

华泰柏瑞中证 2000 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：招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。

基金托管人招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	6
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	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68

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	68
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	68
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末上市基金前十名持有人	70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
10.8 其他重大事件	73
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 2000
场内简称	中证 2000 (扩位证券简称: 中证 2000ETF)
基金主代码	563300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 6 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,263,674,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 14 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	<p>1、股票(含存托凭证)的投资策略</p> <p>本基金主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资平台, 利用长期稳定的风险模型, 使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合, 从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下, 本基金力争做到日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%, 年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>为了更好地实现跟踪标的指数的目的, 基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素, 决定是否采用完全复制法的策略。完全复制法指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; 当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时, 将根据标的指数的编制规则及调整公告, 及时进行投资组合的优化调整, 尽量降低跟踪误差, 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。若本基金决定修改复制方法, 将在更换复制方法前按规定履行适当程序并公告。</p> <p>本基金将根据投资目标, 在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上, 根据审慎原则合理参与存托凭证的投资, 以更好地跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>2、债券投资策略; 3、股指期货的投资策略; 4、资产支持证券的投资策略; 5、融资及转融通证券出借业务。</p>
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金, 其长期平均风险和预期收益率理论上高于混

	<p>合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金属于股票型基金中的指数型基金，跟踪中证 2000 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>
--	--

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	张姗
	联系电话	021-38601777	400-61-95555
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	400-61-95555
传真		021-38601799	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200135	518040
法定代表人		贾波	缪建民

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	710,531,155.20
本期利润	644,443,138.03
加权平均基金份额本期利润	0.4229
本期加权平均净值利润率	48.92%
本期基金份额净值增长率	-21.32%
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	-259,870,611.12
期末可供分配基金份额利润	-0.2056
期末基金资产净值	1,003,803,388.88
期末基金份额净值	0.7944

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	-20.56%

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。

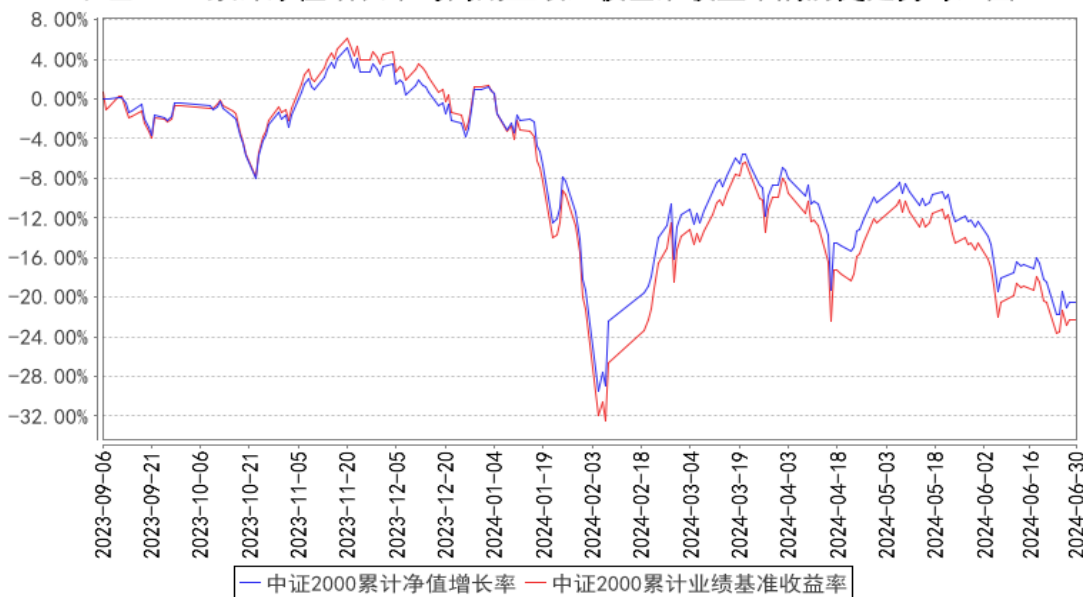
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-9.41%	1.76%	-9.15%	1.85%	-0.26%	-0.09%
过去三个月	-13.04%	1.83%	-13.75%	2.01%	0.71%	-0.18%
过去六个月	-21.32%	2.33%	-23.28%	2.50%	1.96%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-20.56%	1.92%	-22.32%	2.05%	1.76%	-0.13%

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

中证2000累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2023 年 9 月 6 日至 2024 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的

各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§ 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。
李沐阳	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 6 日	-	6 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月起任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 4 月起任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、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）的基金经理。2023 年 10 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发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 11 月起任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）、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 1 月起任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发起式联接基金（QDII）的基金经理。	
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 9 月 6 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

				<p>12月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年7月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年9月至2021年4月任华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年2月至2021年4月任华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年9月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年3月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021年5月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2021年7月至2023年8月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年8月至2023年12月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月起任华泰柏瑞中证500增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年8月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理。2022年11月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年3月起任华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023年9月起任华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年10月起任华泰柏瑞中证A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，中证 2000 指数整体呈现震荡下行的趋势。在 4 月初，监管部门出台了相关措施，加强对借壳上市的管控，精准打击保壳行为。这一举措增加了小盘股的退市风险，使市场对小盘股的投资信心受到影响。此外，今年实施的国九条政策鼓励优质公司进行更多的分红派息，这进一步推动了投资者将资金投入大盘股，尤其是具有稳定分红的红利股。与此同时，小盘股则面临资金持续流出的困境，指数表现因此疲软。

此外，经济环境和市场情绪也对小盘股造成了不利影响。全球经济复苏缓慢以及国内经济增速放缓，导致投资者对风险资产的偏好下降，而更倾向于持有蓝筹股和稳健收益的资产。同时，国际市场的不确定性以及地缘冲突风险上升，使得资金流向避险资产，小盘股受到的压力加剧。

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 0.207%，期间日跟踪误差为 0.277%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7944 元，本报告期基金份额净值增长率为-21.32%，业绩比较基准收益率为-23.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管小盘股在上半年表现不佳，但我们认为目前小盘股的估值已经显现出吸引力，中证 2000 指数的估值较低。随着大盘股特别是高分红个股的阶段性调整，市场资金可能会重新评估小盘股的投资价值。当前的估值水平为投资者提供了潜在的买入机会，尤其是在经济环境和政策面逐步改善的情况下。

如果宏观经济出现改善迹象，或者政策支持力度加大，市场情绪可能发生变化，促使资金流回小盘股。此外，随着企业盈利能力的提升和市场流动性的改善，小盘股有望迎来反弹。对于长期投资者而言，当前市场的波动性也可能提供了战略性布局小盘股的良机。

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，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：华泰柏瑞中证 2000 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	35,081,340.46	26,804,358.36
结算备付金		2,297,868.15	1,366,651.69
存出保证金		3,713,742.47	278,844.84
交易性金融资产	6.4.7.2	974,438,365.24	998,720,096.10
其中：股票投资		974,438,365.24	998,448,084.77
基金投资		-	-
债券投资		-	272,011.33
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		-	11,353,723.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		1,015,606,725.44	1,038,523,674.51
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		20,591.10	302,267.09
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		698,982.82	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		423,920.98	210,063.00
应付托管费		84,784.20	42,012.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	10,575,057.46	24,701,877.21
负债合计		11,803,336.56	25,256,220.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,263,674,000.00	1,003,674,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-259,870,611.12	9,593,454.02
净资产合计		1,003,803,388.88	1,013,267,454.02
负债和净资产总计		1,015,606,725.44	1,038,523,674.51

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7944 元，基金份额总额 1,263,674,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 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
一、营业总收入		649,286,578.54
1. 利息收入		245,294.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	245,294.88
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		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		780,243,605.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	772,081,827.82
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	80,704.95
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	-
股利收益	6.4.7.19	8,081,072.78
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	-66,088,017.17
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	-65,114,304.72
减：二、营业总支出		4,843,440.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,892,037.66
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	778,407.57
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		0.15
8. 其他费用	6.4.7.23	172,995.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		644,443,138.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		644,443,138.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		644,443,138.03

注：本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 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	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	260,000,000.00	-	-269,464,065.14	-9,464,065.14
(一)、综合收益总额	-	-	644,443,138.03	644,443,138.03
(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)	260,000,000.00	-	-913,907,203.17	-653,907,203.17
其中：1. 基金申购款	11,802,500,000.00	-	-2,387,303,504.66	9,415,196,495.34
2. 基金赎回款	-11,542,500,000.00	-	1,473,396,301.49	-10,069,103,698.51
(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	1,263,674,000.00	-	-259,870,611.12	1,003,803,388.88
-----------	------------------	---	-----------------	------------------

注：本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1940 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 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 588,674,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0459 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 588,674,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]210 号核准，本基金 588,674,000.00 份基金份额于 2023 年 9 月 14 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 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现

金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 2000ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 2000ETF 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 08 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》、《华泰柏瑞中证 2000 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净资产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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	35,081,340.46
等于：本金	35,078,419.19
加：应计利息	2,921.27
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	35,081,340.46

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	1,024,230,993.08	-	974,438,365.24	-49,792,627.84
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	1,024,230,993.08	-	974,438,365.24	-49,792,627.84
----	------------------	---	----------------	----------------

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

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投资。

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投资。

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	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

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	505,797.80
其中：交易所市场	505,797.80
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,452.08
应退退补款	9,969,807.58
合计	10,575,057.46

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	1,003,674,000.00	1,003,674,000.00
本期申购	11,802,500,000.00	11,802,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-11,542,500,000.00	-11,542,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,263,674,000.00	1,263,674,000.00

注：投资者申购和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	8,534,506.47	1,058,947.55	9,593,454.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,534,506.47	1,058,947.55	9,593,454.02
本期利润	710,531,155.20	-66,088,017.17	644,443,138.03
本期基金份额交易产生的变动数	-455,228,623.99	-458,678,579.18	-913,907,203.17
其中：基金申购款	-78,394,706.12	-2,308,908,798.54	-2,387,303,504.66
基金赎回款	-376,833,917.87	1,850,230,219.36	1,473,396,301.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	263,837,037.68	-523,707,648.80	-259,870,611.12

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	84,921.06
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	140,667.59
其他	19,706.23
合计	245,294.88

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	558,381,862.33
股票投资收益——赎回差价收入	213,699,965.49
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	772,081,827.82

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	6,496,607,246.61
减：卖出股票成本总额	5,932,619,582.85
减：交易费用	5,605,801.43
买卖股票差价收入	558,381,862.33

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	10,069,103,698.51
减：现金支付赎回款总额	6,479,867,131.51
减：赎回股票成本总额	3,375,536,601.51
减：交易费用	-
赎回差价收入	213,699,965.49

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	36.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	80,668.87
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	80,704.95

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	482,736.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	402,000.00
减：应计利息总额	48.69

减：交易费用	19.30
买卖债券差价收入	80,668.87

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

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	8,081,072.78
其中:证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,081,072.78

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	-66,051,439.71
股票投资	-66,051,439.71
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-36,577.46
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-66,088,017.17

注: 其他为可退替代款的公允价值变动。

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	-65,114,304.72
合计	-65,114,304.72

注: 替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时, 补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
注册登记费	74,590.88
IOPV 计算发布费	-4,082.92
银行划款手续费	12,979.57
合计	172,995.13

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“中证 2000 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。

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	3,881,879.76	0.03

注：本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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	3,671.94	0.24	3,671.94	0.73

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（截止 2024 年 6 月 30 日）。

3、本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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
当期发生的基金应支付的管理费	3,892,037.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	101,244.07
应支付基金管理人的净管理费	3,790,793.59

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：

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

本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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
当期发生的基金应支付的托管费	778,407.57

注：支付基金托管人招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：

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

本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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：本基金本报告期末发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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

注：本基金本报告期末发生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。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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

注：本基金本报告期末发生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。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年可比期间数据。

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 (%)
华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	33,934,200.00	2.6854	17,418,900.00	1.7355
华泰证券股份有限公司	7,533,334.00	0.5961	139,071,000.00	13.8562

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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	35,081,340.46	84,921.06

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

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

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
本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	7,139	112,010.91
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	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

注：本基金成立于 2023 年 09 月 06 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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	腾达科技	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	-
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	2024 年 3 月	6 个月	新股锁定	55.82	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-

	达	月 13		期内							
	日										
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	中瑞股份	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	-	
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	781	55,070.26	146,835.81	-	
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	559	9,055.80	8,921.64	-	
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	2024年6	1个月内(含)	新股未上	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-	

	股份	月 28 日		市						
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	-
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	559	12,666.94	8,882.51	-
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	2024 年 6 月	6 个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-

	数据	月 4 日		期内						
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	714	11,202.66	13,416.06	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002308	威创股份	2024 年 5 月 6 日	重大事项	1.97	2024 年 7 月 9 日	1.87	80,900	190,633.05	159,373.00	-

注：本基金截至 2024 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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市场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市场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

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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招商银行，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，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：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 0.03%)。

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

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	35,081,340.46	-	-	-	-	-	35,081,340.46

结算备付金	2,297,868.15	-	-	-	-	-	2,297,868.15
存出保证金	3,713,742.47	-	-	-	-	-	3,713,742.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	974,438,365.24	974,438,365.24
其他资产	-	-	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	41,092,951.08	-	-	-	-	974,513,774.36	1,015,606,725.44
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	20,591.10	20,591.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	423,920.98	423,920.98
应付托管费	-	-	-	-	-	84,784.20	84,784.20
应付清算款	-	-	-	-	-	698,982.82	698,982.82
其他负债	-	-	-	-	-	10,575,057.46	10,575,057.46
负债总计	-	-	-	-	-	11,803,336.56	11,803,336.56
利率敏感度缺口	41,092,951.08	-	-	-	-	962,710,437.80	1,003,803,388.88
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	26,804,358.36	-	-	-	-	-	26,804,358.36
结算备付金	1,366,651.69	-	-	-	-	-	1,366,651.69
存出保证金	278,844.84	-	-	-	-	-	278,844.84
交易性金融资产	-	-	-	-272,011.33	-	998,448,084.77	998,720,096.10
应收清算款	-	-	-	-	-	11,353,723.52	11,353,723.52
资产总计	28,449,854.89	-	-	-272,011.33	-	1,009,801,808.29	1,038,523,674.51
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	302,267.09	302,267.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	210,063.00	210,063.00
应付托管费	-	-	-	-	-	42,012.59	42,012.59
应交税费	-	-	-	-	-	0.60	0.60
其他负债	-	-	-	-	-	24,701,877.21	24,701,877.21
负债总计	-	-	-	-	-	25,256,220.49	25,256,220.49
利率敏感度缺口	28,449,854.89	-	-	-272,011.33	-	984,545,587.80	1,013,267,454.02

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：0.03%)，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	974,438,365.24	97.07	998,448,084.77	98.54
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	-20,591.10	-0.00	-302,267.09	-0.03
合计	974,417,774.14	97.07	998,145,817.68	98.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 2000 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	中证 2000 指数上升 5%		45,174,548.40
中证 2000 指数下降 5%		-45,174,548.40	-49,285,648.58

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	973,843,826.69	997,504,536.45
第二层次	204,984.11	998,341.33
第三层次	389,554.44	217,218.32
合计	974,438,365.24	998,720,096.10

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	974,438,365.24	95.95
	其中：股票	974,438,365.24	95.95
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	37,379,208.61	3.68
8	其他各项资产	3,789,151.59	0.37
9	合计	1,015,606,725.44	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	4,260,376.00	0.42
B	采矿业	11,836,830.40	1.18
C	制造业	658,473,144.24	65.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,614,753.00	1.85
E	建筑业	17,726,865.13	1.77

F	批发和零售业	40,062,260.77	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	22,050,114.20	2.20
H	住宿和餐饮业	1,889,655.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,688,187.47	9.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	23,643,114.00	2.36
L	租赁和商务服务业	19,030,049.00	1.90
M	科学研究和技术服务业	26,809,203.19	2.67
N	水利、环境和公共设施管理业	17,944,904.29	1.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,835,842.00	0.58
Q	卫生和社会工作	875,027.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	8,270,417.00	0.82
S	综合	1,833,084.00	0.18
	合计	973,843,826.69	97.02

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	538,635.89	0.05
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	8,921.64	0.00

	设施管理业		
0	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	594,538.55	0.06

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	002588	史丹利	925,900	6,972,027.00	0.69
2	603859	能科科技	244,332	5,135,858.64	0.51
3	603067	振华股份	437,800	5,104,748.00	0.51
4	300349	金卡智能	397,700	4,740,584.00	0.47
5	002452	长高电新	543,200	4,497,696.00	0.45
6	000589	贵州轮胎	876,400	4,443,348.00	0.44
7	600897	厦门空港	339,440	4,280,338.40	0.43
8	688621	阳光诺和	99,091	4,231,185.70	0.42
9	003000	劲仔食品	349,200	4,207,860.00	0.42
10	301391	卡莱特	94,700	4,145,966.00	0.41
11	000099	中信海直	249,600	4,053,504.00	0.40
12	300815	玉禾田	348,100	4,051,884.00	0.40
13	600425	青松建化	1,222,100	4,008,488.00	0.40
14	601500	通用股份	749,400	4,001,796.00	0.40
15	688259	创耀科技	99,036	3,957,478.56	0.39
16	301051	信濠光电	147,110	3,858,695.30	0.38
17	002752	昇兴股份	749,400	3,791,964.00	0.38
18	300181	佐力药业	249,600	3,773,952.00	0.38
19	002971	和远气体	149,000	3,692,220.00	0.37
20	688510	航亚科技	199,515	3,673,071.15	0.37
21	300842	帝科股份	94,503	3,666,716.40	0.37
22	002478	常宝股份	728,200	3,626,436.00	0.36
23	605286	同力日升	148,800	3,620,304.00	0.36
24	002833	弘亚数控	196,820	3,589,996.80	0.36
25	003028	振邦智能	99,200	3,577,152.00	0.36

26	002970	锐明技术	98,669	3,555,044.07	0.35
27	002947	恒铭达	99,120	3,489,024.00	0.35
28	300444	双杰电气	547,300	3,475,355.00	0.35
29	603711	香飘飘	249,602	3,456,987.70	0.34
30	688663	新风光	148,416	3,453,640.32	0.34
31	300969	恒帅股份	49,600	3,428,848.00	0.34
32	000521	长虹美菱	443,200	3,359,456.00	0.33
33	300592	华凯易佰	293,594	3,355,779.42	0.33
34	301101	明月镜片	148,850	3,325,309.00	0.33
35	688258	卓易信息	99,191	3,312,979.40	0.33
36	603727	博迈科	246,190	3,239,860.40	0.32
37	688628	优利德	98,641	3,232,465.57	0.32
38	002922	伊戈尔	147,600	3,226,536.00	0.32
39	605167	利柏特	396,900	3,099,789.00	0.31
40	300729	乐歌股份	199,130	3,084,523.70	0.31
41	003038	鑫铂股份	205,042	3,028,470.34	0.30
42	601588	北辰实业	2,237,400	3,020,490.00	0.30
43	002983	芯瑞达	180,647	3,007,772.55	0.30
44	002870	香山股份	99,200	2,959,136.00	0.29
45	301195	北路智控	99,150	2,948,721.00	0.29
46	300938	信测标准	147,655	2,935,381.40	0.29
47	300355	蒙草生态	1,323,800	2,912,360.00	0.29
48	688205	德科立	100,046	2,882,325.26	0.29
49	600180	瑞茂通	750,400	2,859,024.00	0.28
50	603757	大元泵业	148,800	2,842,080.00	0.28
51	300105	龙源技术	438,300	2,831,418.00	0.28
52	000680	山推股份	298,200	2,764,314.00	0.28
53	002956	西麦食品	198,700	2,730,138.00	0.27
54	000888	峨眉山 A	248,161	2,702,473.29	0.27
55	688698	伟创电气	99,502	2,683,568.94	0.27
56	301257	普蕊斯	94,470	2,668,777.50	0.27
57	605128	上海沿浦	95,168	2,654,235.52	0.26
58	605377	华旺科技	200,120	2,651,590.00	0.26
59	002912	中新赛克	148,859	2,637,781.48	0.26
60	002285	世联行	1,650,800	2,624,772.00	0.26
61	603518	锦泓集团	295,300	2,598,640.00	0.26
62	002301	齐心集团	537,200	2,594,676.00	0.26
63	688358	祥生医疗	99,219	2,576,717.43	0.26
64	600576	祥源文旅	585,900	2,572,101.00	0.26
65	688049	炬芯科技	116,123	2,568,640.76	0.26
66	688533	上声电子	99,163	2,565,346.81	0.26
67	688418	震有科技	148,701	2,547,248.13	0.25
68	688039	当虹科技	98,623	2,543,487.17	0.25

69	300881	盛德鑫泰	98,100	2,520,189.00	0.25
70	688687	凯因科技	98,770	2,519,622.70	0.25
71	300360	炬华科技	147,500	2,507,500.00	0.25
72	600133	东湖高新	239,728	2,502,760.32	0.25
73	002641	公元股份	635,500	2,497,515.00	0.25
74	002878	元隆雅图	198,400	2,493,888.00	0.25
75	600251	冠农股份	339,500	2,457,980.00	0.24
76	301030	仕净科技	99,080	2,439,349.60	0.24
77	300389	艾比森	198,400	2,436,352.00	0.24
78	300545	联得装备	98,500	2,418,175.00	0.24
79	600694	大商股份	143,700	2,415,597.00	0.24
80	688662	富信科技	98,229	2,396,787.60	0.24
81	688121	卓然股份	198,465	2,385,549.30	0.24
82	300779	惠城环保	48,994	2,371,309.60	0.24
83	301061	匠心家居	50,080	2,351,756.80	0.23
84	688302	海创药业	99,153	2,336,044.68	0.23
85	688357	建龙微纳	100,037	2,330,862.10	0.23
86	603619	中曼石油	99,100	2,320,922.00	0.23
87	002919	名臣健康	199,112	2,311,690.32	0.23
88	600094	大名城	591,200	2,287,944.00	0.23
89	603050	科林电气	93,840	2,276,558.40	0.23
90	002083	孚日股份	536,100	2,267,703.00	0.23
91	300452	山河药辅	199,615	2,267,626.40	0.23
92	300430	诚益通	149,700	2,257,476.00	0.22
93	300421	力星股份	246,100	2,256,737.00	0.22
94	301181	标榜股份	98,300	2,229,444.00	0.22
95	603722	阿科力	49,000	2,217,250.00	0.22
96	600054	黄山旅游	196,300	2,202,486.00	0.22
97	002073	软控股份	296,000	2,187,440.00	0.22
98	605300	佳禾食品	198,400	2,170,496.00	0.22
99	301162	国能日新	49,114	2,139,405.84	0.21
100	300491	通合科技	148,000	2,125,280.00	0.21
101	002630	华西能源	1,000,500	2,121,060.00	0.21
102	300092	科新机电	197,100	2,120,796.00	0.21
103	605098	行动教育	49,400	2,105,428.00	0.21
104	300460	惠伦晶体	246,600	2,103,498.00	0.21
105	002443	金洲管道	393,000	2,098,620.00	0.21
106	300654	世纪天鸿	246,600	2,096,100.00	0.21
107	603366	日出东方	585,900	2,091,663.00	0.21
108	603076	乐惠国际	97,900	2,084,291.00	0.21
109	603960	克来机电	98,000	2,067,800.00	0.21
110	688365	光云科技	342,489	2,061,783.78	0.21
111	603569	长久物流	299,500	2,054,570.00	0.20

112	688569	铁科轨道	98,489	2,035,767.63	0.20
113	300314	戴维医疗	196,400	2,030,776.00	0.20
114	600794	保税科技	635,200	2,013,584.00	0.20
115	300396	迪瑞医疗	99,100	2,012,721.00	0.20
116	300320	海达股份	246,200	2,008,992.00	0.20
117	002533	金杯电工	196,900	1,959,155.00	0.20
118	300192	科德教育	196,800	1,932,576.00	0.19
119	605016	百龙创园	94,260	1,920,076.20	0.19
120	601020	华钰矿业	149,800	1,917,440.00	0.19
121	600611	大众交通	686,100	1,914,219.00	0.19
122	688233	神工股份	98,762	1,903,143.74	0.19
123	301093	华兰股份	98,300	1,893,258.00	0.19
124	000655	金岭矿业	342,200	1,892,366.00	0.19
125	300559	佳发教育	197,100	1,886,247.00	0.19
126	603660	苏州科达	345,100	1,884,246.00	0.19
127	000531	穗恒运 A	344,500	1,843,075.00	0.18
128	603357	设计总院	199,800	1,836,162.00	0.18
129	600101	明星电力	148,400	1,825,320.00	0.18
130	300532	今天国际	147,600	1,814,004.00	0.18
131	603009	北特科技	99,500	1,784,035.00	0.18
132	002339	积成电子	295,900	1,781,318.00	0.18
133	300139	晓程科技	147,900	1,771,842.00	0.18
134	003029	吉大正元	99,100	1,762,989.00	0.18
135	002170	芭田股份	292,900	1,760,329.00	0.18
136	000554	泰山石油	344,700	1,747,629.00	0.17
137	300795	米奥会展	99,100	1,737,223.00	0.17
138	300546	雄帝科技	148,800	1,714,176.00	0.17
139	301235	华康医疗	98,600	1,710,710.00	0.17
140	002338	奥普光电	51,000	1,684,020.00	0.17
141	300719	安达维尔	99,100	1,679,745.00	0.17
142	601199	江南水务	344,700	1,678,689.00	0.17
143	600186	莲花控股	488,000	1,673,840.00	0.17
144	600035	楚天高速	389,000	1,668,810.00	0.17
145	300500	启迪设计	148,800	1,666,560.00	0.17
146	600351	亚宝药业	295,000	1,654,950.00	0.16
147	002803	吉宏股份	148,000	1,647,240.00	0.16
148	600979	广安爱众	488,700	1,642,032.00	0.16
149	002017	东信和平	196,800	1,639,344.00	0.16
150	688135	利扬芯片	102,000	1,634,040.00	0.16
151	002997	瑞鹄模具	51,000	1,630,470.00	0.16
152	301278	快可电子	49,550	1,611,366.00	0.16
153	603516	淳中科技	51,000	1,610,070.00	0.16
154	300378	鼎捷软件	98,500	1,602,595.00	0.16

155	002869	金溢科技	49,500	1,594,395.00	0.16
156	300331	苏大维格	98,500	1,583,880.00	0.16
157	600368	五洲交通	440,740	1,573,441.80	0.16
158	300791	仙乐健康	62,320	1,570,464.00	0.16
159	000957	中通客车	148,900	1,566,428.00	0.16
160	300041	回天新材	197,100	1,564,974.00	0.16
161	688077	大地熊	97,889	1,549,582.87	0.15
162	688292	浩瀚深度	100,046	1,546,711.16	0.15
163	002102	能特科技	663,300	1,545,489.00	0.15
164	688697	纽威数控	98,352	1,543,142.88	0.15
165	688277	天智航	198,932	1,539,733.68	0.15
166	002035	华帝股份	246,400	1,535,072.00	0.15
167	300255	常山药业	153,000	1,533,060.00	0.15
168	601579	会稽山	149,000	1,525,760.00	0.15
169	002394	联发股份	246,600	1,519,056.00	0.15
170	301011	华立科技	98,551	1,518,670.91	0.15
171	300354	东华测试	48,800	1,516,216.00	0.15
172	301266	宇邦新材	49,070	1,503,504.80	0.15
173	000777	中核科技	98,200	1,500,496.00	0.15
174	002609	捷顺科技	197,100	1,494,018.00	0.15
175	000949	新乡化纤	437,700	1,488,180.00	0.15
176	002401	中远海科	98,300	1,468,602.00	0.15
177	600114	东睦股份	102,000	1,467,780.00	0.15
178	000978	桂林旅游	244,000	1,464,000.00	0.15
179	300401	花园生物	102,000	1,462,680.00	0.15
180	688148	芳源股份	347,415	1,462,617.15	0.15
181	002654	万润科技	134,700	1,461,495.00	0.15
182	603199	九华旅游	48,800	1,454,240.00	0.14
183	688186	广大特材	149,222	1,451,930.06	0.14
184	002115	三维通信	295,900	1,438,074.00	0.14
185	300731	科创新源	98,100	1,436,184.00	0.14
186	300745	欣锐科技	99,200	1,434,432.00	0.14
187	000417	合肥百货	345,100	1,432,165.00	0.14
188	300293	蓝英装备	100,100	1,429,428.00	0.14
189	002732	燕塘乳业	98,300	1,422,401.00	0.14
190	301185	鸥玛软件	99,200	1,421,536.00	0.14
191	688179	阿拉丁	146,977	1,421,267.59	0.14
192	300580	贝斯特	96,536	1,419,079.20	0.14
193	002225	濮耐股份	345,800	1,414,322.00	0.14
194	001215	千味央厨	49,200	1,390,884.00	0.14
195	002014	永新股份	146,400	1,387,872.00	0.14
196	603825	华扬联众	148,900	1,380,303.00	0.14
197	300990	同飞股份	49,100	1,380,201.00	0.14

198	300048	合康新能	297,800	1,378,814.00	0.14
199	002057	中钢天源	196,800	1,377,600.00	0.14
200	300566	激智科技	98,300	1,375,217.00	0.14
201	300825	阿尔特	141,500	1,371,135.00	0.14
202	300718	长盛轴承	99,100	1,369,562.00	0.14
203	001339	智微智能	49,600	1,369,456.00	0.14
204	300840	酷特智能	148,000	1,369,000.00	0.14
205	002455	百川股份	148,500	1,363,230.00	0.14
206	002431	棕榈股份	973,700	1,363,180.00	0.14
207	300008	天海防务	345,800	1,362,452.00	0.14
208	002896	中大力德	48,800	1,361,520.00	0.14
209	688022	瀚川智能	98,968	1,356,851.28	0.14
210	002045	国光电器	99,100	1,350,733.00	0.13
211	000912	泸天化	388,100	1,346,707.00	0.13
212	300174	元力股份	98,500	1,344,525.00	0.13
213	002483	润邦股份	297,700	1,342,627.00	0.13
214	300473	德尔股份	98,300	1,337,863.00	0.13
215	603078	江化微	99,800	1,336,322.00	0.13
216	300708	聚灿光电	146,400	1,317,600.00	0.13
217	002184	海得控制	146,400	1,314,672.00	0.13
218	002829	星网宇达	98,182	1,314,656.98	0.13
219	300900	广联航空	70,160	1,314,096.80	0.13
220	603322	超讯通信	49,500	1,312,245.00	0.13
221	002590	万安科技	99,100	1,306,138.00	0.13
222	688299	长阳科技	102,000	1,304,580.00	0.13
223	002031	巨轮智能	574,000	1,302,980.00	0.13
224	605266	健之佳	50,051	1,298,823.45	0.13
225	688182	灿勤科技	97,719	1,293,799.56	0.13
226	300709	精研科技	51,000	1,289,280.00	0.13
227	300194	福安药业	344,500	1,288,430.00	0.13
228	300384	三联虹普	98,200	1,288,384.00	0.13
229	600664	哈药股份	487,500	1,287,000.00	0.13
230	002033	丽江股份	146,400	1,282,464.00	0.13
231	300721	怡达股份	99,800	1,279,436.00	0.13
232	000551	创元科技	146,400	1,278,072.00	0.13
233	600200	江苏吴中	141,400	1,266,944.00	0.13
234	300895	铜牛信息	50,955	1,265,212.65	0.13
235	300688	创业黑马	51,000	1,264,800.00	0.13
236	301012	扬电科技	51,000	1,262,760.00	0.13
237	603590	康辰药业	49,400	1,261,676.00	0.13
238	300410	正业科技	245,900	1,259,008.00	0.13
239	000610	西安旅游	98,300	1,255,291.00	0.13
240	000900	现代投资	341,500	1,249,890.00	0.12

241	600212	绿能慧充	200,100	1,248,624.00	0.12
242	603496	恒为科技	51,000	1,246,950.00	0.12
243	600533	栖霞建设	635,800	1,246,168.00	0.12
244	603878	武进不锈	190,300	1,244,562.00	0.12
245	603811	诚意药业	198,100	1,238,125.00	0.12
246	301270	汉仪股份	50,920	1,228,699.60	0.12
247	300053	航宇微	134,800	1,228,028.00	0.12
248	600605	汇通能源	49,300	1,226,584.00	0.12
249	300005	探路者	244,700	1,225,947.00	0.12
250	000948	南天信息	99,130	1,224,255.50	0.12
251	002669	康达新材	148,000	1,218,040.00	0.12
252	002785	万里石	49,000	1,217,650.00	0.12
253	000922	佳电股份	102,000	1,216,860.00	0.12
254	603628	清源股份	98,100	1,203,687.00	0.12
255	300110	华仁药业	388,900	1,201,701.00	0.12
256	688227	品高股份	99,177	1,201,033.47	0.12
257	002860	星帅尔	146,400	1,199,016.00	0.12
258	002521	齐峰新材	102,000	1,198,500.00	0.12
259	603982	泉峰汽车	149,800	1,198,400.00	0.12
260	002632	道明光学	148,500	1,196,910.00	0.12
261	300622	博士眼镜	98,300	1,196,311.00	0.12
262	600630	龙头股份	148,000	1,195,840.00	0.12
263	000532	华金资本	99,100	1,195,146.00	0.12
264	002255	海陆重工	244,000	1,193,160.00	0.12
265	300246	宝莱特	196,800	1,190,640.00	0.12
266	000078	海王生物	561,200	1,189,744.00	0.12
267	000863	三湘印象	295,500	1,182,000.00	0.12
268	300184	力源信息	255,100	1,181,113.00	0.12
269	000544	中原环保	149,500	1,176,565.00	0.12
270	000862	银星能源	246,400	1,175,328.00	0.12
271	301282	金禄电子	49,300	1,172,354.00	0.12
272	002559	亚威股份	153,000	1,171,980.00	0.12
273	002345	潮宏基	247,700	1,169,144.00	0.12
274	300239	东宝生物	248,200	1,169,022.00	0.12
275	600255	鑫科材料	673,600	1,165,328.00	0.12
276	300862	蓝盾光电	51,000	1,160,760.00	0.12
277	002510	天汽模	298,000	1,159,220.00	0.12
278	300429	强力新材	102,000	1,158,720.00	0.12
279	688222	成都先导	102,000	1,157,700.00	0.12
280	002526	山东矿机	489,100	1,154,276.00	0.11
281	300217	东方电热	306,100	1,153,997.00	0.11
282	300507	苏奥传感	199,400	1,146,550.00	0.11
283	002367	康力电梯	198,200	1,143,614.00	0.11

284	300806	斯迪克	102,000	1,142,400.00	0.11
285	002328	新朋股份	244,000	1,141,920.00	0.11
286	688207	格灵深瞳	99,090	1,136,562.30	0.11
287	300131	英唐智控	255,100	1,135,195.00	0.11
288	300700	岱勒新材	145,640	1,133,079.20	0.11
289	600238	海南椰岛	148,400	1,132,292.00	0.11
290	300213	佳讯飞鸿	198,200	1,129,740.00	0.11
291	300173	福能东方	297,700	1,122,329.00	0.11
292	300353	东土科技	153,000	1,118,430.00	0.11
293	300619	金银河	45,920	1,113,100.80	0.11
294	300518	新讯达	149,800	1,113,014.00	0.11
295	002716	湖南白银	357,100	1,110,581.00	0.11
296	002703	浙江世宝	99,600	1,109,544.00	0.11
297	300161	华中数控	49,200	1,106,508.00	0.11
298	300499	高澜股份	102,000	1,105,680.00	0.11
299	300909	汇创达	49,400	1,103,596.00	0.11
300	300193	佳士科技	148,500	1,101,870.00	0.11
301	002331	皖通科技	149,800	1,099,532.00	0.11
302	300081	恒信东方	248,400	1,097,928.00	0.11
303	600686	金龙汽车	148,900	1,095,904.00	0.11
304	300647	超频三	198,300	1,088,667.00	0.11
305	300228	富瑞特装	198,700	1,084,902.00	0.11
306	002827	高争民爆	49,400	1,081,366.00	0.11
307	002655	共达电声	99,700	1,076,760.00	0.11
308	000713	丰乐种业	198,200	1,076,226.00	0.11
309	688382	益方生物	148,824	1,075,997.52	0.11
310	600789	鲁抗医药	153,000	1,071,000.00	0.11
311	601388	怡球资源	488,700	1,070,253.00	0.11
312	002449	国星光电	150,100	1,068,712.00	0.11
313	000815	美利云	148,500	1,067,715.00	0.11
314	000852	石化机械	198,860	1,065,889.60	0.11
315	600571	信雅达	102,000	1,064,880.00	0.11
316	002579	中京电子	145,100	1,059,230.00	0.11
317	002279	久其软件	245,700	1,058,967.00	0.11
318	603178	圣龙股份	49,400	1,058,642.00	0.11
319	688560	明冠新材	99,356	1,058,141.40	0.11
320	000670	盈方微	239,900	1,048,363.00	0.10
321	002104	恒宝股份	198,200	1,046,496.00	0.10
322	002296	辉煌科技	101,400	1,045,434.00	0.10
323	688488	艾迪药业	102,000	1,042,440.00	0.10
324	002611	东方精工	198,400	1,041,600.00	0.10
325	000404	长虹华意	195,100	1,039,883.00	0.10
326	603918	金桥信息	99,300	1,037,685.00	0.10

327	301297	富乐德	51,000	1,035,810.00	0.10
328	002062	宏润建设	297,600	1,035,648.00	0.10
329	002819	东方中科	49,000	1,032,920.00	0.10
330	002540	亚太科技	195,200	1,032,608.00	0.10
331	300098	高新兴	232,500	1,029,975.00	0.10
332	002858	力盛体育	99,000	1,029,600.00	0.10
333	300494	盛天网络	102,000	1,025,100.00	0.10
334	301218	华是科技	49,400	1,023,074.00	0.10
335	002902	铭普光磁	47,200	1,022,824.00	0.10
336	600684	珠江股份	388,600	1,022,018.00	0.10
337	000751	锌业股份	388,700	1,018,394.00	0.10
338	000151	中成股份	98,300	1,016,422.00	0.10
339	688176	亚虹医药	198,562	1,014,651.82	0.10
340	600846	同济科技	148,500	1,014,255.00	0.10
341	600512	腾达建设	536,100	1,013,229.00	0.10
342	603665	康隆达	49,300	1,010,650.00	0.10
343	688588	凌志软件	147,313	1,009,094.05	0.10
344	300766	每日互动	102,000	1,008,780.00	0.10
345	002529	海源复材	195,400	1,008,264.00	0.10
346	300540	蜀道装备	49,400	1,005,784.00	0.10
347	600609	金杯汽车	289,500	1,004,565.00	0.10
348	688371	菲沃泰	100,046	1,004,461.84	0.10
349	000906	浙商中拓	148,600	1,001,564.00	0.10
350	002846	英联股份	146,621	1,001,421.43	0.10
351	600479	千金药业	98,300	999,711.00	0.10
352	001212	中旗新材	49,200	998,760.00	0.10
353	600189	泉阳泉	149,700	994,008.00	0.10
354	300042	朗科科技	49,200	993,348.00	0.10
355	300809	华辰装备	49,000	992,740.00	0.10
356	300489	光智科技	48,900	991,203.00	0.10
357	300632	光莆股份	99,100	986,045.00	0.10
358	300565	科信技术	98,100	985,905.00	0.10
359	002165	红宝丽	297,200	980,760.00	0.10
360	002042	华孚时尚	255,100	971,931.00	0.10
361	002406	远东传动	196,800	970,224.00	0.10
362	301046	能辉科技	49,243	968,609.81	0.10
363	300025	华星创业	91,900	966,788.00	0.10
364	300304	云意电气	148,500	966,735.00	0.10
365	600744	华银电力	299,400	964,068.00	0.10
366	300248	新开普	148,500	963,765.00	0.10
367	000612	焦作万方	147,900	961,350.00	0.10
368	000911	广农糖业	148,700	960,602.00	0.10
369	301018	申菱环境	49,200	956,448.00	0.10

370	002519	银河电子	194,600	955,486.00	0.10
371	300278	华昌达	332,200	953,414.00	0.09
372	300548	博创科技	48,900	953,061.00	0.09
373	002471	中超控股	488,200	951,990.00	0.09
374	002375	亚厦股份	292,700	951,275.00	0.09
375	600130	波导股份	298,100	950,939.00	0.09
376	300047	天源迪科	145,400	950,916.00	0.09
377	300631	久吾高科	49,600	949,840.00	0.09
378	300290	荣科科技	102,000	949,620.00	0.09
379	600300	维维股份	394,300	946,320.00	0.09
380	300147	香雪制药	295,500	945,600.00	0.09
381	688238	和元生物	204,000	944,520.00	0.09
382	002536	飞龙股份	99,100	943,432.00	0.09
383	002523	天桥起重	438,300	942,345.00	0.09
384	301076	新瀚新材	48,600	941,382.00	0.09
385	000014	沙河股份	98,300	940,731.00	0.09
386	002667	威领股份	199,600	940,116.00	0.09
387	603508	思维列控	49,800	933,750.00	0.09
388	600495	晋西车轴	289,800	930,258.00	0.09
389	600410	华胜天成	240,100	929,187.00	0.09
390	300252	金信诺	148,500	928,125.00	0.09
391	002553	南方精工	100,100	927,927.00	0.09
392	603018	华设集团	102,000	927,180.00	0.09
393	600769	祥龙电业	147,100	925,259.00	0.09
394	000523	红棉股份	357,100	924,889.00	0.09
395	600353	旭光电子	149,900	924,883.00	0.09
396	002668	TCL 智家	102,000	924,120.00	0.09
397	603227	雪峰科技	148,400	920,080.00	0.09
398	002676	顺威股份	198,000	916,740.00	0.09
399	002527	新时达	153,000	916,470.00	0.09
400	000797	中国武夷	392,900	915,457.00	0.09
401	600616	金枫酒业	190,200	912,960.00	0.09
402	688108	赛诺医疗	102,000	911,880.00	0.09
403	300302	同有科技	99,100	904,783.00	0.09
404	002380	科远智慧	49,400	904,020.00	0.09
405	603629	利通电子	48,900	902,694.00	0.09
406	301201	诚达药业	49,586	902,465.20	0.09
407	605133	嵘泰股份	49,200	901,836.00	0.09
408	300629	新劲刚	51,000	900,660.00	0.09
409	002297	博云新材	150,100	900,600.00	0.09
410	300975	商络电子	99,100	895,864.00	0.09
411	002093	国脉科技	147,400	894,718.00	0.09
412	000812	陕西金叶	248,200	891,038.00	0.09

413	600279	重庆港	244,600	887,898.00	0.09
414	002122	汇洲智能	424,000	886,160.00	0.09
415	300684	中石科技	51,000	884,340.00	0.09
416	600868	梅雁吉祥	545,800	884,196.00	0.09
417	603011	合锻智能	149,100	884,163.00	0.09
418	003015	日久光电	97,300	883,484.00	0.09
419	000421	南京公用	198,800	882,672.00	0.09
420	300472	新元科技	199,100	882,013.00	0.09
421	002512	达华智能	255,100	880,095.00	0.09
422	300307	慈星股份	147,700	878,815.00	0.09
423	002479	富春环保	249,600	878,592.00	0.09
424	603012	创力集团	196,900	878,174.00	0.09
425	000931	中关村	248,200	876,146.00	0.09
426	301215	中汽股份	149,500	876,070.00	0.09
427	000936	华西股份	153,000	875,160.00	0.09
428	002112	三变科技	98,300	872,904.00	0.09
429	000819	岳阳兴长	48,600	868,482.00	0.09
430	300061	旗天科技	193,800	868,224.00	0.09
431	600310	广西能源	249,400	867,912.00	0.09
432	300099	尤洛卡	191,100	867,594.00	0.09
433	688609	九联科技	98,179	865,938.78	0.09
434	002575	群兴玩具	196,701	865,484.40	0.09
435	000055	方大集团	245,700	859,950.00	0.09
436	301302	华如科技	49,800	859,050.00	0.09
437	300468	四方精创	99,100	858,206.00	0.09
438	688319	欧林生物	95,797	857,383.15	0.09
439	002090	金智科技	99,100	856,224.00	0.09
440	300341	麦克奥迪	99,100	850,278.00	0.08
441	600992	贵绳股份	50,100	849,696.00	0.08
442	000576	甘化科工	141,600	849,600.00	0.08
443	603611	诺力股份	49,800	848,592.00	0.08
444	002469	三维化学	148,500	846,450.00	0.08
445	002614	奥佳华	153,000	846,090.00	0.08
446	002448	中原内配	147,400	846,076.00	0.08
447	002334	英威腾	141,400	845,572.00	0.08
448	600293	三峡新材	339,542	845,459.58	0.08
449	000037	深南电 A	96,600	845,250.00	0.08
450	001896	豫能控股	195,200	843,264.00	0.08
451	600824	益民集团	289,100	841,281.00	0.08
452	000859	国风新材	244,600	836,532.00	0.08
453	600106	重庆路桥	194,100	834,630.00	0.08
454	002491	通鼎互联	246,200	832,156.00	0.08
455	301226	祥明智能	50,000	832,000.00	0.08

456	600379	宝光股份	100,100	829,829.00	0.08
457	002687	乔治白	197,482	829,424.40	0.08
458	688306	均普智能	204,000	828,240.00	0.08
459	002771	真视通	51,000	826,710.00	0.08
460	002246	北化股份	98,300	826,703.00	0.08
461	000036	华联控股	255,100	826,524.00	0.08
462	300556	丝路视觉	49,400	826,462.00	0.08
463	002731	萃华珠宝	98,200	823,898.00	0.08
464	300662	科锐国际	51,000	822,630.00	0.08
465	002362	汉王科技	49,400	822,510.00	0.08
466	603222	济民医疗	149,400	821,700.00	0.08
467	002725	跃岭股份	98,200	820,952.00	0.08
468	603626	科森科技	147,500	820,100.00	0.08
469	300547	川环科技	50,100	819,135.00	0.08
470	002560	通达股份	148,500	816,750.00	0.08
471	300538	同益股份	50,100	814,626.00	0.08
472	600071	凤凰光学	49,800	813,234.00	0.08
473	603069	海汽集团	49,900	810,875.00	0.08
474	002548	金新农	199,400	809,564.00	0.08
475	600513	联环药业	99,800	809,378.00	0.08
476	300903	科翔股份	98,100	808,344.00	0.08
477	600278	东方创业	150,100	806,037.00	0.08
478	605066	天正电气	144,050	802,358.50	0.08
479	000505	京粮控股	147,400	801,856.00	0.08
480	300537	广信材料	50,100	798,594.00	0.08
481	688165	埃夫特	102,000	797,640.00	0.08
482	002786	银宝山新	99,100	794,782.00	0.08
483	600860	京城股份	98,400	794,088.00	0.08
484	300493	润欣科技	97,900	792,011.00	0.08
485	603319	湘油泵	49,400	789,906.00	0.08
486	600858	银座股份	200,100	786,393.00	0.08
487	300520	科大国创	49,200	784,740.00	0.08
488	300221	银禧科技	148,900	783,214.00	0.08
489	300046	台基股份	49,400	780,520.00	0.08
490	300211	亿通科技	147,300	779,217.00	0.08
491	002235	安妮股份	196,400	777,744.00	0.08
492	002198	嘉应制药	102,000	775,200.00	0.08
493	300471	厚普股份	98,300	774,604.00	0.08
494	002480	新筑股份	248,000	773,760.00	0.08
495	600665	天地源	347,500	771,450.00	0.08
496	300120	经纬辉开	148,500	770,715.00	0.08
497	301248	杰创智能	51,000	768,570.00	0.08
498	600162	香江控股	577,200	767,676.00	0.08

499	300375	鹏翎股份	198,200	767,034.00	0.08
500	600853	龙建股份	249,700	766,579.00	0.08
501	001219	青岛食品	65,120	766,462.40	0.08
502	000159	国际实业	146,400	764,208.00	0.08
503	002133	广宇集团	342,200	763,106.00	0.08
504	603065	宿迁联盛	102,000	761,940.00	0.08
505	300335	迪森股份	196,800	761,616.00	0.08
506	300756	金马游乐	51,000	760,920.00	0.08
507	300581	晨曦航空	99,200	760,864.00	0.08
508	600619	海立股份	146,900	759,473.00	0.08
509	002264	新华都	148,600	759,346.00	0.08
510	600237	铜峰电子	145,000	756,900.00	0.08
511	688079	美迪凯	102,000	756,840.00	0.08
512	603015	弘讯科技	100,100	756,756.00	0.08
513	002360	同德化工	149,500	756,470.00	0.08
514	300469	信息发展	49,400	755,820.00	0.08
515	002169	智光电气	171,200	754,992.00	0.08
516	300691	联合光电	50,100	754,005.00	0.08
517	603686	福龙马	98,700	752,094.00	0.07
518	300374	中铁装配	49,200	751,776.00	0.07
519	002441	众业达	99,100	751,178.00	0.07
520	300436	广生堂	47,700	749,367.00	0.07
521	600113	浙江东日	98,300	749,046.00	0.07
522	000509	华塑控股	290,600	746,842.00	0.07
523	300710	万隆光电	49,200	746,364.00	0.07
524	300584	海辰药业	49,000	746,270.00	0.07
525	300342	天银机电	51,000	746,130.00	0.07
526	000788	北大医药	149,500	746,005.00	0.07
527	300479	神思电子	49,400	744,952.00	0.07
528	300280	紫天科技	48,800	743,712.00	0.07
529	301118	恒光股份	49,800	742,518.00	0.07
530	002395	双象股份	49,400	742,482.00	0.07
531	603969	银龙股份	149,600	742,016.00	0.07
532	000592	平潭发展	569,600	740,480.00	0.07
533	300796	贝斯美	51,000	737,970.00	0.07
534	300578	会畅通讯	49,800	737,040.00	0.07
535	300225	金力泰	148,900	731,099.00	0.07
536	300365	恒华科技	148,500	729,135.00	0.07
537	601789	宁波建工	198,000	728,640.00	0.07
538	002218	拓日新能	255,100	727,035.00	0.07
539	002935	天奥电子	59,980	724,558.40	0.07
540	000920	沃顿科技	98,600	722,738.00	0.07
541	300740	水羊股份	49,200	722,256.00	0.07

542	600653	申华控股	600,600	720,720.00	0.07
543	300465	高伟达	99,100	720,457.00	0.07
544	600558	大西洋	200,100	720,360.00	0.07
545	002766	索菱股份	148,500	718,740.00	0.07
546	300853	申昊科技	49,400	718,276.00	0.07
547	002666	德联集团	198,200	717,484.00	0.07
548	300686	智动力	98,900	717,025.00	0.07
549	301063	海锅股份	50,000	717,000.00	0.07
550	300093	金刚光伏	51,000	716,550.00	0.07
551	002852	道道全	99,100	713,520.00	0.07
552	300189	神农种业	398,000	712,420.00	0.07
553	002084	海鸥住工	290,600	711,970.00	0.07
554	600784	鲁银投资	150,100	711,474.00	0.07
555	000716	黑芝麻	196,400	710,968.00	0.07
556	300066	三川智慧	248,000	709,280.00	0.07
557	600020	中原高速	200,100	708,354.00	0.07
558	002682	龙洲股份	198,400	706,304.00	0.07
559	300247	融捷健康	290,600	706,158.00	0.07
560	300534	陇神戎发	99,700	705,876.00	0.07
561	002037	保利联合	100,100	705,705.00	0.07
562	002708	光洋股份	97,800	705,138.00	0.07
563	002565	顺灏股份	294,000	702,660.00	0.07
564	601116	三江购物	92,100	700,881.00	0.07
565	600215	派斯林	98,100	699,453.00	0.07
566	600408	安泰集团	442,200	698,676.00	0.07
567	600354	敦煌种业	146,400	698,328.00	0.07
568	002551	尚荣医疗	299,500	697,835.00	0.07
569	000593	德龙汇能	149,500	696,670.00	0.07
570	300164	通源石油	198,400	694,400.00	0.07
571	002445	中南文化	420,600	693,990.00	0.07
572	002067	景兴纸业	255,100	693,872.00	0.07
573	300510	金冠股份	198,200	693,700.00	0.07
574	002342	巨力索具	240,200	691,776.00	0.07
575	000753	漳州发展	245,700	690,417.00	0.07
576	002149	西部材料	49,400	689,624.00	0.07
577	600818	中路股份	49,100	686,418.00	0.07
578	002561	徐家汇	98,600	686,256.00	0.07
579	300533	冰川网络	49,400	685,672.00	0.07
580	000721	西安饮食	99,100	684,781.00	0.07
581	600218	全柴动力	102,000	684,420.00	0.07
582	600560	金自天正	51,000	683,400.00	0.07
583	002420	毅昌科技	148,700	678,072.00	0.07
584	300467	迅游科技	49,400	676,780.00	0.07

585	600257	大湖股份	149,300	673,343.00	0.07
586	000570	苏常柴 A	150,100	670,947.00	0.07
587	002628	成都路桥	345,800	667,394.00	0.07
588	300426	唐德影视	98,200	665,796.00	0.07
589	600159	大龙地产	297,300	660,006.00	0.07
590	600960	渤海汽车	247,900	659,414.00	0.07
591	002306	中科云网	247,700	658,882.00	0.07
592	300490	华自科技	91,900	658,004.00	0.07
593	002146	荣盛发展	441,500	657,835.00	0.07
594	600785	新华百货	49,000	657,580.00	0.07
595	300019	硅宝科技	49,600	657,200.00	0.07
596	301197	工大科雅	49,800	653,376.00	0.07
597	002845	同兴达	49,400	653,068.00	0.07
598	002659	凯文教育	199,400	652,038.00	0.06
599	002792	通宇通讯	62,400	651,456.00	0.06
600	002298	中电兴发	147,100	650,182.00	0.06
601	300940	南极光	51,000	649,740.00	0.06
602	300872	天阳科技	49,000	649,250.00	0.06
603	300094	国联水产	255,100	647,954.00	0.06
604	002995	天地在线	49,000	646,800.00	0.06
605	300612	宣亚国际	49,600	645,792.00	0.06
606	002546	新联电子	198,200	644,150.00	0.06
607	300681	英搏尔	49,300	642,872.00	0.06
608	000782	恒申新材	146,800	640,048.00	0.06
609	000886	海南高速	153,000	639,540.00	0.06
610	003016	欣贺股份	102,000	638,520.00	0.06
611	002552	宝鼎科技	49,000	637,980.00	0.06
612	600620	天宸股份	149,400	637,938.00	0.06
613	600629	华建集团	146,000	636,560.00	0.06
614	002208	合肥城建	147,400	635,294.00	0.06
615	688285	高铁电气	98,648	634,306.64	0.06
616	603035	常熟汽饰	50,000	634,000.00	0.06
617	002282	博深股份	99,100	633,249.00	0.06
618	300137	先河环保	148,100	630,906.00	0.06
619	600501	航天晨光	49,000	630,630.00	0.06
620	603808	歌力思	99,600	630,468.00	0.06
621	300279	和晶科技	150,100	625,917.00	0.06
622	002082	万邦德	148,600	625,606.00	0.06
623	000926	福星股份	197,200	625,124.00	0.06
624	300645	正元智慧	49,400	623,922.00	0.06
625	300504	天邑股份	51,000	621,690.00	0.06
625	300505	川金诺	51,000	621,690.00	0.06
626	300707	威唐工业	50,000	619,000.00	0.06

627	603135	中重科技	49,400	618,982.00	0.06
628	002686	亿利达	147,700	618,863.00	0.06
629	603333	尚纬股份	198,600	617,646.00	0.06
630	600127	金健米业	102,000	615,060.00	0.06
631	002514	宝馨科技	148,500	613,305.00	0.06
632	300786	国林科技	50,000	613,000.00	0.06
633	002055	得润电子	91,000	612,430.00	0.06
634	300933	中辰股份	99,200	610,080.00	0.06
635	300466	赛摩智能	99,100	607,483.00	0.06
636	603767	中马传动	50,000	604,500.00	0.06
637	002150	通润装备	49,397	604,125.31	0.06
638	300512	中亚股份	102,000	603,840.00	0.06
639	300503	昊志机电	49,400	603,174.00	0.06
640	300542	新晨科技	49,000	602,210.00	0.06
641	300291	百纳千成	141,200	601,512.00	0.06
642	300713	英可瑞	49,500	599,940.00	0.06
643	002350	北京科锐	102,000	599,760.00	0.06
644	002248	华东数控	100,100	599,599.00	0.06
645	002685	华东重机	255,100	599,485.00	0.06
646	600730	中国高科	150,100	598,899.00	0.06
647	603639	海利尔	48,811	594,029.87	0.06
648	300441	鲍斯股份	100,100	593,593.00	0.06
649	300052	中青宝	49,400	593,294.00	0.06
650	002757	南兴股份	49,200	592,860.00	0.06
651	600814	杭州解百	100,045	590,265.50	0.06
652	688509	正元地信	204,000	589,560.00	0.06
653	300424	航新科技	48,200	589,486.00	0.06
654	002772	众兴菌业	98,200	588,218.00	0.06
655	300997	欢乐家	49,600	586,272.00	0.06
656	600203	福日电子	92,000	584,200.00	0.06
657	300345	华民股份	95,100	582,963.00	0.06
658	300589	江龙船艇	49,000	582,120.00	0.06
659	600721	百花医药	100,100	580,580.00	0.06
660	002167	东方锆业	102,000	580,380.00	0.06
661	002520	日发精机	153,000	579,870.00	0.06
662	002009	天奇股份	51,000	578,340.00	0.06
663	300831	派瑞股份	51,000	576,810.00	0.06
664	002022	科华生物	102,000	576,300.00	0.06
665	002210	飞马国际	420,600	576,222.00	0.06
666	000635	英力特	98,200	574,470.00	0.06
667	300572	安车检测	49,400	574,028.00	0.06
668	002363	隆基机械	99,100	573,789.00	0.06
669	002584	西陇科学	102,000	573,240.00	0.06

670	300585	奥联电子	49,400	570,076.00	0.06
671	300486	东杰智能	99,100	568,834.00	0.06
672	603110	东方材料	51,000	567,630.00	0.06
673	603318	水发燃气	100,100	566,566.00	0.06
674	300400	劲拓股份	49,400	565,136.00	0.06
675	002377	国创高新	319,200	564,984.00	0.06
676	002875	安奈儿	51,000	562,530.00	0.06
677	002175	东方智造	319,200	561,792.00	0.06
678	002253	川大智胜	49,600	561,472.00	0.06
679	002119	康强电子	50,100	561,120.00	0.06
680	002337	赛象科技	147,400	560,120.00	0.06
681	600683	京投发展	149,400	557,262.00	0.06
682	688189	南新制药	98,973	557,217.99	0.06
683	600526	菲达环保	150,100	556,871.00	0.06
684	300317	珈伟新能	147,700	556,829.00	0.06
685	600628	新世界	102,000	552,840.00	0.06
686	000838	财信发展	247,700	552,371.00	0.06
687	002849	威星智能	49,400	551,304.00	0.05
688	600249	两面针	150,100	550,867.00	0.05
689	000816	智慧农业	369,700	550,853.00	0.05
690	000510	新金路	198,000	548,460.00	0.05
691	600661	昂立教育	48,700	546,901.00	0.05
692	000428	华天酒店	196,400	545,992.00	0.05
693	002799	环球印务	92,100	541,548.00	0.05
694	600838	上海九百	100,100	538,538.00	0.05
695	001267	汇绿生态	102,000	537,540.00	0.05
696	002438	江苏神通	49,600	536,176.00	0.05
697	600613	神奇制药	100,100	535,535.00	0.05
698	000530	冰山冷热	147,700	534,674.00	0.05
699	300032	金龙机电	171,300	532,743.00	0.05
700	002733	雄韬股份	49,400	532,038.00	0.05
700	300100	双林股份	49,400	532,038.00	0.05
701	301013	利和兴	49,800	531,864.00	0.05
702	002343	慈文传媒	102,000	530,400.00	0.05
703	300501	海顺新材	49,200	530,376.00	0.05
704	300560	中富通	49,000	530,180.00	0.05
705	603917	合力科技	48,900	529,098.00	0.05
706	002451	摩恩电气	98,500	528,945.00	0.05
707	603165	荣晟环保	49,800	528,876.00	0.05
708	002712	思美传媒	148,500	527,175.00	0.05
709	603701	德宏股份	49,800	526,884.00	0.05
710	301120	新特电气	50,650	526,253.50	0.05
711	603630	拉芳家化	49,994	525,436.94	0.05

712	600187	国中水务	382,900	524,573.00	0.05
713	600503	华丽家族	292,900	524,291.00	0.05
714	300288	朗玛信息	49,400	522,158.00	0.05
715	002805	丰元股份	49,800	521,406.00	0.05
716	300650	太龙股份	49,000	520,870.00	0.05
717	300778	新城市	49,200	520,536.00	0.05
718	300649	杭州园林	49,800	519,414.00	0.05
719	603887	城地香江	99,600	518,916.00	0.05
720	300636	同和药业	51,000	518,670.00	0.05
721	002300	太阳电缆	98,200	518,496.00	0.05
722	300551	古鳌科技	91,900	517,397.00	0.05
723	000407	胜利股份	198,200	517,302.00	0.05
724	300063	天龙集团	134,800	513,588.00	0.05
725	300730	科创信息	49,400	513,266.00	0.05
726	002613	北玻股份	147,400	512,952.00	0.05
727	600540	新赛股份	150,100	511,841.00	0.05
728	002642	荣联科技	99,100	511,356.00	0.05
729	000790	华神科技	147,700	511,042.00	0.05
730	000659	珠海中富	393,000	510,900.00	0.05
731	002953	日丰股份	65,120	510,540.80	0.05
732	600698	湖南天雁	150,100	508,839.00	0.05
733	603776	永安行	51,000	505,920.00	0.05
734	600230	沧州大化	49,800	504,474.00	0.05
735	600178	东安动力	50,000	501,000.00	0.05
736	000534	万泽股份	50,100	497,493.00	0.05
737	601798	蓝科高新	98,500	487,575.00	0.05
738	603315	福鞍股份	51,000	486,540.00	0.05
739	002361	神剑股份	150,100	486,324.00	0.05
740	300515	三德科技	49,200	485,604.00	0.05
741	600228	返利科技	99,000	481,140.00	0.05
742	002213	大为股份	49,200	479,700.00	0.05
743	002374	中锐股份	274,100	479,675.00	0.05
744	603330	天洋新材	100,100	479,479.00	0.05
745	300062	中能电气	98,200	478,234.00	0.05
746	002593	日上集团	148,500	475,200.00	0.05
747	603999	读者传媒	99,600	471,108.00	0.05
748	603777	来伊份	50,100	469,437.00	0.05
749	000715	中兴商业	98,200	467,432.00	0.05
750	002524	光正眼科	147,700	465,255.00	0.05
751	002729	好利科技	50,000	464,000.00	0.05
752	000514	渝开发	147,400	462,836.00	0.05
753	002348	高乐股份	204,000	461,040.00	0.05
754	600545	卓郎智能	343,400	460,156.00	0.05

755	000850	华茂股份	151,000	459,040.00	0.05
756	000717	中南股份	269,200	454,948.00	0.05
757	300614	百川畅银	50,000	454,500.00	0.05
758	300439	美康生物	49,400	452,504.00	0.05
759	603339	四方科技	49,800	451,686.00	0.04
760	600280	中央商场	200,100	450,225.00	0.04
761	300968	格林精密	48,600	450,036.00	0.04
762	300541	先进数通	50,060	449,538.80	0.04
763	600624	复旦复华	150,100	445,797.00	0.04
764	002474	榕基软件	102,000	444,720.00	0.04
765	600592	龙溪股份	51,000	442,170.00	0.04
766	603421	鼎信通讯	99,000	441,540.00	0.04
767	603017	中衡设计	49,800	441,228.00	0.04
768	002272	川润股份	98,200	439,936.00	0.04
769	002319	乐通股份	51,000	439,620.00	0.04
770	600439	瑞贝卡	204,000	438,600.00	0.04
771	688373	盟科药业	100,195	435,848.25	0.04
772	600081	东风科技	49,800	435,750.00	0.04
773	603990	麦迪科技	49,800	433,758.00	0.04
774	000955	欣龙控股	147,700	432,761.00	0.04
775	300412	迦南科技	150,100	432,288.00	0.04
776	000698	沈阳化工	141,200	429,248.00	0.04
777	000010	美丽生态	269,200	428,028.00	0.04
778	603106	恒银科技	100,100	426,426.00	0.04
779	300328	宜安科技	99,100	424,148.00	0.04
780	300884	狄耐克	49,200	424,104.00	0.04
781	002187	广百股份	102,000	421,260.00	0.04
782	600222	太龙药业	100,100	420,420.00	0.04
783	603778	国晟科技	149,400	419,814.00	0.04
784	300582	英飞特	49,000	419,440.00	0.04
785	002589	瑞康医药	190,400	418,880.00	0.04
786	603779	威龙股份	49,200	418,200.00	0.04
787	300165	天瑞仪器	195,500	414,460.00	0.04
788	603429	集友股份	99,600	413,340.00	0.04
789	600892	大晟文化	102,000	412,080.00	0.04
790	000663	永安林业	98,200	411,458.00	0.04
791	002622	皓宸医疗	294,800	409,772.00	0.04
792	002231	奥维通信	99,600	406,368.00	0.04
793	300056	中创环保	51,000	405,450.00	0.04
794	300149	睿智医药	102,000	403,920.00	0.04
794	603648	畅联股份	51,000	403,920.00	0.04
795	300258	精锻科技	49,000	398,370.00	0.04
796	300561	汇金科技	49,000	394,940.00	0.04

797	300543	朗科智能	49,200	393,600.00	0.04
798	000042	中洲控股	99,600	393,420.00	0.04
799	300404	博济医药	49,000	392,490.00	0.04
800	600822	上海物贸	49,800	389,436.00	0.04
801	600636	国新文化	51,000	382,500.00	0.04
802	002908	德生科技	49,800	381,966.00	0.04
803	000701	厦门信达	102,000	381,480.00	0.04
804	000518	四环生物	190,500	377,190.00	0.04
805	000757	浩物股份	147,700	370,727.00	0.04
806	300434	金石亚药	49,400	370,500.00	0.04
807	600405	动力源	102,000	368,220.00	0.04
808	002369	卓翼科技	99,600	367,524.00	0.04
809	002638	勤上股份	245,700	366,093.00	0.04
810	002795	永和智控	98,300	365,676.00	0.04
811	300310	宜通世纪	97,700	364,421.00	0.04
812	002634	棒杰股份	98,300	352,897.00	0.04
813	002730	电光科技	50,100	352,704.00	0.04
814	603158	腾龙股份	49,800	350,592.00	0.03
815	300086	康芝药业	99,100	347,841.00	0.03
816	300340	科恒股份	50,100	345,690.00	0.03
817	300391	长药控股	148,600	343,266.00	0.03
818	002547	春兴精工	141,200	341,704.00	0.03
819	600622	光大嘉宝	183,900	340,215.00	0.03
820	300603	立昂技术	49,000	338,590.00	0.03
821	002495	佳隆股份	244,700	337,686.00	0.03
822	300414	中光防雷	50,100	331,161.00	0.03
823	600792	云煤能源	100,100	329,329.00	0.03
824	300249	依米康	49,800	322,704.00	0.03
825	002689	远大智能	149,400	319,716.00	0.03
826	300381	溢多利	51,000	313,140.00	0.03
826	300485	赛升药业	51,000	313,140.00	0.03
827	002388	新亚制程	98,300	309,645.00	0.03
828	002723	小崧股份	49,200	308,484.00	0.03
829	002905	金逸影视	49,000	303,800.00	0.03
830	603336	宏辉果蔬	100,100	301,301.00	0.03
831	603617	君禾股份	51,000	300,900.00	0.03
832	603818	曲美家居	102,000	284,580.00	0.03
833	603028	赛福天	49,800	280,374.00	0.03
834	002329	皇氏集团	99,100	268,561.00	0.03
835	603122	合富中国	51,000	259,590.00	0.03
836	002769	普路通	49,000	256,270.00	0.03
837	002762	金发拉比	51,000	256,020.00	0.03
838	002103	广博股份	49,200	244,032.00	0.02

839	002148	北纬科技	50,100	232,965.00	0.02
840	002640	跨境通	149,400	195,714.00	0.02
840	300264	佳创视讯	49,800	195,714.00	0.02
841	603359	东珠生态	50,100	181,863.00	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

2024年7月11日起，证券代码为300189的证券简称由“神农科技”变更为“神农种业”。

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	002308	威创股份	80,900	159,373.00	0.02
2	301589	诺瓦星云	781	146,835.81	0.01
3	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
4	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
5	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
6	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
7	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
8	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
9	688709	成都华微	714	13,416.06	0.00
10	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
11	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
12	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
13	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	601033	永兴股份	559	8,921.64	0.00
16	688584	上海合晶	559	8,882.51	0.00
17	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
18	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
19	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
20	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
21	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
22	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
23	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
24	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
25	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
26	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
27	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
28	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
29	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
30	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
31	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
32	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
33	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

34	000836	ST 富通	334,000	0.00	0.00
34	002288	*ST 超华	312,900	0.00	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

截止 2024 年 6 月 30 日，本基金合计持有*ST 超华（股票代码：002288）312,900 股。于 2024 年 6 月 27 日，*ST 超华（股票代码：002288）发布关于公司股票将被终止上市暨停牌的风险提示公告。依据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，经与相关基金托管行协商一致，华泰柏瑞基金管理有限公司决定于 2024 年 6 月 27 日起对旗下指数基金所持有的“*ST 超华”（股票代码：002288）按照人民币 0.00 元进行估值。

截止 2024 年 6 月 30 日，本基金合计持有 ST 富通（股票代码：000836）334,000 股。于 2024 年 6 月 18 日，ST 富通（股票代码：000836）发布关于公司股票将被终止上市暨停牌的风险提示公告。依据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，经与相关基金托管行协商一致，华泰柏瑞基金管理有限公司决定于 2024 年 6 月 19 日起对旗下指数基金所持有的“ST 富通”（股票代码：000836）按照人民币 0.00 元进行估值。

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	300842	帝科股份	59,382,771.75	5.86
2	003000	劲仔食品	59,014,645.71	5.82
3	301391	卡莱特	52,136,285.65	5.15
4	003038	鑫铂股份	50,854,971.46	5.02
5	300815	玉禾田	48,903,449.25	4.83
6	002588	史丹利	48,167,110.52	4.75
7	300795	米奥会展	47,404,016.47	4.68
8	300729	乐歌股份	45,949,967.89	4.53
9	300349	金卡智能	45,481,969.31	4.49
10	301051	信濠光电	44,813,858.95	4.42
11	301004	嘉益股份	43,093,469.13	4.25
12	301030	仕净科技	42,771,500.55	4.22
13	000589	贵州轮胎	41,714,198.37	4.12
14	300938	信测标准	41,170,419.60	4.06
15	301101	明月镜片	41,162,492.14	4.06
16	300444	双杰电气	38,446,745.57	3.79
17	002919	名臣健康	37,577,437.00	3.71
18	300779	惠城环保	37,526,753.40	3.70
19	002912	中新赛克	37,114,153.35	3.66
20	000888	峨眉山 A	36,940,902.36	3.65

21	002870	香山股份	36,678,092.00	3.62
22	002478	常宝股份	36,129,450.21	3.57
23	002947	恒铭达	36,075,284.45	3.56
24	300969	恒帅股份	35,796,482.26	3.53
25	300926	博俊科技	35,361,919.88	3.49
26	301162	国能日新	35,281,200.30	3.48
27	300592	华凯易佰	34,669,424.81	3.42
28	002971	和远气体	34,179,776.46	3.37
29	300355	蒙草生态	34,104,614.40	3.37
30	000521	长虹美菱	34,023,215.69	3.36
31	002833	弘亚数控	33,739,175.36	3.33
32	003028	振邦智能	33,240,377.18	3.28
33	301266	宇邦新材	33,231,087.10	3.28
34	301278	快可电子	33,059,130.12	3.26
35	002285	世联行	33,048,967.50	3.26
36	002752	昇兴股份	32,836,792.90	3.24
37	002452	长高电新	32,595,150.95	3.22
38	301195	北路智控	32,095,179.40	3.17
39	002983	芯瑞达	29,692,754.69	2.93
40	300389	艾比森	28,566,733.31	2.82
41	002154	报喜鸟	28,290,719.41	2.79
42	300452	山河药辅	27,021,775.60	2.67
43	300990	同飞股份	27,011,861.96	2.67
44	300181	佐力药业	26,558,435.00	2.62
45	000099	中信海直	26,028,954.27	2.57
46	002315	焦点科技	25,859,170.13	2.55
47	002641	公元股份	25,603,888.00	2.53
48	300020	*ST 银江	25,532,843.08	2.52
49	301061	匠心家居	25,467,188.44	2.51
50	002878	元隆雅图	24,983,255.00	2.47
51	300396	迪瑞医疗	24,763,168.50	2.44
52	002301	齐心集团	24,415,204.68	2.41
53	002630	华西能源	24,399,299.13	2.41
54	301093	华兰股份	24,271,120.99	2.40
55	300881	盛德鑫泰	23,967,708.97	2.37
56	002970	锐明技术	23,765,364.21	2.35
57	002270	华明装备	23,669,006.56	2.34
58	300491	通合科技	22,349,661.28	2.21
59	300545	联得装备	22,295,802.00	2.20
60	300360	炬华科技	21,493,322.53	2.12
61	002956	西麦食品	21,262,961.01	2.10
62	301257	普蕊斯	21,108,844.35	2.08
63	003029	吉大正元	21,001,184.48	2.07

64	300840	酷特智能	20,774,723.00	2.05
65	300857	协创数据	20,367,665.41	2.01

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	300842	帝科股份	64,513,162.60	6.37
2	003000	劲仔食品	62,646,969.72	6.18
3	003038	鑫铂股份	54,816,119.36	5.41
4	300815	玉禾田	52,395,614.38	5.17
5	300795	米奥会展	51,510,856.84	5.08
6	301004	嘉益股份	49,574,577.74	4.89
7	301391	卡莱特	49,507,842.78	4.89
8	300349	金卡智能	49,360,734.52	4.87
9	002588	史丹利	49,319,364.37	4.87
10	300729	乐歌股份	49,231,166.20	4.86
11	301030	仕净科技	47,472,592.01	4.69
12	002912	中新赛克	45,496,491.75	4.49
13	300926	博俊科技	44,476,051.22	4.39
14	300779	惠城环保	44,104,137.32	4.35
15	301051	信濠光电	43,390,898.95	4.28
16	000589	贵州轮胎	42,810,230.70	4.22
17	300938	信测标准	42,635,563.39	4.21
18	300444	双杰电气	42,240,462.00	4.17
19	002947	恒铭达	41,852,972.71	4.13
20	002919	名臣健康	41,526,254.98	4.10
21	301101	明月镜片	41,447,324.91	4.09
22	002870	香山股份	40,988,714.00	4.05
23	301162	国能日新	40,965,830.50	4.04
24	000888	峨眉山 A	40,236,501.71	3.97
25	301266	宇邦新材	38,483,798.02	3.80
26	301278	快可电子	37,795,049.23	3.73
27	002478	常宝股份	37,582,570.00	3.71
28	002285	世联行	37,508,680.80	3.70
29	300969	恒帅股份	37,156,526.55	3.67
30	002452	长高电新	36,918,071.00	3.64
31	300355	蒙草生态	35,949,262.20	3.55
32	300592	华凯易佰	35,841,734.27	3.54
33	000521	长虹美菱	35,624,437.66	3.52
34	002971	和远气体	35,570,843.00	3.51
35	002752	昇兴股份	35,099,318.10	3.46
36	002833	弘亚数控	34,965,990.39	3.45

37	003028	振邦智能	34,627,116.33	3.42
38	301195	北路智控	34,257,444.49	3.38
39	300990	同飞股份	33,893,777.62	3.34
40	002983	芯瑞达	33,414,282.54	3.30
41	002315	焦点科技	32,112,828.40	3.17
42	300020	*ST 银江	31,738,880.95	3.13
43	002154	报喜鸟	31,329,995.48	3.09
44	002878	元隆雅图	31,268,208.10	3.09
45	300389	艾比森	30,291,680.74	2.99
46	300452	山河药辅	28,709,629.51	2.83
47	300881	盛德鑫泰	28,496,593.65	2.81
48	002641	公元股份	27,876,085.00	2.75
49	000099	中信海直	27,753,184.31	2.74
50	002630	华西能源	27,453,232.00	2.71
51	300181	佐力药业	27,142,551.00	2.68
52	002270	华明装备	26,894,872.33	2.65
53	002301	齐心集团	26,838,580.36	2.65
54	301061	匠心家居	25,976,828.24	2.56
55	300857	协创数据	25,782,583.00	2.54
56	300491	通合科技	25,070,477.00	2.47
57	003029	吉大正元	25,019,808.22	2.47
58	002970	锐明技术	25,004,073.00	2.47
59	300545	联得装备	24,316,689.09	2.40
60	301093	华兰股份	24,192,865.81	2.39
61	300396	迪瑞医疗	24,120,336.00	2.38
62	301185	鸥玛软件	23,181,802.66	2.29
63	300049	福瑞股份	23,074,904.71	2.28
64	300654	世纪天鸿	22,819,239.65	2.25
65	002956	西麦食品	22,763,481.12	2.25
66	300559	佳发教育	22,642,034.01	2.23
67	002443	金洲管道	22,258,051.00	2.20
68	300360	炬华科技	22,142,286.16	2.19
69	301257	普蕊斯	22,089,324.43	2.18
70	002803	吉宏股份	22,037,060.18	2.17
71	300731	科创新源	21,623,102.88	2.13
72	300105	龙源技术	21,603,261.36	2.13
73	300314	戴维医疗	21,550,620.97	2.13
74	300840	酷特智能	20,962,544.00	2.07
75	300421	力星股份	20,781,686.20	2.05
76	300354	东华测试	20,334,129.58	2.01
77	300092	科新机电	20,327,450.92	2.01

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	6,195,537,821.38
卖出股票收入（成交）总额	6,496,607,246.61

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

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。

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	3,713,742.47
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	3,789,151.59

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	002308	威创股份	159,373.00	0.02	重大事项停牌
2	301589	诺瓦星云	146,835.81	0.01	新股锁定期内
3	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股锁定期内
4	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
5	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市

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	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

		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 (%)
11,936	105,870.81	482,486,317.00	38.18	747,253,483.00	59.13	33,934,200.00	2.69

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	中国人寿保险股份有限公司	162,936,200.00	12.89
2	卢文星	51,918,400.00	4.11
3	中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	31,677,971.00	2.51
4	中国平安人寿保险股份有限公司一自有资金	21,694,370.00	1.72
5	东北证券股份有限公司融券专用证券账户	16,381,800.00	1.30
6	吴伟健	14,440,000.00	1.14
7	弘康人寿保险股份有限公司一自有	13,000,000.00	1.03
8	三亚御峰盛私募基金管理有限公司一御峰盛小绵羊壹号私募证券投资基金	12,400,000.00	0.98
9	中国平安人寿保险股份有限公司一万能一个险万能	12,317,900.00	0.97
10	BARCLAYS BANK PLC	10,267,516.00	0.81
11	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	33,934,200.00	2.69

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	0.00	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	0

负责人持有本开放式基金	
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（2023 年 9 月 6 日）基金份额总额	588,674,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,003,674,000.00
本报告期基金总申购份额	11,802,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	11,542,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,263,674,000.00

§ 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 (%)	
中信证券	2	11,943,200,173.11	94.11	1,026,782.93	66.53	-
中信建投	2	289,961,882.99	2.28	274,264.80	17.77	-
方正证券	4	236,602,194.94	1.86	47,946.62	3.11	-
银河证券	2	173,607,255.61	1.37	151,709.58	9.83	-
广发证券	2	43,153,207.47	0.34	38,887.72	2.52	-
华泰证券	5	3,881,879.76	0.03	3,671.94	0.24	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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、本基金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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	482,736.86	100.00	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024年06月28日
2	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
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024年06月20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分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024年05月29日
5	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	证监会规定报刊和网站	2024年03月29日

	事非法活动的公告		
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 24 日
8	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
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
10	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
11	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
12	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
13	关于同意国泰君安证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 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 02 日
14	关于同意中国银河证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 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 02 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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