

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券
投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 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	60

7.7 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	60
7.8 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	60
7.9 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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 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	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
11.1 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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF
场内简称	300ETF(扩位证券简称: 沪深 300ETF)
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,739,687,690.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合, 追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 股票最低仓位为 95%, 并采用完全复制的被动式投资策略: 一方面, 相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高, 属于股票型基金中高风险、高收益的产品; 另一方面, 相对于采用抽样复制的指数型基金而言, 其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95588
传真	021-38601799	010-66105798
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200135	100140

法定代表人	贾波	廖林
-------	----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,519,933,176.36
本期利润	5,581,163,734.98
加权平均基金份额本期利润	0.1066
本期加权平均净值利润率	3.04%
本期基金份额净值增长率	1.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	48,077,934,519.24
期末可供分配基金份额利润	0.7915
期末基金资产净值	211,819,198,907.26
期末基金份额净值	3.4873
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	56.19%

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

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

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

3.2 基金净值表现

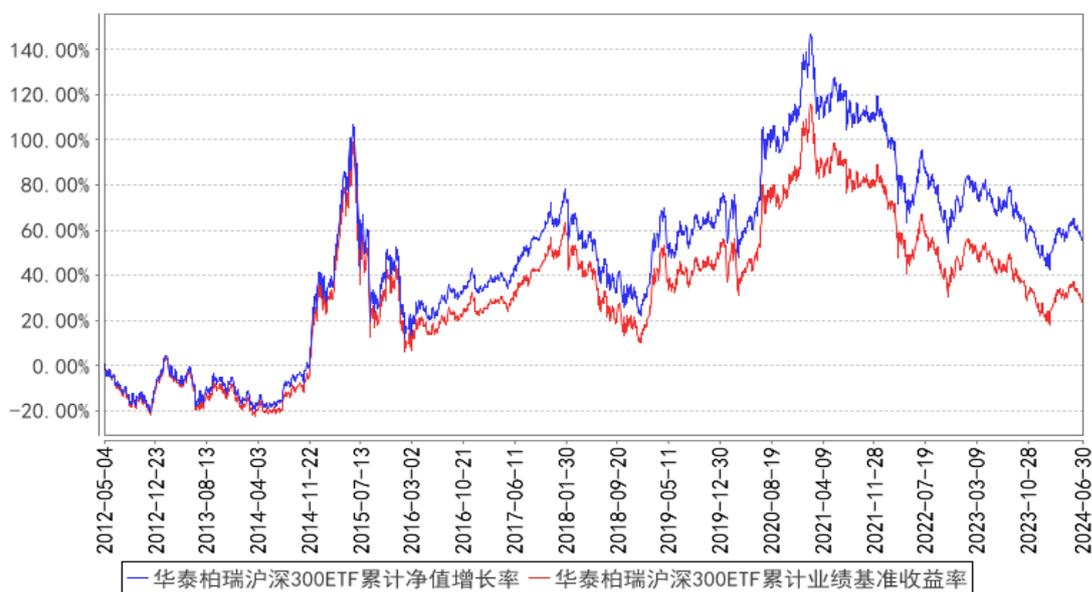
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	-2.57%	0.48%	-3.30%	0.48%	0.73%	0.00%
过去三个月	-1.17%	0.75%	-2.14%	0.76%	0.97%	-0.01%
过去六个月	1.74%	0.89%	0.89%	0.90%	0.85%	-0.01%
过去一年	-8.21%	0.87%	-9.91%	0.87%	1.70%	0.00%
过去三年	-30.21%	1.04%	-33.74%	1.05%	3.53%	-0.01%
自基金合同生效起至今	56.19%	1.35%	28.61%	1.36%	27.58%	-0.01%

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

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



注：图示日期为 2012 年 5 月 4 日至 2024 年 6 月 30 日。

§ 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%。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下管理 156 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

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		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	-	6 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2012 年 5 月 4 日	-	23 年	复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 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

				<p>易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 3 次，都为指数投资组合因跟踪指数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

2024 年上半年市场以结构性机会为主，其中银行、煤炭、公用事业、家用电器的表现相对较好，涨跌幅分别为 17.02%、11.96%、11.76% 和 8.48%。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 0.89%、-8.96%、-16.84% 和 -10.99%。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 12.54% 和 -7.00%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

2024 年一季度指数先抑后扬，二季度区间振荡，上半年总体来看大盘蓝筹相关指数普遍实现了正收益。随着积极政策的陆续出台，比如 517 房地产“组合拳”、超长期国债的发行等，投资者情绪有望逐步修复。5 月下旬开始，A 股有所调整但调整节奏相较年初明显放缓，市场已逐渐从过度悲观的预期中走出。基本面方面，4-5 月的经济增长数据显示修复过程仍面临诸多挑战，包括有效需求不足、企业经营压力较大等，但外需和设备更新等对经济数据有所支撑，工业生产稳定增长，制造业增速维持韧性。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.013%，期间日跟踪误差为 0.025%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.4873 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.74%，业绩比较基准收益率为 0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观范式转变下中外金融周期分化，结合积极的稳增长政策及中长期改革，经济动能有望继续温和改善，大盘风格或将持续具有相对收益，建议寻找结构性机会。中期来看，随着中国经济迎来新一轮盈利周期、中美经济周期错位进入下半场等利好因素下，A 股市场的估值比较具吸引力，性价比突出，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。本报告期内，本基金符合分红条件，于 2024 年 1 月 18 日进行分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.69 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,314,662,830.75	557,763,846.81
结算备付金		1,415,778,327.80	1,178,798,737.04
存出保证金		196,388,203.40	150,070,827.81
交易性金融资产	6.4.7.2	209,189,425,003.64	129,302,062,860.16
其中：股票投资		209,189,425,003.64	129,302,062,860.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,741,463.70	292,464,049.18
应收股利		552,111.70	74,250.20
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	23,576.14	1,054,977.37
资产总计		212,118,571,517.13	131,482,289,548.57
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		377,596.82	2,096,681.51
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		29,753,067.09	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		82,843,577.65	47,802,161.66
应付托管费		16,568,715.52	9,560,432.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	169,829,652.79	336,266,006.46
负债合计		299,372,609.87	395,725,281.95
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	163,741,264,388.02	100,941,287,233.56
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	48,077,934,519.24	30,145,277,033.06
净资产合计		211,819,198,907.26	131,086,564,266.62
负债和净资产总计		212,118,571,517.13	131,482,289,548.57

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.4873 元，基金份额总额 60,739,687,690.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,158,378,873.59	945,605,057.85
1. 利息收入		16,565,226.75	31,573,133.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,293,868.57	7,225,668.62
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		6,271,358.18	24,347,464.41

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-947,832,248.53	241,391,012.99
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,351,011,421.35	-504,503,668.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	3,191,438.70
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	91,376,806.57	-23,712,340.06
股利收益	6.4.7.19	2,311,802,366.25	766,415,582.77
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）	6.4.7.20	7,101,096,911.34	651,851,482.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-11,451,015.97	20,789,429.19
减：二、营业总支出		577,215,138.61	222,937,941.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	457,550,092.44	176,652,571.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,510,018.53	35,330,514.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		514,276.07	17,915.29
8. 其他费用	6.4.7.23	27,640,751.57	10,936,940.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,581,163,734.98	722,667,116.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,581,163,734.98	722,667,116.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,581,163,734.98	722,667,116.35

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	100,941,287,23 3.56	-	30,145,277,033 .06	131,086,564,266 .62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	100,941,287,23 3.56	-	30,145,277,033 .06	131,086,564,266 .62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	62,799,977,154 .46	-	17,932,657,486 .18	80,732,634,640. 64
(一)、综合收益总额	-	-	5,581,163,734. 98	5,581,163,734.9 8
(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)	62,799,977,154 .46	-	14,845,587,602 .90	77,645,564,757. 36
其中：1. 基金申购款	96,817,844,537 .91	-	24,846,776,867 .42	121,664,621,405 .33
2. 基金赎回款	-34,017,867,38 3.45	-	-10,001,189,26 4.52	-44,019,056,647 .97
(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)	-	-	-2,494,093,851 .70	-2,494,093,851. 70
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	163,741,264,38 8.02	-	48,077,934,519 .24	211,819,198,907 .26

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	53,084,327,381 .63	-	24,418,175,843 .72	77,502,503,225. 35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	53,084,327,381 .63	-	24,418,175,843 .72	77,502,503,225. 35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,154,070,870 .82	-	-2,477,926,955 .21	-5,631,997,826. 03
(一)、综合收益总额	-	-	722,667,116.35	722,667,116.35
(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)	-3,154,070,870 .82	-	-2,007,378,860 .01	-5,161,449,730. 83
其中：1. 基金申购款	26,559,702,899 .13	-	13,032,253,597 .03	39,591,956,496. 16
2. 基金赎回款	-29,713,773,76 9.95	-	-15,039,632,45 7.04	-44,753,406,226 .99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-1,193,215,211 .55	-1,193,215,211. 55
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	49,930,256,510 .81	-	21,940,248,888 .51	71,870,505,399. 32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,297,269.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933，并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2012]14 号文审核同意，本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数沪深 300 指数成份股、备选成份股为主要投资对象；此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证、债券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞

沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”)。华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2024 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,314,662,830.75
等于：本金	1,314,538,755.45
加：应计利息	124,075.30
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,314,662,830.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	215,968,839,813.72	-	209,189,425,003.64	-6,779,414,810.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	215,968,839,813.72	-	209,189,425,003.64	-6,779,414,810.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,570,466,880.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	1,570,466,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,570,466,880.00	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IF2407	沪深 300 股指 期货 2407	1,500.00	1,546,650,000.00	-23,816,880.00
合计				-23,816,880.00
减：可抵销期货 暂收款				-23,816,880.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	23,576.14
待摊费用	-
合计	23,576.14

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	3,390,530.01
其中：交易所市场	3,390,530.01
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	159,126.24
应付指数使用费	15,020,928.41
其他应付款	500,000.00
应退退补款	150,759,068.13
合计	169,829,652.79

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,444,087,690.00	100,941,287,233.56
本期申购	35,914,500,000.00	96,817,844,537.91
本期赎回（以“-”号填列）	-12,618,900,000.00	-34,017,867,383.45
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	60,739,687,690.00	163,741,264,388.02

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。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118,407,469,939.70	-88,262,192,906.64	30,145,277,033.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	118,407,469,939.70	-88,262,192,906.64	30,145,277,033.06
本期利润	-1,519,933,176.36	7,101,096,911.34	5,581,163,734.98
本期基金份额交易产生的变动数	70,561,388,679.99	-55,715,801,077.09	14,845,587,602.90
其中：基金申购款	109,038,133,785.90	-84,191,356,918.48	24,846,776,867.42
基金赎回款	-38,476,745,105.91	28,475,555,841.39	-10,001,189,264.52
本期已分配利润	-2,494,093,851.70	-	-2,494,093,851.70
本期末	184,954,831,591.63	-136,876,897,072.39	48,077,934,519.24

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,527,045.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,683,946.83
其他	82,876.52
合计	10,293,868.57

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,936,298,538.57
股票投资收益——赎回差价收入	-414,712,882.78
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	-3,351,011,421.35

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,290,218,162.58
减：卖出股票成本总额	27,194,455,936.01
减：交易费用	32,060,765.14
买卖股票差价收入	-2,936,298,538.57

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	44,019,056,647.97
减：现金支付赎回款总额	16,503,272,227.97
减：赎回股票成本总额	27,930,497,302.78
减：交易费用	-
赎回差价收入	-414,712,882.78

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	91,376,806.57

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,311,802,366.25
其中：证券出借权益补偿收入	1,077,424.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,311,802,366.25

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,138,879,331.34
股票投资	7,138,879,331.34
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-37,782,420.00
权证投资	-
期货投资	-37,782,420.00
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	7,101,096,911.34

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-11,451,015.97

合计	-11,451,015.97
----	----------------

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。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	99,453.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	27,453,005.56
注册登记费	23,424.72
银行划款手续费	5,195.05
合计	27,640,751.57

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

6.4.7.24 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，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	18,720,057,057.29	25.59	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	7,073,751.36	47.94	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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 (%)
-	-	-	-	-

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（截至 2024 年 6 月 30 日）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	457,550,092.44
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	457,550,092.44	176,652,571.62

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	91,510,018.53

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	6,347,746,486.00	5,097,352.61	195,578,475.00	67,583.40

6.4.10.4.2 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2,509,494,979.40	1.00~5.33	2.96	3,049,599.78	46,006,892.20	17,388.05
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2,874,454,016.00	1.80~3.50	3.27	3,258,768.06	529,184,434.00	230,389.32

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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	643,344,065.00	1.0592	733,226,365.00	1.9582
华泰证券股份有限公司	96,477,226.00	0.1588	279,125,506.00	0.7454

6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,314,662,830.75	1,527,045.22	537,725,236.60	489,570.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	688709	成都华微	网下申购	10,448	163929.12
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26705.80
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	1,296	37609.92
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66406.88
上年度可比期间					

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
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	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	118031	天 23 转债	网上配售	147,310	14,731,000.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 1 月 18 日	2024 年 1 月 18 日	-	0.6900	2,494,093,851.70	-	2,494,093,851.70	-
合计	-	-	-	0.6900	2,494,093,851.70	-	2,494,093,851.70	-

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-

	技	日								
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期内	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定期内	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定期内	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期内	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定期内	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定期内	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	新股锁定期内	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定期内	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股	2024年3月27日	6个月	新股锁定期内	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

	份	日								
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定期内	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定期内	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定期内	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定期内	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-

		日								
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定期内	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定期内	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定期内	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期内	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期内	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期内	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000001	平安银行	2024 年 7 月 9 日	10.15	8,100	82,215.00
2	000002	万科 A	2024 年 7 月 9 日	6.93	810,700	5,618,151.00
3	000166	申万宏源	2024 年 7 月 9 日	4.31	19,800	85,338.00
4	000301	东方盛虹	2024 年 7 月 9 日	7.97	7,900	62,963.00
5	000338	潍柴动力	2024 年 7 月 9 日	16.24	7,500	121,800.00
6	000408	藏格矿业	2024 年 7 月 9 日	24.07	9,200	221,444.00
7	000538	云南白药	2024 年 7 月 9 日	51.15	3,600	184,140.00
8	000568	泸州老窖	2024 年 7 月 9 日	143.49	2,000	286,980.00
9	000596	古井贡酒	2024 年 7 月 9 日	211.07	1,000	211,070.00
10	000617	中油资本	2024 年 7 月 9 日	5.52	13,500	74,520.00

11	000733	振华科技	2024 年 7 月 9 日	41.53	451,100	18,734,183.00
12	000786	北新建材	2024 年 7 月 9 日	29.66	19,900	590,234.00
13	000876	新希望	2024 年 7 月 9 日	9.14	7,900	72,206.00
14	000895	双汇发展	2024 年 7 月 9 日	23.77	11,200	266,224.00
15	000963	华东医药	2024 年 7 月 9 日	27.81	4,600	127,926.00
16	000977	浪潮信息	2024 年 7 月 9 日	36.37	23,500	854,695.00
17	000983	山西焦煤	2024 年 7 月 9 日	10.31	22,000	226,820.00
18	001289	龙源电力	2024 年 7 月 9 日	17.25	4,900	84,525.00
19	001979	招商蛇口	2024 年 7 月 9 日	8.79	7,000	61,530.00
20	002049	紫光国微	2024 年 7 月 9 日	52.6	1,000	52,600.00
21	002050	三花智控	2024 年 7 月 9 日	19.08	3,500	66,780.00
22	002074	国轩高科	2024 年 7 月 9 日	19.15	7,100	135,965.00
23	002129	TCL 中环	2024 年 7 月 9 日	8.65	47,500	410,875.00
24	002142	宁波银行	2024 年 7 月 9 日	22.06	3,400	75,004.00
25	002180	纳思达	2024 年 7 月 9 日	26.42	2,900	76,618.00
26	002230	科大讯飞	2024 年 7 月 9 日	42.95	1,500	64,425.00
27	002236	大华股份	2024 年 7 月 9 日	15.46	8,800	136,048.00
28	002304	洋河股份	2024 年 7 月 9 日	80.74	2,000	161,480.00
29	002311	海大集团	2024 年 7 月 9 日	47.05	1,900	89,395.00
30	002371	北方华创	2024 年 7 月 9 日	319.89	1,000	319,890.00
31	002410	广联达	2024 年 7 月 9 日	9.58	3,000	28,740.00
32	002459	晶澳科技	2024 年 7 月 9 日	11.2	11,800	132,160.00
33	002460	赣锋锂业	2024 年 7 月 9 日	28.65	43,800	1,254,870.00
34	002493	荣盛石	2024 年 7 月 9 日	9.66	5,700	55,062.00

		化				
35	002812	恩捷股份	2024 年 7 月 9 日	31.65	1,000	31,650.00
36	002916	深南电路	2024 年 7 月 9 日	105.77	1,300	137,501.00
37	002920	德赛西威	2024 年 7 月 9 日	87.09	1,000	87,090.00
38	002938	鹏鼎控股	2024 年 7 月 9 日	39.76	8,000	318,080.00
39	300014	亿纬锂能	2024 年 7 月 9 日	39.92	3,100	123,752.00
40	300015	爱尔眼科	2024 年 7 月 9 日	10.32	9,800	101,136.00
41	300059	东方财富	2024 年 7 月 9 日	10.56	6,200	65,472.00
42	300124	汇川技术	2024 年 7 月 9 日	51.3	1,400	71,820.00
43	300142	沃森生物	2024 年 7 月 9 日	11.38	3,600	40,968.00
44	300347	泰格医药	2024 年 7 月 9 日	48.6	2,800	136,080.00
45	300450	先导智能	2024 年 7 月 9 日	16.63	3,000	49,890.00
46	300498	温氏股份	2024 年 7 月 9 日	19.82	10,400	206,128.00
47	300661	圣邦股份	2024 年 7 月 9 日	82.78	1,100	91,058.00
48	300751	迈为股份	2024 年 7 月 9 日	119.48	1,000	119,480.00
49	300759	康龙化成	2024 年 7 月 9 日	18.58	7,000	130,060.00
50	300760	迈瑞医疗	2024 年 7 月 9 日	290.91	1,000	290,910.00
51	300896	爱美客	2024 年 7 月 9 日	172.1	1,400	240,940.00
52	300957	贝泰妮	2024 年 7 月 9 日	48.32	1,000	48,320.00
53	300979	华利集团	2024 年 7 月 9 日	60.85	10,200	620,670.00
54	300999	金龙鱼	2024 年 7 月 9 日	27.35	4,600	125,810.00
55	600009	上海机场	2024 年 7 月 9 日	32.25	18,600	599,850.00
56	600011	华能国际	2024 年 7 月 9 日	9.62	23,200	223,184.00

57	600015	华夏银行	2024 年 7 月 9 日	6.4	30,400	194,560.00
58	600016	民生银行	2024 年 7 月 9 日	3.79	24,800	93,992.00
59	600025	华能水电	2024 年 7 月 9 日	10.78	14,200	153,076.00
60	600029	南方航空	2024 年 7 月 9 日	5.89	14,300	84,227.00
61	600030	中信证券	2024 年 7 月 9 日	18.23	4,100	74,743.00
62	600048	保利发展	2024 年 7 月 9 日	8.76	7,000	61,320.00
63	600061	国投资本	2024 年 7 月 9 日	5.65	146,600	828,290.00
64	600089	特变电工	2024 年 7 月 9 日	13.87	8,800	122,056.00
65	600111	北方稀土	2024 年 7 月 9 日	17.2	8,300	142,760.00
66	600132	重庆啤酒	2024 年 7 月 9 日	60.7	2,200	133,540.00
67	600150	中国船舶	2024 年 7 月 9 日	40.71	2,900	118,059.00
68	600196	复星医药	2024 年 7 月 9 日	22.14	57,000	1,261,980.00
69	600219	南山铝业	2024 年 7 月 9 日	3.81	30,800	117,348.00
70	600362	江西铜业	2024 年 7 月 9 日	23.68	5,000	118,400.00
71	600406	国电南瑞	2024 年 7 月 9 日	24.96	4,100	102,336.00
72	600426	华鲁恒升	2024 年 7 月 9 日	26.64	2,300	61,272.00
73	600436	片仔癀	2024 年 7 月 9 日	207.17	2,000	414,340.00
74	600438	通威股份	2024 年 7 月 9 日	19.11	4,000	76,440.00
75	600460	士兰微	2024 年 7 月 9 日	17.51	120,700	2,113,457.00
76	600570	恒生电子	2024 年 7 月 9 日	17.66	4,600	81,236.00
77	600585	海螺水泥	2024 年 7 月 9 日	23.59	7,200	169,848.00
78	600600	青岛啤酒	2024 年 7 月 9 日	72.77	2,000	145,540.00

79	600741	华域汽车	2024年7月9日	16.38	10,000	163,800.00
80	600795	国电电力	2024年7月9日	5.99	27,100	162,329.00
81	600803	新奥股份	2024年7月9日	20.8	5,400	112,320.00
82	600837	海通证券	2024年7月9日	8.56	9,600	82,176.00
83	601006	大秦铁路	2024年7月9日	7.16	27,300	195,468.00
84	601012	隆基绿能	2024年7月9日	14.02	3,300	46,266.00
85	601021	春秋航空	2024年7月9日	56.33	1,600	90,128.00
86	601066	中信建投	2024年7月9日	19.24	7,400	142,376.00
87	601100	恒立液压	2024年7月9日	46.58	15,100	703,358.00
88	601138	工业富联	2024年7月9日	27.4	4,400	120,560.00
89	601186	中国铁建	2024年7月9日	8.57	114,100	977,837.00
90	601225	陕西煤业	2024年7月9日	25.77	12,200	314,394.00
91	601288	农业银行	2024年7月9日	4.36	27,600	120,336.00
92	601360	三六零	2024年7月9日	7.68	191,200	1,468,416.00
93	601398	工商银行	2024年7月9日	5.7	20,900	119,130.00
94	601633	长城汽车	2024年7月9日	25.3	6,600	166,980.00
95	601668	中国建筑	2024年7月9日	5.31	16,300	86,553.00
96	601669	中国电建	2024年7月9日	5.59	53,200	297,388.00
97	601689	拓普集团	2024年7月9日	53.61	1,300	69,693.00
98	601698	中国卫通	2024年7月9日	14.09	41,400	583,326.00
99	601788	光大证券	2024年7月9日	14.62	106,800	1,561,416.00
100	601799	星宇股份	2024年7月9日	112.04	8,200	918,728.00

101	601816	京沪高铁	2024 年 7 月 9 日	5.37	18,200	97,734.00
102	601838	成都银行	2024 年 7 月 9 日	15.19	7,000	106,330.00
103	601865	福莱特	2024 年 7 月 9 日	20.1	2,800	56,280.00
104	601888	中国中免	2024 年 7 月 9 日	62.49	1,000	62,490.00
105	601898	中煤能源	2024 年 7 月 9 日	12.48	175,400	2,188,992.00
106	601901	方正证券	2024 年 7 月 9 日	7.73	13,800	106,674.00
107	601919	中远海控	2024 年 7 月 9 日	15.49	19,600	303,604.00
108	601989	中国重工	2024 年 7 月 9 日	4.93	20,700	102,051.00
109	601995	中金公司	2024 年 7 月 9 日	29.61	5,000	148,050.00
110	601998	中信银行	2024 年 7 月 9 日	6.7	91,100	610,370.00
111	603019	中科曙光	2024 年 7 月 9 日	41.5	2,200	91,300.00
112	603195	公牛集团	2024 年 7 月 9 日	77.12	11,165	861,044.80
113	603259	药明康德	2024 年 7 月 9 日	39.19	2,600	101,894.00
114	603260	合盛硅业	2024 年 7 月 9 日	46.71	2,600	121,446.00
115	603288	海天味业	2024 年 7 月 9 日	34.47	2,100	72,387.00
116	603369	今世缘	2024 年 7 月 9 日	46.2	1,600	73,920.00
117	603392	万泰生物	2024 年 7 月 9 日	65.88	7,400	487,512.00
118	603659	璞泰来	2024 年 7 月 9 日	14.13	2,500	35,325.00
119	603833	欧派家居	2024 年 7 月 9 日	53.56	4,400	235,664.00
120	603899	晨光股份	2024 年 7 月 9 日	31.28	30,300	947,784.00
121	603986	兆易创新	2024 年 7 月 9 日	95.62	1,000	95,620.00
122	603993	洛阳钼业	2024 年 7 月 9 日	8.5	16,200	137,700.00
123	605117	德业股份	2024 年 7 月 9 日	74.34	30,940	2,300,079.60
124	688036	传音控	2024 年 7 月 9 日	76.54	1,400	107,156.00

		股				0
125	688126	沪硅产业	2024 年 7 月 9 日	13.81	4,700	64,907.00
126	688223	晶科能源	2024 年 7 月 9 日	7.1	8,000	56,800.00
127	688303	大全能源	2024 年 7 月 9 日	20.39	2,400	48,936.00
128	688363	华熙生物	2024 年 7 月 9 日	56.57	3,300	186,681.00
129	688396	华润微	2024 年 7 月 9 日	37.44	1,700	63,648.00
130	688599	天合光能	2024 年 7 月 9 日	16.92	2,600	43,992.00
合计	-	-	-	-	3,409,005	59,974,894.40

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 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 2024 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12。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 2024 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,314,662,830.75	-	-	-	-	-	1,314,662,830.75
结算备付金	1,415,778,327.80	-	-	-	-	-	1,415,778,327.80
存出保证金	196,388,203.40	-	-	-	-	-	196,388,203.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	209,189,425,003.64	209,189,425,003.64
应收股利	-	-	-	-	-	552,111.70	552,111.70
应收清算款	-	-	-	-	-	1,741,463.70	1,741,463.70
其他资产	-	-	-	-	-	23,576.14	23,576.14
资产总计	2,926,829,361.95	-	-	-	-	209,191,742,155.18	212,118,571,517.13
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	377,596.82	377,596.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	82,843,577.65	82,843,577.65
应付托管费	-	-	-	-	-	16,568,715.52	16,568,715.52
应付清算款	-	-	-	-	-	29,753,067.09	29,753,067.09
其他负债	-	-	-	-	-	169,829,652.79	169,829,652.79
负债总计	-	-	-	-	-	299,372,609.87	299,372,609.87
利率敏感度缺口	2,926,829,361.95	-	-	-	-	208,892,369,545.31	211,819,198,907.26
上年度末 2023年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	557,763,846.81	-	-	-	-	-	557,763,846.81
结算备付金	1,178,798,737.04	-	-	-	-	-	1,178,798,737.04
存出保证金	7,663,107.81	-	-	-	-	142,407,720.00	150,070,827.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	129,302,062,860.16	129,302,062,860.16
应收股利	-	-	-	-	-	74,250.20	74,250.20
应收清算款	-	-	-	-	-	292,464,049.18	292,464,049.18
其他资产	-	-	-	-	-	1,054,977.37	1,054,977.37
资产总计	1,744,225,691.66	-	-	-	-	129,738,063,856.91	131,482,289,548.57
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	2,096,681.51	2,096,681.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,802,161.66	47,802,161.66

应付托管费	-	-	-	-	-	9,560,432.32	9,560,432.32
其他负债	-	-	-	-	-	336,266,006.46	336,266,006.46
负债总计	-	-	-	-	-	395,725,281.95	395,725,281.95
利率敏感度缺口	1,744,225,691.66	-	-	-	-	-129,342,338,574.96	131,086,564,266.62

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	209,189,425,003.64	98.76	129,302,062,860.16	98.64
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	-377,596.82	-0.00	-2,096,681.51	-
合计	209,189,047,406.82	98.76	129,299,966,178.65	98.64

注：其他为可退替代款。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	10,455,775,502.71	6,494,416,013.28
	沪深 300 指数下降 5%	-10,455,775,502.71	-6,494,416,013.28

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	209,188,880,444.46	129,300,832,868.14
第二层次	45,611.11	-
第三层次	498,948.07	1,229,992.02
合计	209,189,425,003.64	129,302,062,860.16

6.4.14.2.2 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	209,189,425,003.64	98.62
	其中：股票	209,189,425,003.64	98.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,730,441,158.55	1.29
8	其他各项资产	198,705,354.94	0.09
9	合计	212,118,571,517.13	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 59,974,894.40 元，占

本基金期末资产净值的 0.03%。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 46,006,892.20 元。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,653,701,220.10	1.25
B	采矿业	12,771,781,744.43	6.03
C	制造业	108,974,216,112.02	51.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,729,303,342.91	4.59
E	建筑业	4,681,646,721.99	2.21
F	批发和零售业	546,149,805.93	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	7,833,495,334.56	3.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,370,344,565.15	4.42
J	金融业	46,784,817,996.47	22.09
K	房地产业	1,929,497,738.33	0.91
L	租赁和商务服务业	1,687,655,954.90	0.80
M	科学研究和技术服务业	1,659,313,824.07	0.78
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	566,956,083.60	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	209,188,880,444.46	98.76

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 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	477,500.48	0.00
D	电力、热力、燃气	-	-

	及水生产和供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
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	544,559.18	0.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 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。

7.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,391,811	10,846,669,543.29	5.12
2	300750	宁德时代	31,308,216	5,636,418,126.48	2.66
3	601318	中国平安	127,071,672	5,255,684,353.92	2.48
4	600036	招商银行	146,200,183	4,998,584,256.77	2.36
5	600900	长江电力	140,873,984	4,074,075,617.28	1.92
6	000333	美的集团	57,830,940	3,730,095,630.00	1.76
7	601899	紫金矿业	194,612,329	3,419,338,620.53	1.61
8	601166	兴业银行	171,738,510	3,026,032,546.20	1.43
9	000858	五粮液	22,838,574	2,924,251,014.96	1.38
10	002594	比亚迪	10,877,920	2,722,199,480.00	1.29

11	601328	交通银行	324,028,432	2,420,492,387.04	1.14
12	601398	工商银行	413,766,857	2,358,471,084.90	1.11
13	002475	立讯精密	59,350,596	2,333,071,928.76	1.10
14	600030	中信证券	115,248,868	2,100,986,863.64	0.99
15	000651	格力电器	53,232,721	2,087,787,317.62	0.99
16	300760	迈瑞医疗	7,140,949	2,077,373,473.59	0.98
17	600276	恒瑞医药	52,740,249	2,028,389,976.54	0.96
18	600887	伊利股份	75,020,023	1,938,517,394.32	0.92
19	600309	万华化学	22,217,278	1,796,489,099.08	0.85
20	000725	京东方 A	436,417,047	1,784,945,722.23	0.84
21	601088	中国神华	39,001,229	1,730,484,530.73	0.82
22	601288	农业银行	376,809,706	1,642,890,318.16	0.78
23	300059	东方财富	149,151,090	1,575,035,510.40	0.74
24	601816	京沪高铁	289,531,690	1,554,785,175.30	0.73
25	300308	中际旭创	10,731,351	1,479,638,675.88	0.70
26	002714	牧原股份	32,330,137	1,409,593,973.20	0.67
27	601857	中国石油	133,727,914	1,380,072,072.48	0.65
28	002415	海康威视	44,238,656	1,367,416,856.96	0.65
29	601668	中国建筑	245,781,145	1,305,097,879.95	0.62
30	600919	江苏银行	174,252,791	1,294,698,237.13	0.61
31	601138	工业富联	46,866,688	1,284,147,251.20	0.61
32	600690	海尔智家	44,815,729	1,271,870,389.02	0.60
33	300498	温氏股份	62,770,295	1,244,107,246.90	0.59
34	002371	北方华创	3,882,897	1,242,099,921.33	0.59
35	000568	泸州老窖	8,632,935	1,238,739,843.15	0.58
36	600809	山西汾酒	5,825,900	1,228,565,792.00	0.58
37	601985	中国核电	111,603,594	1,189,694,312.04	0.56
38	600406	国电南瑞	47,363,384	1,182,190,064.64	0.56
39	601225	陕西煤业	45,830,666	1,181,056,262.82	0.56
40	601919	中远海控	75,168,292	1,164,356,843.08	0.55
41	000001	平安银行	114,466,138	1,161,831,300.70	0.55
42	603259	药明康德	29,614,047	1,160,574,501.93	0.55
43	600941	中国移动	10,793,117	1,160,260,077.50	0.55
44	600031	三一重工	69,923,475	1,153,737,337.50	0.54
45	601988	中国银行	248,586,069	1,148,467,638.78	0.54
46	600000	浦发银行	138,715,102	1,141,625,289.46	0.54
47	300124	汇川技术	22,207,964	1,139,268,553.20	0.54
48	601728	中国电信	183,072,151	1,125,893,728.65	0.53
49	601601	中国太保	40,361,040	1,124,458,574.40	0.53
50	000792	盐湖股份	64,329,816	1,122,555,289.20	0.53
51	600028	中国石化	173,662,420	1,097,546,494.40	0.52
52	601766	中国中车	143,365,699	1,076,676,399.49	0.51
53	600150	中国船舶	26,414,300	1,075,326,153.00	0.51

54	300274	阳光电源	17,332,386	1,075,127,903.58	0.51
55	688981	中芯国际	23,125,468	1,066,084,074.80	0.50
56	600050	中国联通	225,300,655	1,058,913,078.50	0.50
57	000063	中兴通讯	37,793,205	1,057,075,943.85	0.50
58	000338	潍柴动力	64,243,786	1,043,319,084.64	0.49
59	002352	顺丰控股	28,787,595	1,027,429,265.55	0.49
60	601169	北京银行	174,661,391	1,020,022,523.44	0.48
61	601012	隆基绿能	71,702,023	1,005,262,362.46	0.47
62	603501	韦尔股份	10,098,150	1,003,453,165.50	0.47
63	600837	海通证券	113,941,481	975,339,077.36	0.46
64	600016	民生银行	252,872,877	958,388,203.83	0.45
65	000100	TCL 科技	221,615,930	957,380,817.60	0.45
66	002230	科大讯飞	21,775,485	935,257,080.75	0.44
67	600660	福耀玻璃	18,999,912	910,095,784.80	0.43
68	002142	宁波银行	39,304,720	867,062,123.20	0.41
69	601229	上海银行	117,595,667	853,744,542.42	0.40
70	600089	特变电工	59,678,474	827,740,434.38	0.39
71	600938	中国海油	24,832,378	819,468,474.00	0.39
72	601390	中国中铁	121,205,471	790,259,670.92	0.37
73	000625	长安汽车	58,745,244	788,948,626.92	0.37
74	688041	海光信息	11,135,149	783,023,677.68	0.37
75	600436	片仔癀	3,773,759	781,809,652.03	0.37
76	600104	上汽集团	54,577,711	756,447,074.46	0.36
77	601688	华泰证券	60,333,705	747,534,604.95	0.35
78	603986	兆易创新	7,794,397	745,300,241.14	0.35
79	600048	保利发展	84,936,373	744,042,627.48	0.35
80	601006	大秦铁路	103,168,033	738,683,116.28	0.35
81	600905	三峡能源	168,794,000	735,941,840.00	0.35
82	601888	中国中免	11,661,138	728,704,513.62	0.34
83	002027	分众传媒	119,416,374	723,663,226.44	0.34
84	601211	国泰君安	53,228,980	721,252,679.00	0.34
85	603019	中科曙光	17,256,985	716,164,877.50	0.34
86	601600	中国铝业	93,615,129	714,283,434.27	0.34
87	603993	洛阳钼业	83,186,343	707,083,915.50	0.33
88	688012	中微公司	4,996,501	705,805,731.26	0.33
89	600019	宝钢股份	104,658,101	695,976,371.65	0.33
90	601818	光大银行	219,265,107	695,070,389.19	0.33
91	603288	海天味业	19,715,391	679,589,527.77	0.32
92	600585	海螺水泥	28,217,992	665,662,431.28	0.31
93	601658	邮储银行	131,274,600	665,562,222.00	0.31
94	601989	中国重工	134,536,738	663,266,118.34	0.31
95	600886	国投电力	35,053,099	639,368,525.76	0.30
96	601009	南京银行	61,007,633	633,869,306.87	0.30

97	600795	国电电力	105,424,197	631,490,940.03	0.30
98	688008	澜起科技	10,905,774	623,374,041.84	0.29
99	600999	招商证券	44,039,380	612,587,775.80	0.29
100	601628	中国人寿	19,707,333	611,912,689.65	0.29
101	600438	通威股份	31,995,317	611,430,507.87	0.29
102	000938	紫光股份	27,004,338	603,546,954.30	0.28
103	000425	徐工机械	83,759,543	598,880,732.45	0.28
104	601939	建设银行	79,364,256	587,295,494.40	0.28
105	600547	山东黄金	21,244,349	581,670,275.62	0.27
106	300014	亿纬锂能	14,408,296	575,179,176.32	0.27
107	688111	金山办公	2,513,610	571,846,275.00	0.27
108	002304	洋河股份	7,079,978	571,637,423.72	0.27
109	600893	航发动力	15,569,461	569,063,799.55	0.27
110	601669	中国电建	101,631,885	568,122,237.15	0.27
111	300015	爱尔眼科	54,937,605	566,956,083.60	0.27
112	002179	中航光电	14,744,485	561,027,654.25	0.26
113	000002	万科 A	80,364,227	556,924,093.11	0.26
114	000538	云南白药	10,733,083	548,997,195.45	0.26
115	002241	歌尔股份	28,115,293	548,529,366.43	0.26
116	600926	杭州银行	41,872,382	546,434,585.10	0.26
117	600584	长电科技	17,077,381	541,523,751.51	0.26
118	600760	中航沈飞	13,039,435	522,881,343.50	0.25
119	600111	北方稀土	29,669,084	510,308,244.80	0.24
120	600489	中金黄金	34,275,085	507,271,258.00	0.24
121	002050	三花智控	26,465,197	504,955,958.76	0.24
122	600011	华能国际	52,053,429	500,753,986.98	0.24
123	601916	浙商银行	178,384,250	492,340,530.00	0.23
124	002252	上海莱士	62,523,295	488,932,166.90	0.23
125	600015	华夏银行	75,023,066	480,147,622.40	0.23
126	600426	华鲁恒升	17,705,312	471,669,511.68	0.22
127	600009	上海机场	14,591,186	470,565,748.50	0.22
128	600958	东方证券	61,566,317	467,904,009.20	0.22
129	601186	中国铁建	54,267,850	465,075,474.50	0.22
130	000166	申万宏源	106,484,500	458,948,195.00	0.22
131	300408	三环集团	15,640,830	456,555,827.70	0.22
132	002311	海大集团	9,665,849	454,778,195.45	0.21
133	600989	宝丰能源	26,057,800	451,581,674.00	0.21
134	000157	中联重科	58,772,995	451,376,601.60	0.21
135	688256	寒武纪	2,265,858	450,158,008.86	0.21
136	601901	方正证券	57,769,447	446,557,825.31	0.21
137	000977	浪潮信息	12,244,512	445,332,901.44	0.21
138	300433	蓝思科技	23,726,689	433,012,074.25	0.20
139	003816	中国广核	92,959,500	430,402,485.00	0.20

140	600674	川投能源	22,950,696	430,325,550.00	0.20
141	000776	广发证券	34,796,636	423,475,060.12	0.20
142	002049	紫光国微	7,925,471	416,879,774.60	0.20
143	002001	新和成	21,707,021	416,774,803.20	0.20
144	688271	联影医疗	3,794,704	416,279,028.80	0.20
145	601377	兴业证券	81,471,763	412,247,120.78	0.19
146	600115	中国东航	101,075,756	405,313,781.56	0.19
147	601111	中国国航	54,822,302	404,588,588.76	0.19
148	300122	智飞生物	14,081,657	394,708,845.71	0.19
149	688036	传音控股	5,115,949	391,574,736.46	0.18
150	000768	中航西飞	16,185,455	388,936,483.65	0.18
151	002460	赣锋锂业	13,349,216	382,455,038.40	0.18
152	600029	南方航空	63,913,341	376,449,578.49	0.18
153	600010	宝钢股份	268,296,868	375,615,615.20	0.18
154	000596	古井贡酒	1,777,563	375,190,222.41	0.18
155	001979	招商蛇口	42,589,814	374,364,465.06	0.18
156	601800	中国交建	41,819,900	373,869,906.00	0.18
157	000661	长春高新	4,034,407	370,237,530.39	0.17
158	601633	长城汽车	14,552,375	368,175,087.50	0.17
159	002466	天齐锂业	12,303,257	367,990,416.87	0.17
160	002601	龙佰集团	19,764,545	367,027,600.65	0.17
161	600188	兖矿能源	16,028,980	364,338,715.40	0.17
162	002236	大华股份	23,229,530	359,128,533.80	0.17
163	000786	北新建材	12,080,511	358,307,956.26	0.17
164	002648	卫星化学	19,917,681	358,119,904.38	0.17
165	601117	中国化学	43,128,944	355,382,498.56	0.17
166	300782	卓胜微	4,571,067	355,354,748.58	0.17
167	603799	华友钴业	15,844,423	350,637,080.99	0.17
168	600346	恒力石化	25,102,929	350,185,859.55	0.17
169	002493	荣盛石化	35,678,001	344,649,489.66	0.16
170	000983	山西焦煤	33,064,129	340,891,169.99	0.16
171	603369	今世缘	7,350,199	339,579,193.80	0.16
172	601838	成都银行	22,313,011	338,934,637.09	0.16
173	300661	圣邦股份	4,077,205	337,511,029.90	0.16
174	600023	浙能电力	47,451,158	337,377,733.38	0.16
175	600372	中航机载	27,976,869	334,883,121.93	0.16
176	601788	光大证券	22,825,324	333,706,236.88	0.16
177	600845	宝信软件	10,422,541	332,791,734.13	0.16
178	688223	晶科能源	46,858,806	332,697,522.60	0.16
179	002129	TCL 中环	38,351,775	331,742,853.75	0.16
180	601021	春秋航空	5,849,808	329,519,684.64	0.16
181	600196	复星医药	14,881,825	329,483,605.50	0.16
182	600161	天坛生物	13,417,549	327,388,195.60	0.15

183	601872	招商轮船	38,624,004	326,372,833.80	0.15
184	300418	昆仑万维	10,120,700	326,291,368.00	0.15
185	000807	云铝股份	24,111,069	325,740,542.19	0.15
186	601868	中国能建	153,483,400	325,384,808.00	0.15
187	601360	三六零	41,989,406	322,478,638.08	0.15
188	002938	鹏鼎控股	8,085,400	321,475,504.00	0.15
189	600570	恒生电子	18,038,337	318,557,031.42	0.15
190	600233	圆通速递	20,319,000	317,992,350.00	0.15
191	600600	青岛啤酒	4,354,770	316,896,612.90	0.15
192	600219	南山铝业	82,710,530	315,127,119.30	0.15
193	601995	中金公司	10,579,069	313,246,233.09	0.15
194	002180	纳思达	11,807,299	311,948,839.58	0.15
195	600176	中国巨石	28,226,684	311,904,858.20	0.15
196	600741	华域汽车	18,756,044	307,224,000.72	0.15
197	603392	万泰生物	4,660,762	307,051,000.56	0.14
198	600085	同仁堂	7,992,237	305,383,375.77	0.14
199	300347	泰格医药	6,179,166	300,307,467.60	0.14
200	601689	拓普集团	5,571,200	298,672,032.00	0.14
201	601100	恒立液压	6,368,334	296,636,997.72	0.14
202	002271	东方雨虹	24,026,577	296,487,960.18	0.14
203	002736	国信证券	33,976,500	295,255,785.00	0.14
204	600745	闻泰科技	10,432,045	294,705,271.25	0.14
205	000895	双汇发展	12,377,734	294,218,737.18	0.14
206	000963	华东医药	10,571,245	293,986,323.45	0.14
207	601066	中信建投	15,191,998	292,294,041.52	0.14
208	600183	生益科技	13,867,252	292,044,327.12	0.14
209	600362	江西铜业	12,331,029	291,998,766.72	0.14
210	601336	新华保险	9,668,052	290,331,601.56	0.14
211	300896	爱美客	1,646,180	283,307,578.00	0.13
212	601881	中国银河	25,762,706	279,782,987.16	0.13
213	001965	招商公路	23,160,720	274,686,139.20	0.13
214	600027	华电国际	39,301,351	272,751,375.94	0.13
215	688126	沪硅产业	19,516,503	269,522,906.43	0.13
216	601898	中煤能源	21,466,759	267,905,152.32	0.13
217	002920	德赛西威	3,017,518	262,795,642.62	0.12
218	601618	中国中冶	84,579,080	262,195,148.00	0.12
219	000999	华润三九	6,123,663	260,745,570.54	0.12
220	002459	晶澳科技	23,052,100	258,183,520.00	0.12
221	601699	潞安环能	14,067,528	255,044,282.64	0.12
222	600515	海南机场	80,944,762	254,166,552.68	0.12
223	601607	上海医药	13,195,368	252,163,482.48	0.12
224	600026	中远海能	16,104,424	251,390,058.64	0.12
225	000301	东方盛虹	31,415,969	250,385,272.93	0.12

226	300832	新产业	3,673,620	247,748,932.80	0.12
227	000876	新希望	26,855,785	245,461,874.90	0.12
228	600588	用友网络	24,459,120	244,591,200.00	0.12
229	601877	正泰电器	12,753,021	243,072,580.26	0.11
230	601878	浙商证券	22,665,036	242,969,185.92	0.11
231	600875	东方电气	13,167,703	242,944,120.35	0.11
232	002074	国轩高科	12,668,294	242,597,830.10	0.11
233	300033	同花顺	2,338,106	242,461,592.20	0.11
234	601998	中信银行	36,137,366	242,120,352.20	0.11
235	002555	三七互娱	18,473,429	241,078,248.45	0.11
236	600332	白云山	8,172,292	239,693,324.36	0.11
237	605499	东鹏饮料	1,108,300	239,115,725.00	0.11
238	002709	天赐材料	13,581,797	238,496,355.32	0.11
239	600039	四川路桥	29,944,119	236,259,098.91	0.11
240	002916	深南电路	2,231,840	236,061,716.80	0.11
241	600415	小商品城	31,710,002	235,288,214.84	0.11
242	600803	新奥股份	11,123,500	231,368,800.00	0.11
243	600025	华能水电	21,112,200	227,589,516.00	0.11
244	688396	华润微	6,058,112	226,815,713.28	0.11
245	300223	北京君正	4,058,662	225,012,221.28	0.11
246	300628	亿联网络	6,015,255	221,180,926.35	0.10
247	000408	藏格矿业	9,143,600	220,086,452.00	0.10
248	300316	晶盛机电	7,648,452	219,740,025.96	0.10
249	688599	天合光能	12,921,703	218,635,214.76	0.10
250	002812	恩捷股份	6,899,702	218,375,568.30	0.10
251	300142	沃森生物	19,086,354	217,202,708.52	0.10
252	300450	先导智能	13,001,850	216,220,765.50	0.10
253	002007	华兰生物	13,014,768	205,503,186.72	0.10
254	300496	中科创达	4,463,577	203,494,475.43	0.10
255	601238	广汽集团	26,272,320	203,347,756.80	0.10
256	603260	合盛硅业	4,331,430	202,321,095.30	0.10
257	600460	士兰微	11,526,688	201,832,306.88	0.10
258	300759	康龙化成	10,679,863	198,431,854.54	0.09
259	605117	德业股份	2,644,664	196,604,321.76	0.09
260	601319	中国人保	37,998,600	195,692,790.00	0.09
261	000733	振华科技	4,692,600	194,883,678.00	0.09
262	300999	金龙鱼	7,002,500	191,518,375.00	0.09
263	600018	上港集团	33,107,642	191,362,170.76	0.09
264	600918	中泰证券	33,048,800	187,386,696.00	0.09
265	301269	华大九天	2,366,450	182,334,972.50	0.09
266	300751	迈为股份	1,516,773	181,224,038.04	0.09
267	300413	芒果超媒	8,662,383	181,043,804.70	0.09
268	603806	福斯特	12,310,966	180,971,200.20	0.09

269	601865	福莱特	8,798,342	176,846,674.20	0.08
270	603659	璞泰来	12,437,858	175,746,933.54	0.08
271	601799	星宇股份	1,552,192	173,907,591.68	0.08
272	300919	中伟股份	5,607,970	173,790,990.30	0.08
273	600061	国投资本	30,646,544	173,152,973.60	0.08
274	002821	凯莱英	2,601,379	171,170,738.20	0.08
275	688009	中国通号	28,258,243	169,549,458.00	0.08
276	000708	中信特钢	12,061,744	163,677,866.08	0.08
277	000617	中油资本	29,593,079	163,353,796.08	0.08
278	603195	公牛集团	2,111,010	162,801,091.20	0.08
279	600132	重庆啤酒	2,632,613	159,799,609.10	0.08
280	601059	信达证券	11,173,793	158,779,598.53	0.07
281	002841	视源股份	5,059,810	149,416,189.30	0.07
282	002410	广联达	15,529,996	148,777,361.68	0.07
283	688303	大全能源	7,292,577	148,695,645.03	0.07
284	002603	以岭药业	9,617,389	147,434,573.37	0.07
285	300442	润泽科技	5,955,540	142,635,183.00	0.07
286	603899	晨光股份	4,541,039	142,043,699.92	0.07
287	688187	时代电气	2,835,424	140,013,237.12	0.07
288	300454	深信服	2,723,227	137,604,660.31	0.06
289	601808	中海油服	6,954,100	119,610,520.00	0.06
290	688363	华熙生物	2,089,646	118,211,274.22	0.06
291	600732	爱旭股份	13,021,571	117,845,217.55	0.06
292	601236	红塔证券	16,883,886	108,394,548.12	0.05
293	603833	欧派家居	1,989,301	106,546,961.56	0.05
294	601698	中国卫通	7,391,595	104,147,573.55	0.05
295	300979	华利集团	1,649,776	100,388,869.60	0.05
296	300957	贝泰妮	1,834,980	88,666,233.60	0.04
297	000800	一汽解放	11,117,800	87,052,374.00	0.04
298	688082	盛美上海	653,258	55,206,833.58	0.03
299	603296	华勤技术	762,660	42,121,711.80	0.02
300	001289	龙源电力	1,632,618	28,162,660.50	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

7.3.2 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	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00
2	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
3	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
4	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
5	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
6	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00

7	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
8	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
9	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
10	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
11	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
12	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
13	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
14	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
15	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
16	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
17	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
18	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
19	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
21	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
24	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
25	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
26	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
27	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
28	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
29	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
30	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
31	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
32	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,329,994,810.28	2.54
2	000333	美的集团	2,193,203,111.16	1.67
3	000858	五粮液	1,760,733,688.37	1.34
4	002594	比亚迪	1,589,462,085.78	1.21
5	300760	迈瑞医疗	1,188,435,054.36	0.91
6	000651	格力电器	1,180,740,691.86	0.90
7	300059	东方财富	1,151,188,560.64	0.88
8	002475	立讯精密	1,068,746,724.43	0.82
9	000725	京东方 A	1,023,544,100.20	0.78
10	002415	海康威视	902,028,526.20	0.69

11	300124	汇川技术	891,449,979.32	0.68
12	002714	牧原股份	782,133,453.54	0.60
13	000568	泸州老窖	762,941,311.45	0.58
14	300274	阳光电源	725,358,935.81	0.55
15	300498	温氏股份	717,032,100.30	0.55
16	000001	平安银行	668,595,922.49	0.51
17	300308	中际旭创	653,767,335.43	0.50
18	600900	长江电力	637,651,243.50	0.49
19	000792	盐湖股份	625,481,333.80	0.48
20	000338	潍柴动力	618,204,099.87	0.47

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,458,862,143.17	1.11
2	000333	美的集团	926,319,118.21	0.71
3	002594	比亚迪	796,003,517.80	0.61
4	000858	五粮液	685,830,308.87	0.52
5	300124	汇川技术	538,844,726.87	0.41
6	000651	格力电器	468,894,073.71	0.36
7	300059	东方财富	465,255,184.29	0.35
8	300760	迈瑞医疗	439,976,421.14	0.34
9	000725	京东方 A	431,218,755.00	0.33
10	002475	立讯精密	414,807,081.26	0.32
11	002142	宁波银行	391,269,285.78	0.30
12	002415	海康威视	380,391,732.50	0.29
13	002714	牧原股份	330,984,669.98	0.25
14	300274	阳光电源	324,132,947.51	0.25
15	600919	江苏银行	323,600,076.62	0.25
16	600028	中国石化	316,720,998.20	0.24
17	000661	长春高新	305,688,028.28	0.23
18	002202	金风科技	284,624,797.30	0.22
19	300498	温氏股份	274,682,451.04	0.21
20	600436	片仔癀	265,713,922.71	0.20

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	51,718,312,813.12
卖出股票收入（成交）总额	24,290,218,162.58

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成

交单价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注: 本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注: 本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中, 招商银行(600036)在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 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	196,388,203.40
2	应收清算款	1,741,463.70
3	应收股利	552,111.70
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	23,576.14
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	198,705,354.94

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.00	新股锁定期内
2	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股锁定期内
3	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
4	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市
5	601033	永兴股份	20,077.68	0.00	新股锁定期内

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	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

		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 (%)
607,905	99,916.41	48,227,206,034.00	79.40	11,869,137,591.00	19.54	643,344,065.00	1.06

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中央汇金投资有限责任公司	35,654,598,859.00	58.70
2	中国人寿保险股份有限公司	848,179,872.00	1.40
3	中央汇金资产管理有限责任公司	728,041,500.00	1.20
4	国泰君安证券股份有限公司	626,828,102.00	1.03
5	北京诚通金控投资有限公司	395,895,276.00	0.65
6	中国人寿再保险股份有限公司	284,342,299.00	0.47
7	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	278,952,674.00	0.46
8	泰康人寿保险股份有限公司—万能—一个险—万能	214,355,100.00	0.35
9	友邦人寿保险有限公司—传统	189,265,900.00	0.31
10	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险—分红	185,708,300.00	0.31
11	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	643,344,065.00	1.06

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,000.00	0.0000

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 5 月 4 日）基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	37,444,087,690.00
本报告期基金总申购份额	35,914,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,618,900,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,739,687,690.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

基金管理人重大人事变动：
 2024 年 1 月 19 日，公司股东会书面决定尹雷先生担任公司独立董事，陆楨女士不再担任公司独立董事。
 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	6	25,879,402,950.83	35.38	4,040,246.20	27.38	-
华泰证券	2	18,720,057,057.29	25.59	7,073,751.36	47.94	-
方正证券	2	14,441,769,202.11	19.74	1,444,247.07	9.79	-
海通证券	1	6,269,694,868.81	8.57	977,471.49	6.62	-
招商证券	2	4,496,339,828.72	6.15	701,003.22	4.75	-
中信建投	2	3,317,719,843.20	4.54	517,245.73	3.51	-
申万宏源	2	20,943,613.97	0.03	2,094.23	0.01	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：本报告期内：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。

公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 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	2024 年 02 月 24 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货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	2024 年 02 月 21 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
9	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 24 日
10	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 11 日
11	关于同意财通证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 09 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代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	2024 年 01 月 06 日
13	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	2024 年 01 月 05 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 (%)
机构	1	20240116-20240630;	6,247,371,001.00	29,407,227,858.00	0.00	35,654,598,859.00	58.70

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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 8 月 31 日