,138.00	0.25
125	603589	口子窖	31,400	1,422,420.00	0.25
126	000997	新大陆	72,200	1,415,842.00	0.25
127	002624	完美世界	118,900	1,407,776.00	0.24
128	300118	东方日升	79,500	1,403,175.00	0.24
129	601666	平煤股份	121,300	1,402,228.00	0.24
130	601198	东兴证券	169,600	1,395,808.00	0.24
131	688728	格科微	68,145	1,394,928.15	0.24
132	002409	雅克科技	25,000	1,393,250.00	0.24

133	688002	睿创微纳	31,322	1,385,058.84	0.24
134	603688	石英股份	15,800	1,372,704.00	0.24
135	600642	申能股份	213,763	1,372,358.46	0.24
136	000400	许继电气	62,440	1,371,182.40	0.24
137	300073	当升科技	35,500	1,356,100.00	0.23
138	300699	光威复材	50,800	1,354,836.00	0.23
139	603000	人民网	48,370	1,353,392.60	0.23
140	600486	扬农化工	21,370	1,348,874.40	0.23
141	002558	巨人网络	120,800	1,345,712.00	0.23
142	002131	利欧股份	590,084	1,345,391.52	0.23
143	600637	东方明珠	178,800	1,344,576.00	0.23
144	600884	杉杉股份	98,700	1,344,294.00	0.23
145	000683	远兴能源	228,500	1,341,295.00	0.23
146	600399	抚顺特钢	137,900	1,340,388.00	0.23
147	688390	固德威	10,246	1,337,922.68	0.23
148	600535	天士力	78,500	1,336,070.00	0.23
149	000591	太阳能	239,100	1,334,178.00	0.23
150	000878	云南铜业	122,514	1,334,177.46	0.23
151	600879	航天电子	172,954	1,333,475.34	0.23
152	600118	中国卫星	51,600	1,332,312.00	0.23
153	000629	钒钛股份	405,800	1,331,024.00	0.23
154	002152	广电运通	108,269	1,327,377.94	0.23
155	000021	深科技	81,565	1,322,168.65	0.23
156	600867	通化东宝	121,900	1,320,177.00	0.23
157	002497	雅化集团	100,700	1,318,163.00	0.23
158	601997	贵阳银行	255,400	1,312,756.00	0.23
159	688521	芯原股份	26,248	1,311,350.08	0.23
160	600895	张江高科	67,676	1,306,146.80	0.23
161	600143	金发科技	163,400	1,305,566.00	0.23
162	300001	特锐德	64,650	1,299,465.00	0.22
163	000998	隆平高科	92,100	1,298,610.00	0.22
164	300390	天华新能	51,220	1,298,427.00	0.22
165	605358	立昂微	47,392	1,298,066.88	0.22
166	688772	珠海冠宇	58,960	1,297,709.60	0.22
167	688220	翱捷科技	18,355	1,292,926.20	0.22
168	000703	恒逸石化	192,200	1,291,584.00	0.22
169	600516	方大炭素	246,200	1,290,088.00	0.22
170	600416	湘电股份	81,200	1,289,456.00	0.22
171	300024	机器人	108,000	1,281,960.00	0.22
172	002432	九安医疗	34,000	1,280,780.00	0.22
173	002240	盛新锂能	56,200	1,278,550.00	0.22
174	600549	厦门钨业	74,419	1,278,518.42	0.22
175	603712	七一二	40,500	1,276,155.00	0.22

176	603077	和邦生物	539,985	1,274,364.60	0.22
177	600170	上海建工	543,400	1,271,556.00	0.22
178	688188	柏楚电子	5,003	1,266,309.33	0.22
179	002407	多氟多	83,160	1,265,695.20	0.22
180	600153	建发股份	131,000	1,261,530.00	0.22
181	002430	杭氧股份	43,000	1,256,030.00	0.22
182	600392	盛和资源	122,561	1,247,670.98	0.22
183	600141	兴发集团	68,011	1,241,200.75	0.21
184	601966	玲珑轮胎	64,400	1,238,412.00	0.21
185	000960	锡业股份	86,000	1,231,520.00	0.21
186	000039	中集集团	160,576	1,228,406.40	0.21
187	000623	吉林敖东	81,100	1,227,854.00	0.21
188	300383	光环新网	125,600	1,220,832.00	0.21
189	002065	东华软件	196,000	1,209,320.00	0.21
190	300748	金力永磁	59,700	1,207,134.00	0.21
191	600704	物产中大	272,200	1,205,846.00	0.21
192	600909	华安证券	246,290	1,201,895.20	0.21
193	600998	九州通	170,788	1,197,223.88	0.21
194	300212	易华录	37,920	1,192,584.00	0.21
195	601717	郑煤机	94,202	1,191,655.30	0.21
196	000750	国海证券	334,342	1,183,570.68	0.20
197	300487	蓝晓科技	22,150	1,175,279.00	0.20
198	688052	纳芯微	7,022	1,171,620.70	0.20
199	603658	安图生物	20,500	1,168,705.00	0.20
200	002064	华峰化学	173,400	1,163,514.00	0.20
201	002203	海亮股份	104,300	1,162,945.00	0.20
202	002268	电科网安	51,649	1,160,036.54	0.20
203	600673	东阳光	157,670	1,155,721.10	0.20
204	002025	航天电器	24,000	1,152,480.00	0.20
205	600583	海油工程	193,100	1,147,014.00	0.20
206	000738	航发控制	57,600	1,146,240.00	0.20
207	600166	福田汽车	419,502	1,145,240.46	0.20
208	603456	九洲药业	47,200	1,142,712.00	0.20
209	000050	深天马 A	107,100	1,140,615.00	0.20
210	600521	华海药业	77,600	1,138,392.00	0.20
211	603338	浙江鼎力	22,200	1,135,974.00	0.20
212	002368	太极股份	38,425	1,134,690.25	0.20
213	300558	贝达药业	22,000	1,134,100.00	0.20
214	002568	百润股份	45,900	1,129,599.00	0.20
215	601456	国联证券	104,200	1,129,528.00	0.20
216	300114	中航电测	25,800	1,128,750.00	0.20
217	002939	长城证券	141,000	1,128,000.00	0.20
218	000513	丽珠集团	32,106	1,124,031.06	0.19

219	002299	圣农发展	65,242	1,120,857.56	0.19
220	689009	九号公司	37,770	1,120,258.20	0.19
221	600398	海澜之家	150,900	1,119,678.00	0.19
222	002506	协鑫集成	408,500	1,119,290.00	0.19
223	002128	电投能源	78,229	1,116,327.83	0.19
224	600863	内蒙华电	284,800	1,110,720.00	0.19
225	600820	隧道股份	192,500	1,108,800.00	0.19
226	600859	王府井	69,429	1,108,781.13	0.19
227	002429	兆驰股份	197,800	1,103,724.00	0.19
228	601216	君正集团	294,900	1,102,926.00	0.19
229	600739	辽宁成大	93,600	1,102,608.00	0.19
230	002092	中泰化学	180,724	1,102,416.40	0.19
231	000636	风华高科	80,674	1,102,006.84	0.19
232	002414	高德红外	149,200	1,089,160.00	0.19
233	002373	千方科技	96,665	1,083,614.65	0.19
234	300253	卫宁健康	150,100	1,079,219.00	0.19
235	600435	北方导航	91,645	1,075,912.30	0.19
236	600563	法拉电子	11,578	1,072,122.80	0.19
237	002926	华西证券	137,600	1,067,776.00	0.18
238	300595	欧普康视	47,100	1,063,518.00	0.18
239	000729	燕京啤酒	123,110	1,062,439.30	0.18
240	300296	利亚德	176,700	1,060,200.00	0.18
241	600655	豫园股份	170,200	1,056,942.00	0.18
242	300009	安科生物	102,460	1,047,141.20	0.18
243	300244	迪安诊断	43,897	1,045,187.57	0.18
244	300251	光线传媒	128,000	1,043,200.00	0.18
245	002595	豪迈科技	35,000	1,041,950.00	0.18
246	300676	华大基因	21,700	1,041,600.00	0.18
247	688567	孚能科技	63,846	1,041,328.26	0.18
248	600021	上海电力	123,045	1,040,960.70	0.18
249	600325	华发股份	144,300	1,040,403.00	0.18
250	300373	扬杰科技	28,290	1,038,243.00	0.18
251	600498	烽火通信	62,300	1,036,672.00	0.18
252	600271	航天信息	97,200	1,034,208.00	0.18
253	600008	首创环保	384,400	1,034,036.00	0.18
254	000519	中兵红箭	72,986	1,024,723.44	0.18
255	601016	节能风电	339,400	1,018,200.00	0.18
256	002500	山西证券	188,197	1,014,381.83	0.18
257	688005	容百科技	25,449	1,012,870.20	0.18
258	600004	白云机场	103,300	1,010,274.00	0.17
259	600380	健康元	81,252	1,009,962.36	0.17
260	600566	济川药业	32,100	1,008,903.00	0.17
261	002507	涪陵榨菜	70,600	1,008,874.00	0.17

262	002372	伟星新材	69,620	1,007,401.40	0.17
263	000830	鲁西化工	100,433	1,007,342.99	0.17
264	600282	南钢股份	269,254	996,239.80	0.17
265	600038	中直股份	25,800	994,074.00	0.17
266	002936	郑州银行	494,225	993,392.25	0.17
267	002281	光迅科技	34,845	993,082.50	0.17
268	603233	大参林	39,808	991,219.20	0.17
269	000060	中金岭南	228,500	987,120.00	0.17
270	002192	融捷股份	18,200	986,622.00	0.17
271	688536	思瑞浦	6,715	982,404.50	0.17
272	002850	科达利	11,600	979,736.00	0.17
273	688234	天岳先进	14,711	971,955.77	0.17
274	688331	荣昌生物	15,575	966,584.50	0.17
275	601636	旗滨集团	141,000	964,440.00	0.17
276	002056	横店东磁	71,043	961,922.22	0.17
277	601880	辽港股份	657,536	953,427.20	0.17
278	002019	亿帆医药	64,283	950,102.74	0.16
279	603225	新凤鸣	66,800	948,560.00	0.16
280	300070	碧水源	190,000	948,100.00	0.16
281	002670	国盛金控	101,376	944,824.32	0.16
282	002120	韵达股份	126,600	944,436.00	0.16
283	300529	健帆生物	42,400	942,552.00	0.16
284	603156	养元饮品	44,300	941,818.00	0.16
285	600580	卧龙电驱	80,025	938,693.25	0.16
286	600511	国药股份	32,795	938,592.90	0.16
287	300677	英科医疗	40,160	938,137.60	0.16
288	300682	朗新集团	57,200	937,508.00	0.16
289	000547	航天发展	111,425	932,627.25	0.16
290	603893	瑞芯微	14,700	931,980.00	0.16
291	002080	中材科技	58,400	929,728.00	0.16
292	603885	吉祥航空	77,275	927,300.00	0.16
293	603927	中科软	30,920	926,981.60	0.16
294	002557	洽洽食品	26,600	926,212.00	0.16
295	600390	五矿资本	196,600	920,088.00	0.16
296	600258	首旅酒店	58,600	915,332.00	0.16
297	002508	老板电器	41,800	910,404.00	0.16
298	002531	天顺风能	78,400	909,440.00	0.16
299	601000	唐山港	258,543	904,900.50	0.16
300	688032	禾迈股份	3,340	901,800.00	0.16
301	603444	吉比特	3,677	901,306.24	0.16
302	688385	复旦微电	23,304	900,233.52	0.16
303	601933	永辉超市	317,100	894,222.00	0.15
304	688063	派能科技	8,414	891,884.00	0.15

305	002487	大金重工	33,500	891,770.00	0.15
306	603517	绝味食品	33,200	891,752.00	0.15
307	002958	青农商行	339,700	890,014.00	0.15
308	002831	裕同科技	32,341	889,700.91	0.15
309	000598	兴蓉环境	156,272	889,187.68	0.15
310	300026	红日药业	209,541	888,453.84	0.15
311	002572	索菲亚	55,600	886,820.00	0.15
312	601179	中国西电	178,951	882,228.43	0.15
313	688538	和辉光电	362,930	881,919.90	0.15
314	603737	三棵树	18,480	879,832.80	0.15
315	000970	中科三环	84,738	877,038.30	0.15
316	300438	鹏辉能源	30,900	874,161.00	0.15
317	688516	奥特维	9,650	873,325.00	0.15
318	601778	晶科科技	249,500	873,250.00	0.15
319	601231	环旭电子	57,600	870,336.00	0.15
320	600970	中材国际	92,360	862,642.40	0.15
321	000155	川能动力	64,500	857,205.00	0.15
322	000887	中鼎股份	69,021	853,789.77	0.15
323	688200	华峰测控	6,950	853,460.00	0.15
324	600906	财达证券	113,400	850,500.00	0.15
325	600707	彩虹股份	125,400	846,450.00	0.15
326	603185	弘元绿能	25,300	841,984.00	0.15
327	600848	上海临港	83,400	838,170.00	0.15
328	600329	达仁堂	24,900	837,885.00	0.15
329	002865	钧达股份	10,800	836,784.00	0.14
330	600481	双良节能	98,055	829,545.30	0.14
331	002030	达安基因	85,512	827,756.16	0.14
332	600995	南网储能	83,500	823,310.00	0.14
333	603858	步长制药	48,398	823,249.98	0.14
334	600959	江苏有线	261,738	821,857.32	0.14
335	002155	湖南黄金	73,572	819,592.08	0.14
336	000563	陕国投 A	268,046	814,859.84	0.14
337	601866	中远海发	345,951	809,525.34	0.14
338	600208	新湖中宝	371,700	806,589.00	0.14
339	600755	厦门国贸	115,615	805,836.55	0.14
340	000027	深圳能源	124,676	804,160.20	0.14
341	600977	中国电影	65,300	799,272.00	0.14
342	000778	新兴铸管	208,889	797,955.98	0.14
343	600316	洪都航空	37,653	797,114.01	0.14
344	601958	金钼股份	84,300	796,635.00	0.14
345	600131	国网信通	52,500	795,375.00	0.14
346	300357	我武生物	27,400	794,600.00	0.14
347	000739	普洛药业	51,500	792,585.00	0.14

348	000987	越秀资本	131,270	790,245.40	0.14
349	002683	广东宏大	39,300	789,144.00	0.14
350	002244	滨江集团	108,492	788,736.84	0.14
351	600582	天地科技	144,600	786,624.00	0.14
352	603127	昭衍新药	33,152	786,033.92	0.14
353	601991	大唐发电	324,800	786,016.00	0.14
354	601665	齐鲁银行	200,100	782,391.00	0.14
355	688029	南微医学	8,047	778,949.60	0.13
356	002266	浙富控股	228,981	778,535.40	0.13
357	600373	中文传媒	58,900	776,302.00	0.13
358	300888	稳健医疗	20,820	775,545.00	0.13
359	688082	盛美上海	7,400	772,634.00	0.13
360	600737	中粮糖业	93,493	770,382.32	0.13
361	000709	河钢股份	360,800	768,504.00	0.13
362	603883	老百姓	25,541	763,420.49	0.13
363	002032	苏泊尔	14,100	747,441.00	0.13
364	000825	太钢不锈	199,800	745,254.00	0.13
365	002326	永太科技	63,934	742,913.08	0.13
366	600598	北大荒	61,810	739,865.70	0.13
367	600056	中国医药	65,413	730,663.21	0.13
368	601611	中国核建	105,300	729,729.00	0.13
369	600378	昊华科技	23,900	728,472.00	0.13
370	603379	三美股份	21,380	726,920.00	0.13
371	600801	华新水泥	58,425	726,222.75	0.13
372	000785	居然之家	219,700	725,010.00	0.13
373	601598	中国外运	138,100	723,644.00	0.13
374	000883	湖北能源	170,900	722,907.00	0.13
375	600528	中铁工业	97,100	722,424.00	0.13
376	600901	江苏租赁	148,360	718,062.40	0.12
377	300363	博腾股份	28,500	716,775.00	0.12
378	603568	伟明环保	44,747	715,952.00	0.12
379	600517	国网英大	149,900	715,023.00	0.12
380	603826	坤彩科技	12,100	714,263.00	0.12
381	603267	鸿远电子	14,200	712,840.00	0.12
382	300776	帝尔激光	11,780	709,862.80	0.12
383	002511	中顺洁柔	70,000	700,000.00	0.12
384	603650	彤程新材	20,976	698,500.80	0.12
385	002153	石基信息	71,532	696,721.68	0.12
386	601992	金隅集团	364,200	695,622.00	0.12
387	003035	南网能源	132,100	694,846.00	0.12
388	600500	中化国际	156,525	691,840.50	0.12
389	601106	中国一重	239,600	690,048.00	0.12
390	002653	海思科	29,300	678,295.00	0.12

391	600062	华润双鹤	36,457	678,100.20	0.12
392	600827	百联股份	70,100	665,249.00	0.12
393	603228	景旺电子	29,340	661,910.40	0.11
394	000937	冀中能源	92,648	661,506.72	0.11
395	002408	齐翔腾达	124,194	655,744.32	0.11
396	000581	威孚高科	43,513	655,740.91	0.11
397	603026	胜华新材	14,200	651,212.00	0.11
398	600871	石化油服	355,400	650,382.00	0.11
399	001227	兰州银行	248,800	646,880.00	0.11
400	003022	联泓新科	35,100	642,681.00	0.11
401	600022	山东钢铁	467,280	640,173.60	0.11
402	603305	旭升集团	32,400	639,252.00	0.11
403	601098	中南传媒	62,813	638,808.21	0.11
404	603707	健友股份	42,443	636,645.00	0.11
405	601118	海南橡胶	149,503	633,892.72	0.11
406	600126	杭钢股份	118,038	629,142.54	0.11
407	600315	上海家化	29,398	622,649.64	0.11
408	600764	中国海防	24,900	621,255.00	0.11
409	688520	神州细胞	11,440	616,272.80	0.11
410	600967	内蒙一机	74,464	615,072.64	0.11
411	601156	东航物流	41,600	614,848.00	0.11
412	688779	长远锂科	83,897	612,448.10	0.11
413	688349	三一重能	21,158	605,541.96	0.10
414	002690	美亚光电	30,625	601,475.00	0.10
415	000559	万向钱潮	115,501	599,450.19	0.10
416	000156	华数传媒	80,719	594,899.03	0.10
417	000401	冀东水泥	92,933	593,841.87	0.10
418	601928	凤凰传媒	66,700	587,627.00	0.10
419	688778	厦钨新能	14,767	585,363.88	0.10
420	601608	中信重工	151,600	585,176.00	0.10
421	601187	厦门银行	115,300	584,571.00	0.10
422	688276	百克生物	10,620	582,082.20	0.10
423	002867	周大生	38,300	581,394.00	0.10
424	000089	深圳机场	89,648	576,436.64	0.10
425	600808	马钢股份	209,835	570,751.20	0.10
426	002518	科士达	20,600	568,560.00	0.10
427	600663	陆家嘴	64,891	567,796.25	0.10
428	603529	爱玛科技	22,600	565,904.00	0.10
429	600095	湘财股份	75,000	563,250.00	0.10
430	002010	传化智联	121,800	562,716.00	0.10
431	001286	陕西能源	65,600	560,880.00	0.10
432	300861	美畅股份	16,800	559,272.00	0.10
433	603218	日月股份	45,100	557,887.00	0.10

434	000958	电投产融	141,100	555,934.00	0.10
435	688425	铁建重工	139,758	554,839.26	0.10
436	688208	道通科技	23,272	552,710.00	0.10
437	300257	开山股份	34,403	542,191.28	0.09
438	000930	中粮科技	81,252	539,513.28	0.09
439	002423	中粮资本	80,300	536,404.00	0.09
440	603866	桃李面包	69,956	535,862.96	0.09
441	002505	鹏都农牧	333,811	534,097.60	0.09
442	002925	盈趣科技	27,200	529,584.00	0.09
443	000967	盈峰环境	110,800	526,300.00	0.09
444	600597	光明乳业	59,930	523,188.90	0.09
445	002468	申通快递	66,900	521,151.00	0.09
446	000898	鞍钢股份	209,100	520,659.00	0.09
447	688107	安路科技	14,085	518,046.30	0.09
448	600968	海油发展	177,500	505,875.00	0.09
449	300850	新强联	15,700	499,731.00	0.09
450	688006	杭可科技	21,126	496,038.48	0.09
451	688281	华秦科技	3,635	493,124.10	0.09
452	601568	北元集团	103,940	492,675.60	0.09
453	603786	科博达	6,900	492,384.00	0.09
454	688690	纳微科技	17,745	486,567.90	0.08
455	002761	浙江建投	47,391	486,231.66	0.08
456	000537	中绿电	48,900	470,907.00	0.08
457	000959	首钢股份	135,900	470,214.00	0.08
458	600167	联美控股	79,830	452,636.10	0.08
459	003031	中瓷电子	5,100	449,973.00	0.08
460	002791	坚朗五金	11,100	449,439.00	0.08
461	600377	宁沪高速	43,400	444,850.00	0.08
462	600339	中油工程	146,300	443,289.00	0.08
463	001914	招商积余	36,800	440,128.00	0.08
464	002608	江苏国信	66,000	433,620.00	0.08
465	688387	信科移动	59,452	428,648.92	0.07
466	688297	中无人机	10,797	413,849.01	0.07
467	601228	广州港	131,600	411,908.00	0.07
468	600350	山东高速	58,900	408,766.00	0.07
469	002563	森马服饰	70,600	407,362.00	0.07
470	001203	大中矿业	39,600	402,732.00	0.07
471	600927	永安期货	25,500	400,605.00	0.07
472	688348	昱能科技	3,220	394,063.60	0.07
473	301029	怡合达	15,220	392,371.60	0.07
474	603056	德邦股份	26,870	388,808.90	0.07
475	600928	西安银行	116,500	387,945.00	0.07
476	000539	粤电力 A	77,900	380,931.00	0.07

477	002399	海普瑞	32,400	380,052.00	0.07
478	000402	金融街	104,300	378,609.00	0.07
479	601298	青岛港	61,000	376,980.00	0.07
480	603317	天味食品	27,811	369,608.19	0.06
481	601828	美凯龙	94,900	367,263.00	0.06
482	600925	苏能股份	66,300	365,313.00	0.06
483	002945	华林证券	23,700	357,870.00	0.06
484	601139	深圳燃气	50,300	346,567.00	0.06
485	000031	大悦城	112,330	333,620.10	0.06
486	601061	中信金属	42,800	329,988.00	0.06
487	688153	唯捷创芯	5,031	329,530.50	0.06
488	001872	招商港口	20,500	327,180.00	0.06
489	688819	天能股份	11,705	326,803.60	0.06
490	688105	诺唯赞	10,115	323,882.30	0.06
491	688295	中复神鹰	10,575	320,528.25	0.06
492	601158	重庆水务	50,300	285,201.00	0.05
493	600299	安迪苏	34,800	278,400.00	0.05
494	000553	安道麦 A	38,100	264,414.00	0.05
495	600956	新天绿能	30,600	248,778.00	0.04
496	688375	国博电子	2,890	229,841.70	0.04
497	603355	莱克电气	9,824	219,075.20	0.04
498	603868	飞科电器	4,166	210,383.00	0.04
499	688248	南网科技	6,980	174,290.60	0.03
500	600032	浙江新能	19,000	153,140.00	0.03

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	301526	国际复材	8,807	39,191.15	0.01
2	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
3	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
4	688548	广钢气体	2,128	27,132.00	0.00
5	688549	中巨芯	3,220	26,049.80	0.00
6	688563	航材股份	372	22,502.28	0.00
7	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
8	688582	芯动联科	559	21,616.53	0.00
9	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
10	301291	明阳电气	692	19,625.12	0.00
11	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
12	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
13	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
14	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00

15	688702	盛科通信	367	17,682.06	0.00
16	301498	乖宝宠物	450	17,464.50	0.00
17	301486	致尚科技	369	17,435.25	0.00
18	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
19	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
20	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
21	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
22	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
23	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
24	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
25	301393	昊帆生物	223	13,239.51	0.00
26	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
27	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
28	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
29	301525	儒竞科技	144	11,730.24	0.00
30	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
31	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
32	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
33	301559	中集环科	616	11,235.84	0.00
34	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
35	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
36	301371	敷尔佳	294	11,048.52	0.00
37	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
38	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
39	688612	威迈斯	275	10,441.75	0.00
40	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
41	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
42	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
43	301261	恒工精密	198	10,068.30	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	601083	锦江航运	868	9,608.76	0.00
47	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
48	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
49	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
50	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
51	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
52	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
53	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
54	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
55	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
56	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
57	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00

58	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
59	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
60	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
61	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
62	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
63	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
64	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
65	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
66	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
67	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
68	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
69	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
70	301555	惠柏新材	224	7,266.56	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	603275	众辰科技	150	5,955.00	0.00
78	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
79	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
80	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
81	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
82	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
83	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
84	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
85	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
86	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
87	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
88	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
89	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
90	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	3,330,086.00	0.64
2	002463	沪电股份	2,577,564.00	0.50
3	300394	天孚通信	2,372,585.54	0.46

4	000066	中国长城	2,356,351.00	0.45
5	002517	恺英网络	2,310,726.00	0.45
6	000423	东阿阿胶	2,194,212.00	0.42
7	000933	神火股份	2,074,153.00	0.40
8	688122	西部超导	2,068,635.46	0.40
9	688072	拓荆科技	2,062,129.60	0.40
10	301236	软通动力	2,020,835.00	0.39
11	300395	菲利华	1,972,115.00	0.38
12	300207	欣旺达	1,937,908.00	0.37
13	000723	美锦能源	1,884,977.00	0.36
14	300601	康泰生物	1,879,507.00	0.36
15	002240	盛新锂能	1,875,237.00	0.36
16	002008	大族激光	1,854,050.00	0.36
17	300308	中际旭创	1,849,563.00	0.36
18	688114	华大智造	1,764,686.45	0.34
19	600372	中航机载	1,749,869.12	0.34
20	002607	中公教育	1,745,006.00	0.34

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	300308	中际旭创	6,768,800.74	1.30
2	688256	寒武纪	3,072,994.98	0.59
3	600489	中金黄金	2,766,837.00	0.53
4	600372	中航机载	2,595,774.16	0.50
5	000807	云铝股份	2,489,460.69	0.48
6	300832	新产业	2,249,233.00	0.43
7	600487	亨通光电	2,157,204.00	0.42
8	688777	中控技术	2,142,691.10	0.41
9	688122	西部超导	2,127,880.10	0.41
10	603345	安井食品	2,093,305.00	0.40
11	000999	华润三九	2,011,035.60	0.39
12	601607	上海医药	1,955,687.00	0.38
13	002603	以岭药业	1,903,193.49	0.37
14	603605	珀莱雅	1,750,285.48	0.34
15	300168	万达信息	1,617,583.00	0.31
16	600705	中航产融	1,572,624.00	0.30
17	600027	华电国际	1,555,690.00	0.30
18	603606	东方电缆	1,547,272.00	0.30
19	601699	潞安环能	1,539,401.00	0.30
20	601872	招商轮船	1,505,210.00	0.29

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	236,511,740.30
卖出股票收入（成交）总额	183,953,387.69

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	36,401.12	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,401.12	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127102	浙建转债	364	36,401.12	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,128,670.68
2	应收清算款	282,371.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	18,392.79
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,429,434.71

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	300502	新易盛	493,200.00	0.09	转融通证券出借
2	300418	昆仑万维	486,200.00	0.08	转融通证券出借
3	600157	永泰能源	478,130.00	0.08	转融通证券出借
4	601058	赛轮轮胎	458,250.00	0.08	转融通证券出借

5	000988	华工科技	446,400.00	0.08	转融通证券出借
6	002463	沪电股份	442,400.00	0.08	转融通证券出借
7	000975	银泰黄金	73,500.00	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	301526	国际复材	39,191.15	0.01	新股锁定期内
2	301487	盟固利	35,512.32	0.01	新股锁定期内
3	301348	蓝箭电子	27,321.41	0.00	新股锁定期内
4	688548	广钢气体	27,132.00	0.00	新股锁定期内
5	688549	中巨芯	26,049.80	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 (%)
9,350	41,543.29	29,905,073.00	7.70	198,678,739.00	51.15	159,845,989.00	41.15

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	赵熙逸	35,715,378.00	9.19
2	中信证券股份有限公司	8,608,301.00	2.22
3	中国银河证券股份有限公司	8,000,000.00	2.06
4	山西黎氏阁家居产业发展有限公司	6,400,000.00	1.65
5	方正证券股份有限公司	2,932,006.00	0.75

6	王莹	2,000,000.00	0.51
7	李成晒	1,804,000.00	0.46
8	王春燕	1,785,000.00	0.46
9	广发证券股份有限公司	1,545,460.00	0.40
10	查琦凤	1,433,900.00	0.37

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,000.00	0.0026

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（2015年5月13日） 基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	334,429,801.00
本报告期基金总申购份额	93,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	39,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	388,429,801.00

§ 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。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 9 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 (%)	
中信建投	2	102,343,636.78	25.53	14,867.94	6.15	-
华泰证券	4	79,978,601.18	19.95	22,778.69	9.42	-
银河证券	5	70,308,405.11	17.54	64,785.35	26.80	-
国泰君安	1	70,272,546.35	17.53	66,470.01	27.50	-

国金证券	1	52,412,542.65	13.07	48,811.50	20.19	-
海通证券	2	10,345,494.80	2.58	9,748.42	4.03	-
东方证券	3	5,349,780.44	1.33	5,006.86	2.07	-
东吴证券	2	3,786,877.28	0.94	3,527.05	1.46	-
广发证券	4	2,613,677.26	0.65	2,434.32	1.01	-
兴业证券	3	2,337,311.06	0.58	2,210.97	0.91	-
国联证券	1	693,452.85	0.17	648.98	0.27	-
光大证券	2	487,345.99	0.12	456.14	0.19	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-

证券						
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

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财通证券、东北证券和广发证券。

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 (%)
中信建投	331,060.07	57.97	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	240,074.10	42.03	-	-	-	-

东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
北京高 华	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-

华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

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	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 26 日

	基金相关业务公告		
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 16 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
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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 20 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止尚智逢源(北京)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 19 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
13	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
14	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
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 11 日
16	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 08 月 10 日

	基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告		
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 08 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售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
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 02 日
20	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
21	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
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 06 月 21 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 16 日
24	关于同意东海证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 08 日
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 06 月 03 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 05 月 09 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 04 月 29 日
28	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
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 04 月 11 日
30	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
31	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		
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 21 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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 18 日
34	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 02 月 23 日
35	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与博时财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 02 月 08 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	20230101-20231231;	155,921,989.00	9,486,900.00	5,562,900.00	159,845,989.00	41.15

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日