

华泰柏瑞中证 500 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	7
§ 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	12
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	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64

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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末上市基金前十名持有人	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
场内简称	ETF500（扩位证券简称：中证 500 指数 ETF）
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	391,429,801.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 6 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，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，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证	北京市西城区复兴门内大街 1 号

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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 华泰柏瑞基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	-17,251,896.28
本期利润	-37,941,138.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0968
本期加权平均净值利润率	-6.71%
本期基金份额净值增长率	-7.39%
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	-248,224,979.94
期末可供分配基金份额利润	-0.6341
期末基金资产净值	539,104,093.52
期末基金份额净值	1.3773
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	-30.19%

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、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。

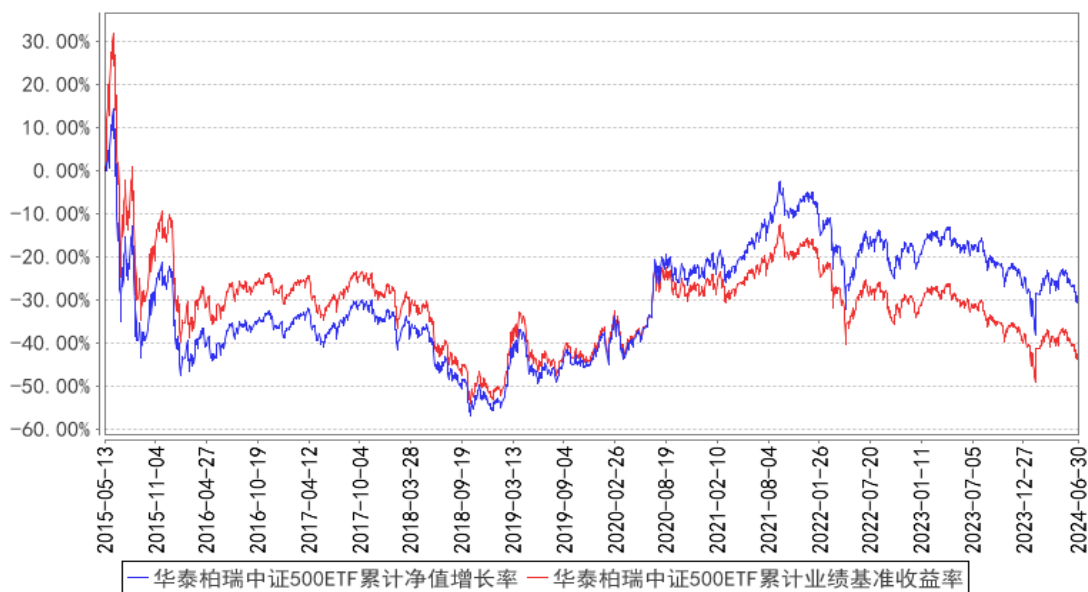
3.2 基金净值表现

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	-6.03%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.86%	0.00%
过去三个月	-5.04%	1.14%	-6.50%	1.14%	1.46%	0.00%
过去六个月	-7.39%	1.60%	-8.96%	1.61%	1.57%	-0.01%
过去一年	-14.97%	1.27%	-17.60%	1.27%	2.63%	0.00%
过去三年	-18.34%	1.19%	-27.40%	1.20%	9.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-30.19%	1.57%	-43.48%	1.59%	13.29%	-0.02%

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

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



注：图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 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	2015 年 5 月 13 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

				<p>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 年上半年，市场呈现先扬后抑，二季度回调较大。随着积极政策的陆续出台，市场情绪显著提振，市场已经逐渐从过度悲观的预期中走出。基本面方面，制造业投资保持一定韧性，设备更新、新质生产力等对制造业投资持续助力。全球制造业回暖，外需延续向好或有利于我国出口。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.028%，期间日跟踪误差为 0.036%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3773 元，本报告期基金份额净值增长率为 -7.39%，业绩

比较基准收益率为-8.96%。

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，进入中报业绩披露期与政策关键窗口期，市场将受到上市公司业绩与改革力度预期的共振影响。同时，也受到海外流动性对市场仍有扰动，可能更多呈现震荡行情，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，中国资产有望相对收益，在历经修复后市场整体估值仍在偏低水平，与全球市场相比 A 股市场的估值比较具有吸引力，建议寻找结构性机会。

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，基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的 100%；基金收益分配每年至多 4 次。截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

4.8 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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 500 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	16,704,679.31	9,693,346.18
结算备付金		6,504,106.25	8,013,161.97
存出保证金		2,847,272.93	2,128,670.68
交易性金融资产	6.4.7.2	513,398,215.42	557,967,592.01
其中：股票投资		513,317,209.38	557,931,190.89
基金投资		-	-
债券投资		81,006.04	36,401.12
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		44,014.94	282,371.24
应收股利		27,807.92	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	7,949.30	18,392.79
资产总计		539,534,046.07	578,103,534.87
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		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		69,039.22	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		67,627.88	72,137.29
应付托管费		22,542.65	24,045.77
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.19	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	270,742.61	318,951.48
负债合计		429,952.55	415,134.54
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	787,329,073.46	781,294,818.50
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-248,224,979.94	-203,606,418.17
净资产合计		539,104,093.52	577,688,400.33
负债和净资产总计		539,534,046.07	578,103,534.87

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3773 元，基金份额总额 391,429,801.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-37,198,293.77	25,132,226.80

1. 利息收入		420,948.09	101,689.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	85,781.12	90,555.08
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		335,166.97	11,133.92
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-16,925,320.74	-1,189,673.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-23,599,603.76	-6,974,728.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	26,324.74	72,043.78
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-371,842.83	-108,720.25
股利收益	6.4.7.19	7,019,801.11	5,821,730.95
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	-20,689,242.68	26,215,131.70
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	-4,678.44	5,079.65
减：二、营业总支出		742,845.19	699,067.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	422,965.04	396,172.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	140,988.35	132,057.39
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		3,482.19	840.30
8. 其他费用	6.4.7.23	175,409.61	169,997.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,941,138.96	24,433,158.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		-37,941,138.96	24,433,158.87

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-37,941,138.96	24,433,158.87

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	781,294,818.50	-	-203,606,418.17	577,688,400.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	781,294,818.50	-	-203,606,418.17	577,688,400.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,034,254.96	-	-44,618,561.77	-38,584,306.81
(一)、综合收益总额	-	-	-37,941,138.96	-37,941,138.96
(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)	6,034,254.96	-	-6,677,422.81	-643,167.85
其中：1. 基金申购款	129,736,481.75	-	-41,603,752.12	88,132,729.63
2. 基金赎回款	-123,702,226.79	-	34,926,329.31	-88,775,897.48
(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	787,329,073.46	-	-248,224,979.94	539,104,093.52
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	672,678,229.14	-	-153,803,087.91	518,875,141.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	672,678,229.14	-	-153,803,087.91	518,875,141.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,102,764.89	-	26,362,051.16	8,259,286.27
(一)、综合收益总额	-	-	24,433,158.87	24,433,158.87
(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)	-18,102,764.89	-	1,928,892.29	-16,173,872.60
其中：1. 基金申购款	45,256,912.24	-	-8,467,898.78	36,789,013.46
2. 基金赎回款	-63,359,677.13	-	10,396,791.07	-52,962,886.06
(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	654,575,464.25	-	-127,441,036.75	527,134,427.50
-----------	----------------	---	-----------------	----------------

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 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]508 号《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 873,771,921.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,140.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意,本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债

券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2024 年 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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。

(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	16,704,679.31
等于：本金	16,703,048.71
加：应计利息	1,630.60
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	16,704,679.31

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	612,283,648.33	-	513,317,209.38	-98,966,438.95	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	81,000.00	6.04	81,006.04	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	81,000.00	6.04	81,006.04	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	612,364,648.33	6.04	513,398,215.42	-98,966,438.95

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	24,178,720.00	-	-	
其中：股指期货投资	24,178,720.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	24,178,720.00	-	-	

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
IC2409	中证 500 股指期货 2409	24.00	23,400,960.00	-777,760.00
合计				-777,760.00
减：可抵销期货暂收款				-777,760.00
净额				0.00

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

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	7,949.30
待摊费用	-
合计	7,949.30

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	55,162.00
其中：交易所市场	55,162.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	42,263.34
应退退补款	83,809.67
合计	270,742.61

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	388,429,801.00	781,294,818.50
本期申购	64,500,000.00	129,736,481.75
本期赎回（以“-”号填列）	-61,500,000.00	-123,702,226.79
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	391,429,801.00	787,329,073.46

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	104,757,934.87	-308,364,353.04	-203,606,418.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	104,757,934.87	-308,364,353.04	-203,606,418.17
本期利润	-17,251,896.28	-20,689,242.68	-37,941,138.96
本期基金份额交易产生的变动数	919,318.96	-7,596,741.77	-6,677,422.81
其中：基金申购款	16,332,054.09	-57,935,806.21	-41,603,752.12
基金赎回款	-15,412,735.13	50,339,064.44	34,926,329.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,425,357.55	-336,650,337.49	-248,224,979.94

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	27,899.59
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	57,478.26
其他	403.27
合计	85,781.12

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	-19,507,178.48
股票投资收益——赎回差价收入	-4,092,425.28
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	-23,599,603.76

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	112,462,369.72
减：卖出股票成本总额	131,789,057.50
减：交易费用	180,490.70
买卖股票差价收入	-19,507,178.48

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	88,775,897.48
减：现金支付赎回款总额	48,654,373.48
减：赎回股票成本总额	44,213,949.28
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,092,425.28

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	19.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,304.85
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	26,324.74

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	137,725.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	111,400.00
减：应计利息总额	15.38
减：交易费用	5.51
买卖债券差价收入	26,304.85

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	-371,842.83

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	7,019,801.11
其中：证券出借权益补偿收入	211,215.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,019,801.11

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	-20,148,602.68
股票投资	-20,148,602.68

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	-540,640.00
权证投资	-
期货投资	-540,640.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-20,689,242.68

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	-4,678.44
合计	-4,678.44

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	-
指数使用费	84,593.02
银行划款手续费	1,146.17
存托服务费	162.82
合计	175,409.61

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“中证 500 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	88,429,065.63	39.59	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	39,790.66	28.89	-	-

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	75,937.09	69.09	28,118.12	50.97
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（截止 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	422,965.04	396,172.40
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	422,965.04	396,172.40

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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	140,988.35	132,057.39

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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

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

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	30,697,149.00	3.10~3.40	3.20	42,946.42	83,888.00	81.52
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	期末应收利息余额

					业务 余额	
华泰证券	2,151,475.00	1.80~1.80	1.80	1,374.86	67,580.00	10.14

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固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 (%)
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	172,329,489.00	44.0256	159,845,989.00	41.1518
华泰证券股份有限公司	400,071.00	0.1022	488,171.00	0.1257

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
中国银行	16,704,679.31	27,899.59	12,252,272.58	18,895.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

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	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	9,786	153,542.34
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
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	59,337	337,627.53
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	20,311	225,452.10
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	113066	平煤转债	网上配售	1,290	129,000.00

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

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	2024 年 1	6 个月	新股锁定	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-

	电气	月 4 日		期内							
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	2024 年 3 月	6 个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	

	科技	月 6 日		期内							
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	126.89	188.01	1,136	80,067.59	213,579.36	-	
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	736	11,923.20	11,746.56	-	
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	-	
603375	盛景	2024 年 1	6 个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-	

	微	月 17 日		期内						
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	792	17,946.72	12,584.88	-
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	979	15,360.51	18,395.41	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升 24 转债	2024 年 6 月 14 日	1-6 个月（含）	配债未上市	100.00	100.01	810	81,006.04	81,006.04	-

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等流通受限股票。

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

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	000009	中国宝安	2024 年 7 月 1 日	8.60	9,700	83,420.00
2	000031	大悦城	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	2.34	10,000	23,400.00
3	000039	中集集团	2024 年 7 月 9 日	9.26	27,600	255,576.00
4	000400	许继电气	2024 年 7 月 1 日	34.41	2,300	79,143.00
5	000559	万向钱潮	2024 年 7 月 1 日	4.46	1,100	4,906.00
6	000563	陕国投 A	2024 年 7 月 1 日	2.75	31,500	86,625.00
7	000598	兴蓉环境	2024 年 7 月 1 日	7.52	1,000	7,520.00
8	000623	吉林敖	2024 年 7 月 9 日	13.40	1,800	24,120.00

		东				
9	000709	河钢股份	2024 年 7 月 1 日	1.94	9,100	17,654.00
10	000728	国元证券	2024 年 7 月 1 日	6.06	35,800	216,948.00
11	000729	燕京啤酒	2024 年 7 月 1 日	8.83	5,800	51,214.00
12	000778	新兴铸管	2024 年 7 月 1 日	3.48	6,400	22,272.00
13	000825	太钢不锈	2024 年 7 月 1 日	3.38	29,500	99,710.00
14	000830	鲁西化工	2024 年 7 月 9 日	11.59	1,400	16,226.00
15	000878	云南铜业	2024 年 7 月 1 日	12.46	6,700	83,482.00
16	000958	电投产融	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	3.66	10,300	37,698.00
17	000988	华工科技	2024 年 7 月 9 日	29.93	1,000	29,930.00
18	000997	新大陆	2024 年 7 月 1 日	13.91	6,700	93,197.00
19	001286	陕西能源	2024 年 7 月 9 日	11.53	12,000	138,360.00
20	002078	太阳纸业	2024 年 7 月 1 日	13.95	6,000	83,700.00
21	002155	湖南黄金	2024 年 7 月 1 日	18.10	1,200	21,720.00
22	002195	岩山科技	2024 年 7 月 9 日	2.51	23,400	58,734.00
23	002262	恩华药业	2024 年 7 月 9 日	23.74	1,200	28,488.00
24	002266	浙富控股	2024 年 7 月 9 日	2.79	1,000	2,790.00
25	002268	电科网安	2024 年 7 月 1 日	14.23	1,400	19,922.00
26	002294	信立泰	2024 年 7 月 1 日	26.63	8,000	213,040.00
27	002384	东山精密	2024 年 7 月 1 日	20.70	4,000	82,800.00
28	002407	多氟多	2024 年 7 月 9 日	12.23	2,800	34,244.00
29	002423	中粮资本	2024 年 7 月 9 日	7.49	11,400	85,386.00
30	002497	雅化集团	2024 年 7 月 1 日	8.92	5,300	47,276.00
31	002500	山西证	2024 年 7 月 1 日	4.70	8,500	39,950.00

		券				
32	002506	协鑫集成	2024 年 7 月 1 日	1.94	11,000	21,340.00
33	002563	森马服饰	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	5.81	2,100	12,201.00
34	002568	百润股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	16.83	8,000	134,640.00
35	002624	完美世界	2024 年 7 月 1 日	7.60	21,000	159,600.00
36	002625	光启技术	2024 年 7 月 1 日	17.35	24,000	416,400.00
37	002670	国盛金控	2024 年 7 月 9 日	8.47	18,000	152,460.00
38	002791	坚朗五金	2024 年 7 月 9 日	25.87	1,000	25,870.00
39	002936	郑州银行	2024 年 7 月 9 日	1.73	1,700	2,941.00
40	002966	苏州银行	2024 年 7 月 1 日	7.50	2,000	15,000.00
41	003031	中瓷电子	2024 年 7 月 1 日	46.24	1,400	64,736.00
42	003035	南网能源	2024 年 7 月 9 日	4.40	3,200	14,080.00
43	300003	乐普医疗	2024 年 7 月 1 日	14.84	3,900	57,876.00
44	300118	东方日升	2024 年 7 月 1 日	12.10	1,100	13,310.00
45	300207	欣旺达	2024 年 7 月 1 日	15.17	7,000	106,190.00
46	300394	天孚通信	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	88.42	800	70,736.00
47	300699	光威复材	2024 年 7 月 1 日	24.83	4,500	111,735.00
48	300888	稳健医疗	2024 年 7 月 9 日	25.30	3,000	75,900.00
49	301236	软通动力	2024 年 7 月 9 日	35.21	1,000	35,210.00
50	600004	白云机场	2024 年 7 月 1 日	9.48	18,000	170,640.00
51	600008	首创环保	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	2.68	24,600	65,928.00
52	600021	上海电力	2024 年 7 月 9 日	9.89	11,100	109,779.00
53	600095	湘财股	2024 年 7 月 9 日	5.96	13,000	77,480.00

		份				
54	600118	中国卫星	2024 年 7 月 9 日	22.23	9,000	200,070.00
55	600155	华创云信	2024 年 7 月 1 日	5.91	15,800	93,378.00
56	600166	福田汽车	2024 年 7 月 9 日	2.25	12,000	27,000.00
57	600282	南钢股份	2024 年 7 月 1 日	4.98	21,800	108,564.00
58	600339	中油工程	2024 年 7 月 1 日	3.12	26,000	81,120.00
59	600352	浙江龙盛	2024 年 7 月 1 日	8.59	41,000	352,190.00
60	600380	健康元	2024 年 7 月 1 日	11.17	6,800	75,956.00
61	600390	五矿资本	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	4.05	9,300	37,665.00
62	600398	海澜之家	2024 年 7 月 9 日	9.24	27,000	249,480.00
63	600499	科达制造	2024 年 7 月 9 日	8.43	21,000	177,030.00
64	600511	国药股份	2024 年 7 月 9 日	30.79	1,000	30,790.00
65	600517	国网英大	2024 年 7 月 1 日	4.33	24,100	104,353.00
66	600521	华海药业	2024 年 7 月 1 日	17.05	7,100	121,055.00
67	600528	中铁工业	2024 年 7 月 1 日	7.32	17,000	124,440.00
68	600563	法拉电子	2024 年 7 月 9 日	76.18	2,000	152,360.00
69	600580	卧龙电驱	2024 年 7 月 9 日	12.15	1,000	12,150.00
70	600582	天地科技	2024 年 7 月 1 日	6.89	2,300	15,847.00
71	600583	海油工程	2024 年 7 月 1 日	5.91	10,600	62,646.00
72	600642	申能股份	2024 年 7 月 1 日	8.83	17,900	158,057.00
73	600704	物产中大	2024 年 7 月 1 日	4.34	49,000	212,660.00
74	600755	厦门国贸	2024 年 7 月 9 日	7.17	1,100	7,887.00
75	600764	中国海防	2024 年 7 月 9 日	19.63	2,200	43,186.00

76	600801	华新水泥	2024 年 7 月 1 日	13.75	8,800	121,000.00
77	600848	上海临港	2024 年 7 月 9 日	9.11	1,500	13,665.00
78	600859	王府井	2024 年 7 月 9 日	11.74	2,900	34,046.00
79	600863	内蒙华电	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	4.64	2,500	11,600.00
80	600901	江苏金租	2024 年 7 月 8 日-2024 年 7 月 9 日	5.05	2,400	12,120.00
81	600928	西安银行	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	3.27	19,900	65,073.00
82	600977	中国电影	2024 年 7 月 9 日	10.76	1,000	10,760.00
83	601000	唐山港	2024 年 7 月 1 日	4.70	47,000	220,900.00
84	601016	节能风电	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	2.99	34,300	102,557.00
85	601058	赛轮轮胎	2024 年 7 月 9 日	14.00	16,000	224,000.00
86	601106	中国一重	2024 年 7 月 1 日	2.31	43,000	99,330.00
87	601128	常熟银行	2024 年 7 月 1 日	7.57	3,740	28,311.80
88	601156	东航物流	2024 年 7 月 9 日	20.35	1,200	24,420.00
89	601162	天风证券	2024 年 7 月 1 日	2.18	63,100	137,558.00
90	601179	中国西电	2024 年 7 月 1 日	8.04	21,400	172,056.00
91	601456	国联证券	2024 年 7 月 10 日	9.64	1,000	9,640.00
92	601598	中国外运	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	5.63	3,900	21,957.00
93	601636	旗滨集团	2024 年 7 月 1 日	6.45	9,900	63,855.00
94	601665	齐鲁银行	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	4.91	2,900	14,239.00
95	601666	平煤股份	2024 年 7 月 9 日	11.20	1,100	12,320.00
96	601880	辽港股份	2024 年 7 月 9 日	1.23	3,400	4,182.00
97	601997	贵阳银行	2024 年 7 月 1 日	5.27	38,100	200,787.00
98	603077	和邦生	2024 年 7 月 1 日-2024 年	1.65	28,400	46,860.00

		物	7月9日			
99	603225	新风鸣	2024年7月9日	15.59	1,000	15,590.00
100	603233	大参林	2024年7月1日	14.30	3,500	50,050.00
101	603305	旭升集团	2024年7月9日	10.56	2,000	21,120.00
102	603589	口子窖	2024年7月1日	39.19	2,200	86,218.00
103	603707	健友股份	2024年7月1日	11.88	7,000	83,160.00
104	603858	步长制药	2024年7月1日	15.15	8,000	121,200.00
105	603885	吉祥航空	2024年7月1日	10.99	5,200	57,148.00
106	603939	益丰药房	2024年7月9日	24.55	2,400	58,920.00
107	688063	派能科技	2024年7月9日	39.71	1,400	55,594.00
108	688248	南网科技	2024年7月9日	29.63	1,000	29,630.00
109	688425	铁建重工	2024年7月1日	3.68	24,000	88,320.00
110	688538	和辉光电-U	2024年7月9日	1.98	55,000	108,900.00
111	688778	厦钨新能	2024年7月9日	31.24	1,000	31,240.00
112	688779	长远锂科	2024年7月9日	4.63	1,000	4,630.00
合计	-	-	-	-	1,262,440	8,914,343.80

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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 0.02% (2023 年 12 月 31 日：0.01%)。

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	16,704,679.31	-	-	-	-	-	16,704,679.31
结算备付金	6,504,106.25	-	-	-	-	-	6,504,106.25
存出保证金	2,847,272.93	-	-	-	-	-	2,847,272.93
交易性金融资产	-	-	81,006.04	-	-	-513,317,209.38	513,398,215.42
应收股利	-	-	-	-	-	27,807.92	27,807.92
应收清算款	-	-	-	-	-	44,014.94	44,014.94
其他资产	-	-	-	-	-	7,949.30	7,949.30
资产总计	26,056,058.49	-	81,006.04	-	-	-513,396,981.54	539,534,046.07
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,627.88	67,627.88
应付托管费	-	-	-	-	-	22,542.65	22,542.65
应付清算款	-	-	-	-	-	69,039.22	69,039.22
应交税费	-	-	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	-	-	270,742.61	270,742.61
负债总计	-	-	-	-	-	429,952.55	429,952.55
利率敏感度缺口	26,056,058.49	-	81,006.04	-	-	-512,967,028.99	539,104,093.52
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	9,693,346.18	-	-	-	-	-	9,693,346.18
结算备付金	8,013,161.97	-	-	-	-	-	8,013,161.97
存出保证金	49,464.28	-	-	-	-	2,079,206.40	2,128,670.68
交易性金融资产	-	-	-	-36,401.12	557,931,190.89	557,967,592.01	
应收清算款	-	-	-	-	-	282,371.24	282,371.24
其他资产	-	-	-	-	-	18,392.79	18,392.79
资产总计	17,755,972.43	-	-	-36,401.12	560,311,161.32	578,103,534.87	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,137.29	72,137.29
应付托管费	-	-	-	-	-	24,045.77	24,045.77
其他负债	-	-	-	-	-	318,951.48	318,951.48
负债总计	-	-	-	-	-	415,134.54	415,134.54
利率敏感度缺口	17,755,972.43	-	-	-36,401.12	559,896,026.78	577,688,400.33	

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02% (2023 年 12 月 31 日：0.01%)，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	513,317,209.38	95.22	557,931,190.89	96.58
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	-	-	-	-
合计	513,317,209.38	95.22	557,931,190.89	96.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	中证 500 指数上升 5%	26,687,461.65	28,499,170.23
	中证 500 指数下降 5%	-26,687,461.65	-28,499,170.23

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	512,803,702.40	556,889,592.37
第二层次	126,617.15	36,401.12
第三层次	467,895.87	1,041,598.52
合计	513,398,215.42	557,967,592.01

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	513,317,209.38	95.14
	其中：股票	513,317,209.38	95.14

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,006.04	0.02
	其中：债券	81,006.04	0.02
	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	23,208,785.56	4.30
8	其他各项资产	2,927,045.09	0.54
9	合计	539,534,046.07	100.00

注：1. 上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

2. 报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 8,914,343.80 元，占本基金期末资产净值的 1.65%。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 83,888.00 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	3,214,435.43	0.60
B	采矿业	23,962,589.95	4.44
C	制造业	324,324,716.20	60.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,655,718.58	3.83
E	建筑业	5,224,348.60	0.97
F	批发和零售业	10,882,330.87	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	10,318,836.93	1.91
H	住宿和餐饮业	1,627,199.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,401,657.26	6.75
J	金融业	47,659,238.93	8.84
K	房地产业	5,801,113.22	1.08
L	租赁和商务服务业	3,915,755.43	0.73
M	科学研究和技术服务业	4,103,654.49	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	2,329,613.25	0.43
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	570,537.00	0.11
Q	卫生和社会工作	3,190,950.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	7,705,314.46	1.43
S	综合	915,692.80	0.17
	合计	512,803,702.40	95.12

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	454,779.40	0.08
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	0.01
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	11,746.56	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	513,506.98	0.10

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	300502	新易盛	61,600	6,501,880.00	1.21
2	002028	思源电气	53,416	3,573,530.40	0.66
3	601058	赛轮轮胎	228,100	3,193,400.00	0.59
4	688169	石头科技	7,733	3,035,975.80	0.56
5	600066	宇通客车	115,000	2,967,000.00	0.55
6	002340	格林美	445,824	2,839,898.88	0.53
7	000933	神火股份	136,500	2,761,395.00	0.51
8	601077	渝农商行	537,500	2,698,250.00	0.50
9	000988	华工科技	87,255	2,611,542.15	0.48
10	601168	西部矿业	144,203	2,588,443.85	0.48
11	300394	天孚通信	28,800	2,546,496.00	0.47
12	000423	东阿阿胶	39,200	2,453,920.00	0.46
13	002384	东山精密	118,300	2,448,810.00	0.45
14	000630	铜陵有色	666,400	2,405,704.00	0.45
15	600418	江淮汽车	151,700	2,402,928.00	0.45
16	600988	赤峰黄金	143,900	2,351,326.00	0.44
17	601233	桐昆股份	145,900	2,328,564.00	0.43
18	600157	永泰能源	1,928,600	2,275,748.00	0.42
19	002625	光启技术	130,800	2,269,380.00	0.42
20	600096	云天化	111,300	2,161,446.00	0.40
21	601567	三星医疗	61,200	2,142,000.00	0.40
22	000400	许继电气	61,840	2,127,914.40	0.39
23	688777	中控技术	54,885	2,069,164.50	0.38
24	002156	通富微电	91,700	2,053,163.00	0.38
25	002128	电投能源	97,129	2,049,421.90	0.38
26	002273	水晶光电	120,178	2,040,622.44	0.38
27	601555	东吴证券	343,430	2,026,237.00	0.38
28	002078	太阳纸业	144,974	2,022,387.30	0.38
29	600885	宏发股份	72,084	1,995,285.12	0.37
30	601128	常熟银行	261,730	1,981,296.10	0.37
31	002532	天山铝业	241,200	1,956,132.00	0.36
32	002223	鱼跃医疗	51,955	1,953,508.00	0.36
33	300207	欣旺达	128,600	1,950,862.00	0.36
34	600352	浙江龙盛	224,800	1,931,032.00	0.36
35	600398	海澜之家	208,500	1,926,540.00	0.36
36	002138	顺络电子	69,800	1,916,708.00	0.36
37	002966	苏州银行	253,200	1,899,000.00	0.35
38	002353	杰瑞股份	53,342	1,871,237.36	0.35
39	601108	财通证券	280,600	1,854,766.00	0.34

40	600765	中航重机	89,786	1,831,634.40	0.34
41	002185	华天科技	221,500	1,805,225.00	0.33
42	002517	恺英网络	187,000	1,785,850.00	0.33
43	600879	航天电子	228,654	1,776,641.58	0.33
44	603606	东方电缆	35,800	1,747,398.00	0.32
45	301236	软通动力	49,400	1,739,374.00	0.32
46	688617	惠泰医疗	3,800	1,733,180.00	0.32
47	600873	梅花生物	172,500	1,728,450.00	0.32
48	688099	晶晨股份	28,989	1,719,627.48	0.32
49	600177	雅戈尔	240,100	1,709,512.00	0.32
50	601577	长沙银行	208,200	1,703,076.00	0.32
51	002738	中矿资源	63,400	1,699,120.00	0.32
52	600079	人福医药	98,700	1,694,679.00	0.31
53	600109	国金证券	224,400	1,694,220.00	0.31
54	300003	乐普医疗	114,000	1,691,760.00	0.31
55	600060	海信视像	67,782	1,676,926.68	0.31
56	300017	网宿科技	210,500	1,662,950.00	0.31
57	300136	信维通信	84,000	1,644,720.00	0.31
58	600497	驰宏锌锗	307,546	1,642,295.64	0.30
59	603160	汇顶科技	23,800	1,636,250.00	0.30
60	603979	金诚信	32,000	1,616,960.00	0.30
61	002202	金风科技	239,400	1,608,768.00	0.30
62	689009	九号公司	43,294	1,593,652.14	0.30
63	002739	万达电影	131,600	1,591,044.00	0.30
64	000932	华菱钢铁	357,760	1,584,876.80	0.29
65	600985	淮北矿业	93,200	1,560,168.00	0.29
66	000683	远兴能源	225,500	1,558,205.00	0.29
67	002465	海格通信	150,077	1,554,797.72	0.29
68	002409	雅克科技	24,700	1,553,877.00	0.29
69	600536	中国软件	51,913	1,553,236.96	0.29
70	600348	华阳股份	155,631	1,550,084.76	0.29
71	002444	巨星科技	62,633	1,547,035.10	0.29
72	002281	光迅科技	41,245	1,541,325.65	0.29
73	000009	中国宝安	178,183	1,532,373.80	0.28
74	688120	华海清科	8,032	1,522,706.56	0.28
75	688122	西部超导	39,698	1,521,227.36	0.28
76	002008	大族激光	72,700	1,512,160.00	0.28
77	002436	兴森科技	146,500	1,511,880.00	0.28
78	000878	云南铜业	121,214	1,510,326.44	0.28
79	300474	景嘉微	23,800	1,504,874.00	0.28
80	600642	申能股份	169,263	1,494,592.29	0.28
81	601615	明阳智能	157,300	1,484,912.00	0.28
82	002797	第一创业	290,600	1,479,154.00	0.27

83	300054	鼎龙股份	65,200	1,478,736.00	0.27
84	000039	中集集团	158,876	1,471,191.76	0.27
85	601990	南京证券	191,200	1,468,416.00	0.27
86	600298	安琪酵母	52,500	1,466,325.00	0.27
87	000066	中国长城	167,400	1,464,750.00	0.27
88	300012	华测检测	145,500	1,463,730.00	0.27
89	600529	山东药玻	57,600	1,459,584.00	0.27
90	601666	平煤股份	128,200	1,435,840.00	0.27
91	688525	佰维存储	22,360	1,434,394.00	0.27
92	600839	四川长虹	319,080	1,432,669.20	0.27
93	002673	西部证券	231,400	1,432,366.00	0.27
94	603596	伯特利	36,800	1,431,520.00	0.27
95	601179	中国西电	177,051	1,423,490.04	0.26
96	000831	中国稀土	54,900	1,391,715.00	0.26
97	000783	长江证券	286,900	1,385,727.00	0.26
98	300395	菲利华	45,000	1,383,750.00	0.26
99	601717	郑煤机	93,402	1,382,349.60	0.26
100	603816	顾家家居	42,800	1,382,012.00	0.26
101	300002	神州泰岳	170,000	1,380,400.00	0.26
102	000728	国元证券	226,100	1,370,166.00	0.25
103	002432	九安医疗	33,700	1,366,198.00	0.25
104	000738	航发控制	68,000	1,364,760.00	0.25
105	600862	中航高科	72,289	1,357,587.42	0.25
106	688180	君实生物	46,661	1,355,502.05	0.25
107	000703	恒逸石化	190,200	1,348,518.00	0.25
108	601198	东兴证券	167,700	1,334,892.00	0.25
109	601997	贵阳银行	252,500	1,330,675.00	0.25
110	603345	安井食品	17,900	1,330,149.00	0.25
111	603338	浙江鼎力	22,000	1,329,240.00	0.25
112	002595	豪迈科技	34,700	1,324,499.00	0.25
113	000960	锡业股份	85,000	1,316,650.00	0.24
114	002155	湖南黄金	72,672	1,315,363.20	0.24
115	300866	安克创新	18,440	1,313,112.40	0.24
116	601696	中银证券	144,100	1,308,428.00	0.24
117	688188	柏楚电子	7,084	1,307,352.20	0.24
118	600863	内蒙华电	281,700	1,307,088.00	0.24
119	300037	新宙邦	45,740	1,306,334.40	0.24
120	601162	天风证券	598,700	1,305,166.00	0.24
121	000921	海信家电	40,400	1,302,496.00	0.24
122	300724	捷佳伟创	24,100	1,301,641.00	0.24
123	600521	华海药业	76,000	1,295,800.00	0.24
124	600038	中直股份	31,500	1,294,965.00	0.24
125	300001	特锐德	64,150	1,290,698.00	0.24

126	603939	益丰药房	52,332	1,284,750.60	0.24
127	002984	森麒麟	53,300	1,283,997.00	0.24
128	002294	信立泰	48,200	1,283,566.00	0.24
129	002472	双环传动	58,200	1,281,564.00	0.24
130	600141	兴发集团	66,911	1,276,661.88	0.24
131	600549	厦门钨业	73,519	1,268,202.75	0.24
132	002407	多氟多	103,360	1,264,092.80	0.23
133	600699	均胜电子	84,940	1,258,810.80	0.23
134	002850	科达利	16,383	1,251,333.54	0.23
135	300699	光威复材	50,300	1,248,949.00	0.23
136	600546	山煤国际	85,300	1,247,086.00	0.23
137	301358	湖南裕能	39,600	1,245,816.00	0.23
138	600820	隧道股份	190,300	1,242,659.00	0.23
139	600895	张江高科	67,076	1,239,564.48	0.23
140	002262	恩华药业	52,200	1,239,228.00	0.23
141	600872	中炬高新	54,400	1,234,336.00	0.23
142	600369	西南证券	344,500	1,233,310.00	0.23
143	002195	岩山科技	490,900	1,232,159.00	0.23
144	300285	国瓷材料	69,000	1,231,650.00	0.23
145	002064	华峰化学	171,500	1,229,655.00	0.23
146	000021	深科技	80,665	1,219,654.80	0.23
147	603589	口子窖	31,000	1,214,890.00	0.23
148	300073	当升科技	35,200	1,207,712.00	0.22
149	603087	甘李药业	26,000	1,204,320.00	0.22
150	600021	上海电力	121,745	1,204,058.05	0.22
151	601000	唐山港	255,743	1,201,992.10	0.22
152	300146	汤臣倍健	88,400	1,197,820.00	0.22
153	600486	扬农化工	21,170	1,195,046.50	0.22
154	000513	丽珠集团	31,706	1,179,780.26	0.22
155	601966	玲珑轮胎	63,900	1,173,843.00	0.22
156	002756	永兴材料	32,800	1,173,584.00	0.22
157	300058	蓝色光标	215,052	1,169,882.88	0.22
158	600704	物产中大	269,200	1,168,328.00	0.22
159	600153	建发股份	129,600	1,157,328.00	0.21
160	600155	华创云信	195,374	1,154,660.34	0.21
161	300114	中航电测	25,500	1,153,875.00	0.21
162	603179	新泉股份	29,400	1,153,656.00	0.21
163	000830	鲁西化工	99,333	1,151,269.47	0.21
164	300529	健帆生物	42,100	1,145,541.00	0.21
165	688065	凯赛生物	25,220	1,144,735.80	0.21
166	600118	中国卫星	51,000	1,133,730.00	0.21
167	600583	海油工程	191,100	1,129,401.00	0.21
168	002558	巨人网络	119,400	1,127,136.00	0.21

169	601156	东航物流	55,200	1,123,320.00	0.21
170	002152	广电运通	107,069	1,119,941.74	0.21
171	000591	太阳能	236,600	1,114,386.00	0.21
172	000623	吉林敖东	82,400	1,104,160.00	0.20
173	600970	中材国际	91,460	1,103,007.60	0.20
174	002025	航天电器	23,700	1,099,206.00	0.20
175	002439	启明星辰	63,400	1,094,284.00	0.20
176	002385	大北农	283,900	1,093,015.00	0.20
177	300373	扬杰科技	28,090	1,092,701.00	0.20
178	300144	宋城演艺	135,500	1,088,065.00	0.20
179	601216	君正集团	291,700	1,076,373.00	0.20
180	600380	健康元	96,352	1,076,251.84	0.20
181	605358	立昂微	46,492	1,075,824.88	0.20
182	000729	燕京啤酒	121,810	1,075,582.30	0.20
183	600143	金发科技	161,500	1,067,515.00	0.20
184	000723	美锦能源	224,200	1,067,192.00	0.20
185	300251	光线传媒	126,600	1,064,706.00	0.20
186	600998	九州通	217,879	1,063,249.52	0.20
187	600282	南钢股份	213,254	1,062,004.92	0.20
188	600637	东方明珠	174,200	1,059,136.00	0.20
189	000519	中兵红箭	72,186	1,058,968.62	0.20
190	300677	英科医疗	39,460	1,057,922.60	0.20
191	600763	通策医疗	19,500	1,053,975.00	0.20
192	300383	光环新网	124,200	1,049,490.00	0.19
193	600516	方大炭素	243,500	1,049,485.00	0.19
194	600392	盛和资源	121,200	1,044,744.00	0.19
195	000636	风华高科	79,774	1,041,848.44	0.19
196	300024	机器人	106,900	1,041,206.00	0.19
197	000818	航锦科技	47,100	1,039,968.00	0.19
198	600909	华安证券	243,590	1,025,513.90	0.19
199	002958	青农商行	382,500	1,025,100.00	0.19
200	601665	齐鲁银行	208,600	1,024,226.00	0.19
201	002044	美年健康	270,500	1,022,490.00	0.19
202	600008	首创环保	380,200	1,018,936.00	0.19
203	000883	湖北能源	169,100	1,016,291.00	0.19
204	688213	思特威	20,785	1,008,072.50	0.19
205	600566	济川药业	31,700	1,005,207.00	0.19
206	600867	通化东宝	119,900	1,003,563.00	0.19
207	000629	钒钛股份	401,300	1,003,250.00	0.19
208	601016	节能风电	335,400	1,002,846.00	0.19
209	300088	长信科技	212,335	997,974.50	0.19
210	600511	国药股份	32,395	997,442.05	0.19
211	601456	国联证券	103,100	993,884.00	0.18

212	000997	新大陆	71,400	993,174.00	0.18
213	600170	上海建工	460,800	990,720.00	0.18
214	600582	天地科技	143,200	986,648.00	0.18
215	600499	科达制造	116,200	979,566.00	0.18
216	600498	烽火通信	61,200	973,080.00	0.18
217	600535	天士力	77,300	972,434.00	0.18
218	688301	奕瑞科技	8,411	969,199.53	0.18
219	002120	韵达股份	125,200	969,048.00	0.18
220	600129	太极集团	33,500	968,820.00	0.18
221	000598	兴蓉环境	128,772	968,365.44	0.18
222	600004	白云机场	102,100	967,908.00	0.18
223	601933	永辉超市	390,200	967,696.00	0.18
224	601991	大唐发电	321,300	967,113.00	0.18
225	000750	国海证券	330,742	962,459.22	0.18
226	600580	卧龙电驱	79,125	961,368.75	0.18
227	300567	精测电子	17,000	960,670.00	0.18
228	002261	拓维信息	86,700	959,769.00	0.18
229	000060	中金岭南	225,900	957,816.00	0.18
230	603000	人民网	47,770	954,922.30	0.18
231	300568	星源材质	116,300	953,660.00	0.18
232	300118	东方日升	78,700	952,270.00	0.18
233	002430	杭氧股份	42,700	950,075.00	0.18
234	603486	科沃斯	20,100	948,318.00	0.18
235	002429	兆驰股份	195,600	940,836.00	0.17
236	603658	安图生物	20,400	939,828.00	0.17
237	002939	长城证券	139,600	935,320.00	0.17
238	603156	养元饮品	43,900	933,753.00	0.17
239	600166	福田汽车	414,902	933,529.50	0.17
240	600325	华发股份	142,800	928,200.00	0.17
241	600816	建元信托	341,300	924,923.00	0.17
242	603228	景旺电子	29,040	923,472.00	0.17
243	300765	新诺威	36,400	918,372.00	0.17
244	300487	蓝晓科技	21,950	916,632.00	0.17
245	601231	环旭电子	57,100	916,455.00	0.17
246	600673	东阳光	130,070	915,692.80	0.17
247	600754	锦江酒店	39,800	914,604.00	0.17
248	603568	伟明环保	44,347	912,661.26	0.17
249	002508	老板电器	41,200	910,520.00	0.17
250	603927	中科软	50,068	905,730.12	0.17
251	000893	亚钾国际	56,000	904,960.00	0.17
252	300601	康泰生物	57,700	900,697.00	0.17
253	000027	深圳能源	123,276	899,914.80	0.17
254	601636	旗滨集团	139,300	898,485.00	0.17

255	000998	隆平高科	91,200	896,496.00	0.17
256	002926	华西证券	135,800	894,922.00	0.17
257	603298	杭叉集团	45,500	893,620.00	0.17
258	002624	完美世界	117,500	893,000.00	0.17
259	002497	雅化集团	99,500	887,540.00	0.16
260	600737	中粮糖业	92,493	887,007.87	0.16
261	002653	海思科	28,800	884,160.00	0.16
262	601866	中远海发	342,151	882,749.58	0.16
263	002299	圣农发展	64,642	881,716.88	0.16
264	603077	和邦生物	533,885	880,910.25	0.16
265	300253	卫宁健康	149,300	880,870.00	0.16
266	300604	长川科技	32,300	877,591.00	0.16
267	002056	横店东磁	70,343	877,177.21	0.16
268	002065	东华软件	193,900	876,428.00	0.16
269	600131	国网信通	51,900	875,553.00	0.16
270	002500	山西证券	186,097	874,655.90	0.16
271	300763	锦浪科技	20,900	870,276.00	0.16
272	603893	瑞芯微	14,700	869,799.00	0.16
273	300390	天华新能	50,620	869,651.60	0.16
274	002414	高德红外	147,600	869,364.00	0.16
275	601958	金钼股份	83,400	868,194.00	0.16
276	688002	睿创微纳	31,018	867,573.46	0.16
277	600655	豫园股份	168,400	867,260.00	0.16
278	600563	法拉电子	11,378	866,776.04	0.16
279	688772	珠海冠宇	58,168	866,703.20	0.16
280	600373	中文传媒	58,300	865,172.00	0.16
281	300009	安科生物	101,260	864,760.40	0.16
282	688052	纳芯微	8,382	861,501.96	0.16
283	688385	复旦微电	27,429	860,722.02	0.16
284	002368	太极股份	38,025	857,463.75	0.16
285	002507	涪陵榨菜	69,900	856,275.00	0.16
286	688114	华大智造	18,005	853,617.05	0.16
287	002372	伟星新材	54,920	846,866.40	0.16
288	600707	彩虹股份	124,000	844,440.00	0.16
289	601611	中国核建	104,200	842,978.00	0.16
290	603885	吉祥航空	76,475	840,460.25	0.16
291	000887	中鼎股份	68,421	837,473.04	0.16
292	603379	三美股份	21,180	828,985.20	0.15
293	002203	海亮股份	103,500	825,930.00	0.15
294	688390	固德威	14,669	823,224.28	0.15
295	600755	厦门国贸	114,515	821,072.55	0.15
296	603225	新凤鸣	52,600	820,034.00	0.15
297	002831	裕同科技	32,041	819,929.19	0.15

298	603290	斯达半导	9,500	818,045.00	0.15
299	600859	王府井	68,729	806,878.46	0.15
300	600329	达仁堂	24,700	800,033.00	0.15
301	601880	辽港股份	650,400	799,992.00	0.15
302	688521	芯原股份	29,879	799,263.25	0.15
303	600995	南网储能	82,600	797,916.00	0.15
304	002683	广东宏大	39,600	797,148.00	0.15
305	600416	湘电股份	80,000	795,200.00	0.15
306	600801	华新水泥	57,825	795,093.75	0.15
307	600884	杉杉股份	97,600	792,512.00	0.15
308	002019	亿帆医药	63,783	788,357.88	0.15
309	300070	碧水源	188,100	788,139.00	0.15
310	600390	五矿资本	194,400	787,320.00	0.15
311	300296	利亚德	174,800	786,600.00	0.15
312	600435	北方导航	90,945	783,945.90	0.15
313	002506	协鑫集成	404,000	783,760.00	0.15
314	002244	滨江集团	107,292	778,939.92	0.14
315	600483	福能股份	66,700	777,722.00	0.14
316	300803	指南针	21,300	775,533.00	0.14
317	600739	辽宁成大	92,600	775,062.00	0.14
318	601098	中南传媒	62,313	773,927.46	0.14
319	000050	深天马 A	106,000	771,680.00	0.14
320	600399	抚顺特钢	136,400	767,932.00	0.14
321	300748	金力永磁	59,100	765,936.00	0.14
322	002568	百润股份	45,500	765,765.00	0.14
323	601598	中国外运	135,900	765,117.00	0.14
324	002572	索菲亚	49,900	764,967.00	0.14
325	600598	北大荒	61,110	763,263.90	0.14
326	600901	江苏金租	150,860	761,843.00	0.14
327	300676	华大基因	21,700	759,717.00	0.14
328	000155	川能动力	70,400	758,208.00	0.14
329	002487	大金重工	32,900	752,752.00	0.14
330	600848	上海临港	82,500	751,575.00	0.14
331	001286	陕西能源	65,000	749,450.00	0.14
332	002240	盛新锂能	55,600	746,152.00	0.14
333	002080	中材科技	57,800	745,620.00	0.14
334	002557	洽洽食品	26,300	741,397.00	0.14
335	002373	千方科技	81,665	740,701.55	0.14
336	002936	郑州银行	427,425	739,445.25	0.14
337	603712	七一二	40,300	733,057.00	0.14
338	300595	欧普康视	46,600	730,688.00	0.14
339	000563	陕国投 A	265,246	729,426.50	0.14
340	002268	电科网安	51,149	727,850.27	0.14

341	601928	凤凰传媒	66,200	725,552.00	0.13
342	603858	步长制药	47,798	724,139.70	0.13
343	600968	海油发展	175,600	723,472.00	0.13
344	000778	新兴铸管	206,589	718,929.72	0.13
345	603883	老百姓	39,123	718,298.28	0.13
346	601212	白银有色	256,500	713,070.00	0.13
347	600258	首旅酒店	57,700	712,595.00	0.13
348	688538	和辉光电	358,988	710,796.24	0.13
349	300558	贝达药业	21,800	709,590.00	0.13
350	600271	航天信息	96,100	707,296.00	0.13
351	600528	中铁工业	96,000	702,720.00	0.13
352	600062	华润双鹤	35,657	698,164.06	0.13
353	688234	天岳先进	14,878	698,075.76	0.13
354	600977	中国电影	64,700	696,172.00	0.13
355	601155	新城控股	78,300	694,521.00	0.13
356	603688	石英股份	23,450	694,354.50	0.13
357	002531	天顺风能	77,500	692,850.00	0.13
358	000709	河钢股份	356,900	692,386.00	0.13
359	002408	齐翔腾达	122,794	687,646.40	0.13
360	000739	普洛药业	50,500	685,285.00	0.13
361	600378	昊华科技	23,700	684,930.00	0.13
362	688005	容百科技	29,359	683,477.52	0.13
363	600959	江苏有线	258,838	683,332.32	0.13
364	688220	翱捷科技	18,118	678,700.28	0.13
365	601118	海南橡胶	147,903	672,958.65	0.12
366	688017	绿的谐波	8,170	670,757.00	0.12
367	000825	太钢不锈	197,600	667,888.00	0.12
368	603737	三棵树	18,380	666,642.60	0.12
369	688536	思瑞浦	6,815	666,575.15	0.12
370	688331	荣昌生物	15,341	662,731.20	0.12
371	603882	金域医学	24,300	660,717.00	0.12
372	600056	中国医药	64,813	655,907.56	0.12
373	603444	吉比特	3,677	654,542.77	0.12
374	601399	国机重装	250,000	645,000.00	0.12
375	000987	越秀资本	129,870	644,155.20	0.12
376	600906	财达证券	112,400	644,052.00	0.12
377	600517	国网英大	148,200	641,706.00	0.12
378	603456	九洲药业	46,700	640,724.00	0.12
379	601019	山东出版	54,200	640,644.00	0.12
380	300212	易华录	37,820	636,510.60	0.12
381	002266	浙富控股	225,381	628,812.99	0.12
382	688200	华峰测控	6,840	627,570.00	0.12
383	600316	洪都航空	37,153	617,854.39	0.11

384	603650	彤程新材	20,876	616,885.80	0.11
385	000937	冀中能源	91,748	614,711.60	0.11
386	603529	爱玛科技	22,400	612,192.00	0.11
387	600871	石化油服	351,500	611,610.00	0.11
388	688567	孚能科技	63,560	610,176.00	0.11
389	002423	中粮资本	79,500	595,455.00	0.11
390	603728	鸣志电器	14,800	595,404.00	0.11
391	600925	苏能股份	117,800	594,890.00	0.11
392	000032	深桑达 A	39,600	593,208.00	0.11
393	688063	派能科技	14,903	591,798.13	0.11
394	600612	老凤祥	10,100	587,719.00	0.11
395	601965	中国汽研	34,700	586,083.00	0.11
396	001227	兰州银行	246,000	585,480.00	0.11
397	600098	广州发展	91,300	584,320.00	0.11
398	600208	新湖中宝	367,600	580,808.00	0.11
399	601298	青岛港	60,300	576,468.00	0.11
400	688297	中无人机	17,342	572,806.26	0.11
401	601608	中信重工	149,900	571,119.00	0.11
402	002607	中公教育	372,900	570,537.00	0.11
403	688516	奥特维	13,610	569,034.10	0.11
404	002670	国盛金控	67,076	568,133.72	0.11
405	600663	陆家嘴	64,391	567,928.62	0.11
406	603233	大参林	39,608	566,394.40	0.11
407	600578	京能电力	174,000	563,760.00	0.10
408	600022	山东钢铁	462,080	563,737.60	0.10
409	300438	鹏辉能源	30,300	555,702.00	0.10
410	688561	奇安信	23,445	553,770.90	0.10
411	300357	我武生物	27,100	547,962.00	0.10
412	601106	中国一重	237,200	547,932.00	0.10
413	600377	宁沪高速	43,000	541,800.00	0.10
414	600500	中化国际	154,825	540,339.25	0.10
415	002865	钧达股份	14,000	537,320.00	0.10
416	300776	帝尔激光	11,580	532,216.80	0.10
417	600967	内蒙一机	73,564	529,660.80	0.10
418	000785	居然之家	217,400	528,282.00	0.10
419	003031	中瓷电子	11,280	521,587.20	0.10
420	688349	三一重能	20,908	519,354.72	0.10
421	600315	上海家化	29,098	517,362.44	0.10
422	300888	稳健医疗	20,420	516,626.00	0.10
423	600350	山东高速	58,300	515,955.00	0.10
424	600827	百联股份	69,400	512,172.00	0.10
425	000958	电投产融	139,700	511,302.00	0.09
426	000559	万向钱潮	114,401	510,228.46	0.09

427	000537	中绿电	53,500	509,855.00	0.09
428	688425	铁建重工	138,367	509,190.56	0.09
429	002608	江苏国信	65,500	507,625.00	0.09
430	601568	北元集团	136,640	506,934.40	0.09
431	000156	华数传媒	79,919	501,891.32	0.09
432	603707	健友股份	42,143	500,658.84	0.09
433	002690	美亚光电	30,325	500,362.50	0.09
434	002867	周大生	38,200	498,892.00	0.09
435	601992	金隅集团	360,300	493,611.00	0.09
436	603517	绝味食品	32,000	492,800.00	0.09
437	688029	南微医学	7,911	487,001.16	0.09
438	603826	坤彩科技	16,660	482,640.20	0.09
439	688032	禾迈股份	4,185	480,354.30	0.09
440	600126	杭钢股份	116,838	480,204.18	0.09
441	300682	朗新集团	56,100	477,411.00	0.09
442	003022	联泓新科	34,400	471,624.00	0.09
443	000967	盈峰环境	109,600	463,608.00	0.09
444	688475	萤石网络	13,485	459,973.35	0.09
445	603218	日月股份	44,700	459,069.00	0.09
446	600361	创新新材	113,000	455,390.00	0.08
447	688778	厦钨新能	14,577	455,385.48	0.08
448	301267	华夏眼科	21,900	453,768.00	0.08
449	600481	双良节能	96,955	452,779.85	0.08
450	600339	中油工程	144,800	451,776.00	0.08
451	600032	浙江新能	61,500	447,720.00	0.08
452	688520	神州细胞	11,254	442,844.90	0.08
453	603786	科博达	6,900	442,635.00	0.08
454	600095	湘财股份	74,100	441,636.00	0.08
455	000898	鞍钢股份	206,400	437,568.00	0.08
456	003035	南网能源	98,200	432,080.00	0.08
457	603127	昭衍新药	32,552	431,965.04	0.08
458	688248	南网科技	14,515	430,079.45	0.08
459	688281	华秦科技	5,089	424,015.48	0.08
460	600808	马钢股份	207,535	419,220.70	0.08
461	002563	森马服饰	69,900	406,119.00	0.08
462	002153	石基信息	70,832	405,867.36	0.08
463	603185	弘元绿能	23,500	401,615.00	0.07
464	601228	广州港	130,200	397,110.00	0.07
465	000539	粤电力 A	76,800	390,144.00	0.07
466	001872	招商港口	20,200	388,850.00	0.07
467	688779	长远锂科	83,046	384,502.98	0.07
468	001203	大中矿业	39,400	378,634.00	0.07
469	600928	西安银行	115,400	377,358.00	0.07

470	000401	冀东水泥	92,033	373,653.98	0.07
471	000959	首钢股份	134,400	365,568.00	0.07
472	600764	中国海防	18,600	365,118.00	0.07
473	002518	科士达	20,400	361,080.00	0.07
474	688006	杭可科技	20,340	354,933.00	0.07
475	603056	德邦股份	26,570	348,067.00	0.06
476	603305	旭升集团	32,100	338,976.00	0.06
477	600299	安迪苏	34,500	334,650.00	0.06
478	688172	燕东微	20,540	332,337.20	0.06
479	601139	深圳燃气	49,700	331,996.00	0.06
480	300861	美畅股份	16,800	325,080.00	0.06
481	603317	天味食品	27,511	313,900.51	0.06
482	301029	怡合达	15,220	299,225.20	0.06
483	688276	百克生物	10,453	296,551.61	0.06
484	688387	信科移动	58,790	296,301.60	0.05
485	688375	国博电子	4,045	285,738.80	0.05
486	002791	坚朗五金	10,900	281,983.00	0.05
487	600927	永安期货	25,200	280,980.00	0.05
488	688819	天能股份	11,464	273,531.04	0.05
489	688153	唯捷创芯	7,051	260,887.00	0.05
490	601858	中国科传	13,600	260,032.00	0.05
491	000031	大悦城	110,930	259,576.20	0.05
492	688107	安路科技	10,137	257,682.54	0.05
493	601828	美凯龙	93,800	239,190.00	0.04
494	601158	重庆水务	49,800	239,040.00	0.04
495	002945	华林证券	23,400	233,532.00	0.04
496	688348	昱能科技	3,820	225,380.00	0.04
497	600956	新天绿能	26,600	217,322.00	0.04
498	688295	中复神鹰	8,338	169,261.40	0.03
499	301165	锐捷网络	5,500	164,120.00	0.03
500	603868	飞科电器	4,066	156,134.40	0.03

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	1,136	213,579.36	0.04
2	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
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	688709	成都华微	979	18,395.41	0.00
6	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
7	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00

8	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
9	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
10	688584	上海合晶	792	12,584.88	0.00
11	601033	永兴股份	736	11,746.56	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	688777	中控技术	2,276,926.09	0.39
2	601567	三星医疗	2,018,123.00	0.35
3	002202	金风科技	1,787,488.00	0.31
4	688617	惠泰医疗	1,681,788.60	0.29
5	002436	兴森科技	1,655,918.00	0.29
6	601615	明阳智能	1,650,424.00	0.29
7	603979	金诚信	1,613,455.00	0.28
8	301358	湖南裕能	1,599,201.00	0.28
9	300002	神州泰岳	1,551,833.00	0.27
10	000921	海信家电	1,539,392.00	0.27
11	300054	鼎龙股份	1,499,053.00	0.26

12	600872	中炬高新	1,391,597.00	0.24
13	603345	安井食品	1,386,619.00	0.24
14	002984	森麒麟	1,332,368.00	0.23
15	688525	佰维存储	1,274,535.40	0.22
16	603179	新泉股份	1,217,389.00	0.21
17	603087	甘李药业	1,187,834.00	0.21
18	000818	航锦科技	1,161,990.00	0.20
19	688065	凯赛生物	1,154,671.64	0.20
20	300765	新诺威	1,099,360.00	0.19

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	002463	沪电股份	4,811,547.90	0.83
2	002422	科伦药业	4,038,519.00	0.70
3	000975	山金国际	3,319,069.80	0.57
4	300418	昆仑万维	3,008,624.80	0.52
5	600160	巨化股份	2,605,264.56	0.45
6	600161	天坛生物	2,229,481.00	0.39
7	600415	小商品城	1,962,513.00	0.34
8	600482	中国动力	1,739,109.00	0.30
9	688072	拓荆科技	1,715,374.57	0.30
10	002600	领益智造	1,458,921.06	0.25
11	300394	天孚通信	1,285,816.00	0.22
12	002131	利欧股份	1,021,314.92	0.18
13	002092	ST 中泰	1,005,467.68	0.17
14	002032	苏泊尔	983,783.00	0.17
15	688728	格科微	914,505.14	0.16
16	000581	威孚高科	908,701.22	0.16
17	002966	苏州银行	891,431.00	0.15
18	000547	航天发展	827,553.25	0.14
19	300026	红日药业	804,206.89	0.14
20	000970	中科三环	777,763.62	0.13

注：不考虑相关交易费用。2024 年 7 月 25 日起，证券代码为 000975 的证券简称由“银泰黄金”变更为“山金国际”。

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	112,804,549.95
卖出股票收入（成交）总额	112,462,369.72

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

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	81,006.04	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,006.04	0.02

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

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113685	升 24 转债	810	81,006.04	0.02

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

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

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	2,847,272.93
2	应收清算款	44,014.94
3	应收股利	27,807.92
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	7,949.30
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,927,045.09

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

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	601058	赛轮轮胎	224,000.00	0.04	转融通证券出借
2	000988	华工科技	29,930.00	0.01	转融通证券出借

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	213,579.36	0.04	新股锁定期内
2	688692	达梦数据	30,612.75	0.01	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	688709	成都华微	18,395.41	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		华泰柏瑞中证 500 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 (%)
9,223	42,440.62	12,654,547.00	3.23	206,445,765.00	52.74	172,329,489.00	44.03

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	赵熙逸	33,875,378.00	8.65
2	中国银河证券股份有限公司	3,000,000.00	0.77
3	王莹	2,000,000.00	0.51
4	王春燕	1,835,000.00	0.47
5	东方证券股份有限公司	1,644,200.00	0.42
6	叶敏强	1,539,200.00	0.39
7	朱明雪	1,478,500.00	0.38
8	中信证券股份有限公司	1,408,697.00	0.36
9	广发证券股份有限公司	1,397,760.00	0.36
10	李焱	1,311,800.00	0.34
11	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	172,329,489.00	44.03

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	0.0026

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、基金投资和研究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（2015年5月13日） 基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	388,429,801.00
本报告期基金总申购份额	64,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	61,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	391,429,801.00

§ 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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
华泰证券	4	88,429,065.63	39.59	75,937.09	69.09	-
银河证券	5	63,036,792.48	28.22	12,606.80	11.47	-
方正证券	2	62,515,478.12	27.99	12,504.44	11.38	-
国泰君安	1	7,462,051.10	3.34	7,059.65	6.42	-
广发证券	4	1,912,283.76	0.86	1,809.38	1.65	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中银国际	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(%)
华泰证券	39,790.66	28.89	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	80,513.23	58.46	-	-	-	-
广发证券	17,421.85	12.65	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-

西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

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	关于同意东方证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 26 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
4	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
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 03 月 28 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 24 日
7	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	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 21 日

	业务公告		
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	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
10	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
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	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 (%)
联接基金	1	20240101-20240630;	159,845,989.00	18,583,500.00	6,100,000.00	172,329,489.00	44.03

产品特有风险

本基金报告期内有本基金联接基金持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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