# 华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
# 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 2**

1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3

**§2 基金简介 ..... 5**

2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 ..... 7
2.5 信息披露方式 ..... 7
2.6 其他相关资料 ..... 7

**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 ..... 7**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 7
3.2 基金净值表现 ..... 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 ..... 9

**§4 管理人报告 ..... 10**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 ..... 13
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 ..... 14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 14
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 ..... 15
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 16
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 16

**§5 托管人报告 ..... 16**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 16

**§6 审计报告 ..... 16**

6.1 审计报告基本信息 ..... 16
6.2 审计报告的基本内容 ..... 17

**§7 年度财务报表 ..... 18**

7.1 资产负债表 ..... 18
7.2 利润表 ..... 20
7.3 净资产变动表 ..... 21
7.4 报表附注 ..... 23

**§8 投资组合报告 ..... 55**

8.1 期末基金资产组合情况 ..... 55
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 ..... 55
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 ..... 56
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 ..... 57
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 ..... 66
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 ..... 69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 ..... 70
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ..... 70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 ..... 70
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 ..... 70
8.11 投资组合报告附注 ..... 70

**§9 基金份额持有人信息 ..... 71**

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 71
9.2 期末上市基金前十名持有人 ..... 71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 72
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 72

**§10 开放式基金份额变动 ..... 72**

**§11 重大事件揭示 ..... 72**

11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... 72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 73
11.4 基金投资策略的改变 ..... 73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 73
11.8 其他重大事件 ..... 76

**§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 78**

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... 78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 80

**§13 备查文件目录 ..... 80**

13.1 备查文件目录 ..... 80
13.2 存放地点 ..... 80
13.3 查阅方式 ..... 80

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII） |
| 基金简称 | 中韩芯片 |
| 场内简称 | 中韩芯片（扩位证券简称：中韩半导体 ETF） |
| 基金主代码 | 513310 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 11 月 2 日 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 461,427,000.00 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 | 2022 年 12 月 22 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 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。 |
| 投资策略 | 1、股票（含存托凭证）投资策略<br>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）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（含存托凭证）及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。<br>一般情形下，本基金将根据标的指数成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建投资组合，但由于交易成本、交易制度、个别成份股（含存托凭证）停牌、流动性不足或者投资受限等原因导致基金无法完成按照指数成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建投资组合时，基金管理人将对投资组合进行优化，采取包括成份股（含存托凭证）替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股（含存托凭证）进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。<br>在正常情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。<br>本基金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。<br>2、债券的投资策略<br>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。<br>3、衍生品投资策略<br>为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。<br>4、资产支持证券的投资策略<br>资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。<br>5、融资及转融通证券出借业务<br>本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。 |
| 业绩比较基准 | 业绩比较基准为中证韩交所中韩半导体指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。<br>本基金投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。 |

## 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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘万方 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 021-38601777 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-0001 | 021-60637228 |
| 传真 | | 021-38601799 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 200135 | 100033 |

| | | |
|---|---|---|
| 法定代表人 | 贾波 | 张金良 |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 英文 | - | JPMorgan Chase Bank, National Association |
| | 中文 | - | 摩根大通银行 |
| 注册地址 | | - | 1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A. |
| 办公地址 | | - | 383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A. |
| 邮政编码 | | - | - |

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

## 2.5 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.huatai-pb.com |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所 |

## 2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2024 年 | 2023 年 | 2022 年 11 月 2 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 50,111,012.69 | 5,361,277.26 | -2,166,001.00 |
| 本期利润 | 57,618,521.31 | 26,113,398.63 | -9,208,162.13 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1460 | 0.2816 | -0.0273 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.11% | 24.51% | -2.74% |
| 本期基金份 | 15.87% | 27.70% | -3.26% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 额净值增长率 | | | |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 期末可供分配利润 | 82,839,552.66 | 11,880,428.84 | -7,535,330.56 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1795 | 0.0755 | -0.0326 |
| 期末基金资产净值 | 660,493,175.97 | 194,481,943.45 | 223,891,669.44 |
| 期末基金份额净值 | 1.4314 | 1.2354 | 0.9674 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 43.14% | 23.54% | -3.26% |

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。

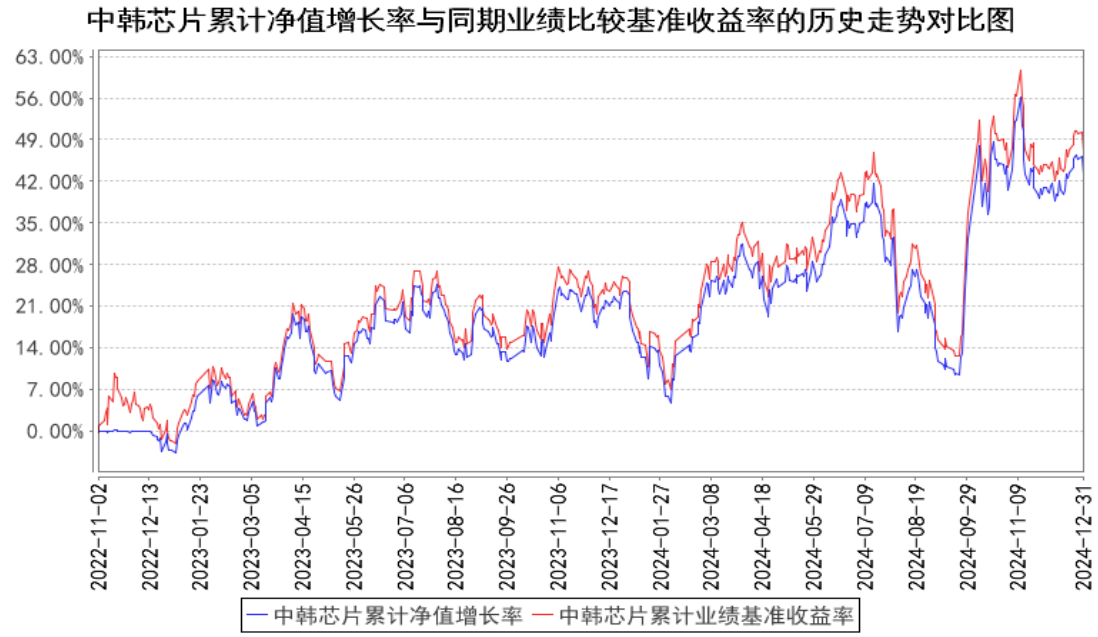
4、本基金合同于 2022 年 11 月 2 日生效。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

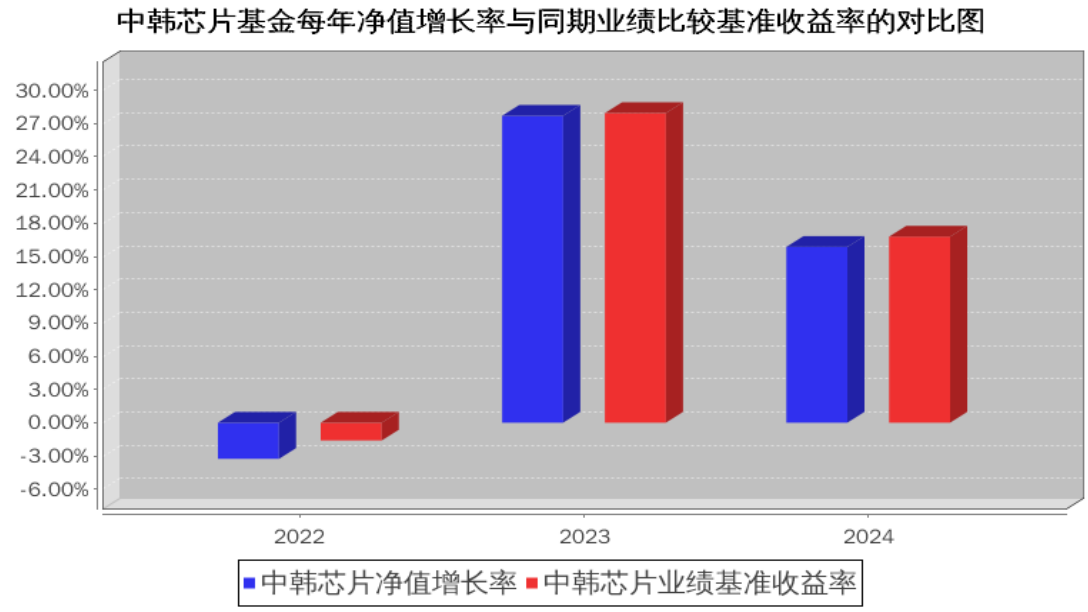
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 8.06% | 2.12% | 7.67% | 2.11% | 0.39% | 0.01% |
| 过去六个月 | 6.19% | 2.12% | 5.21% | 2.15% | 0.98% | -0.03% |
| 过去一年 | 15.87% | 1.82% | 16.80% | 1.88% | -0.93% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 43.14% | 1.51% | 47.04% | 1.62% | -3.90% | -0.11% |

### 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




注：图示日期为 2022 年 11 月 2 日至 2024 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较




注：基金合同生效日为 2022 年 11 月 2 日，2022 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施过利润分配。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2024 年 12 月 31 日，公司旗下管理 165 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 | | |
| 尤家妤 | 本基金的基金经理助理 | 2024 年 11 月 25 日 | - | 4 年 | 香港大学理学硕士。2021 年 1 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 | 副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理 | 2022 年 11 月 2 日 | - | 23 年 | 副总经理，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、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。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。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 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的基金经 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 理。 |
| 李沐阳 | 指数投资部总监助理、本基金的基金经理 | 2022 年 11 月 2 日 | - | 7 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。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

## 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差

进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 29 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年一二季度，随着 AI 产业及消费电子产品需求持续大幅推动，韩国半导体成分表现亮眼，HBM 需求高增，存储芯片价格持续上涨。此外，合并中国权重国家大基金三期成立的增量产业支持推动的大背景下，及全球 AI 大模型快速更新迭代、HPC 需求高增及端侧应用落地的持续催化，中韩半导体指数整体上涨。

三四季度，中国权重受资本市场政策力度超预期影响，迎来大幅回升，引领指数表现，受益于高弹性特质，半导体版块资金关注度保持高位。韩国部分，此前受外部扰动随泛亚太市场下挫，韩国综指一度熔断，内部政治环境有一定动荡，韩国半导体权重龙头三四季度业绩整体亮眼。全年指数收阳，据 Gartner 数据，2024 年全球半导体行业收入达 6260 亿美元，较上年增长 18%创历史新高，全球半导体产业保持增长。

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 0.021%，期间日跟踪误差为 0.032%，较好地实现了本基金的投资目标。

### 4.5.2 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 1.4314 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.87%，业绩比较基准收益率为 16.80%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，DeepSeek 出世后，中国资产或迎来价值重估，AI 链或持续再诞生资本市场热点，国产替代趋势演绎进一步加速，低成本芯片需求或持续扩张，指数内中国企业权重预期或持续受到支撑。韩国方面，产业龙头格局仍保持确定，但短期高端 HBM 需求或有分化，同时地缘因素不确定性或仍存在，然而长期角度看，依托于成熟技术优势，AI 持续向终端渗透，其长期业绩增长趋势或得以持续。未来随着端侧 AI 创新加速并或由手机/PC 向其他设备普及，AI 同硬件终端实现

高融合度，应用渗透率未来或逐步提高，半导体产业下游格局有望进一步拓宽，随半导体产业全球化及国内链加速演绎，整体指数长期表现或受提振。

## 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规法律部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1)全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司合规法律部开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司合规法律部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司合规法律部通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有

人谋求最大利益。

### 4.8 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。

### 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 4.10 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明（2025）审字第 70025451_B09 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| | |
|---|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | 华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。<br>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。<br>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时，管理层负责评估华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。<br>治理层负责监督华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导 |

| | |
|---|---|
| 任 | 致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br>（1） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。<br>（2） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br>（3） 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br>（4） 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）不能持续经营。<br>（5） 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 施翊洲　　张晓阳 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 |
| 审计报告日期 | 2025 年 3 月 28 日 |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 58,622,033.68 | 13,780,552.54 |
| 结算备付金 | | 176,830.90 | 128,509.92 |
| 存出保证金 | | 149,206.90 | 10,537.69 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 653,495,852.59 | 183,866,852.59 |
| 其中：股票投资 | | 653,495,852.59 | 183,866,852.59 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 7.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 27,477,888.25 | 1,453.13 |
| 应收股利 | | 302,875.86 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 740,224,688.18 | 197,787,905.87 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2024 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>2023 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | 768,562.57 |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 1,959,194.29 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 523,873.19 | 117,513.21 |
| 应付托管费 | | 98,226.20 | 22,033.74 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,500.63 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 79,107,912.19 | 438,658.61 |
| 负债合计 | | 79,731,512.21 | 3,305,962.42 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 461,427,000.00 | 157,427,000.00 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | 199,066,175.97 | 37,054,943.45 |
| 净资产合计 | | 660,493,175.97 | 194,481,943.45 |
| 负债和净资产总计 | | 740,224,688.18 | 197,787,905.87 |

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4314 元，基金份额总额 461,427,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 62,867,025.58 | 27,489,602.47 |
| 1.利息收入 | | 171,050.57 | 78,012.70 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 171,050.57 | 78,012.70 |
| 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） | | 60,851,248.70 | 8,180,534.67 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | 58,636,236.85 | 6,925,096.16 |
| 基金投资收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.19 | 44,555.64 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.20 | 2,170,456.21 | 1,255,438.51 |
| 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 | 7.4.7.21 | 7,507,508.62 | 20,752,121.37 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 失以“-”号填列） | | | |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -3,900,411.73 | -733,172.90 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.22 | -1,762,370.58 | -787,893.37 |
| **减：二、营业总支出** | | 5,248,504.27 | 1,376,203.84 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 4,094,463.84 | 848,799.15 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 767,711.96 | 159,149.89 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．投资顾问费 | | - | - |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．信用减值损失 | 7.4.7.23 | - | - |
| 7．税金及附加 | | 160.79 | - |
| 8．其他费用 | 7.4.7.24 | 386,167.68 | 368,254.80 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 57,618,521.31 | 26,113,398.63 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 57,618,521.31 | 26,113,398.63 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 57,618,521.31 | 26,113,398.63 |

## 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 157,427,000.00 | - | 37,054,943.45 | 194,481,943.45 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 157,427,000.00 | - | 37,054,943.45 | 194,481,943.45 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 304,000,000.00 | - | 162,011,232.52 | 466,011,232.52 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 57,618,521.31 | 57,618,521.31 |
| （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） | 304,000,000.00 | - | 104,392,711.21 | 408,392,711.21 |
| 其中：1.基金申购款 | 909,000,000.00 | - | 306,198,933.60 | 1,215,198,933.60 |
| 2.基金赎回款 | -605,000,000.00 | - | -201,806,222.39 | -806,806,222.39 |
| （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 | 461,427,000.00 | - | 199,066,175.97 | 660,493,175.97 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 231,427,000.00 | - | -7,535,330.56 | 223,891,669.44 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 231,427,000.00 | - | -7,535,330.56 | 223,891,669.44 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -74,000,000.00 | - | 44,590,274.01 | -29,409,725.99 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 26,113,398.63 | 26,113,398.63 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| （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） | -74,000,000.00 | - | 18,476,875.38 | -55,523,124.62 |
| 其中：1.基金申购款 | 128,000,000.00 | - | 25,763,919.10 | 153,763,919.10 |
| 2.基金赎回款 | -202,000,000.00 | - | -7,287,043.72 | -209,287,043.72 |
| （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 | 157,427,000.00 | - | 37,054,943.45 | 194,481,943.45 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| 韩勇 | 房伟力 | 赵景云 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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[2022]2242 号《关于准予华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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《华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 354,427,000.00 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(2022)第 0903 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合

同》于 2022 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 354,427,000.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行(JPMorgan Chase Bank, National Association)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]339 号核准，本基金 354,427,000.00 份基金份额于 2022 年 12 月 22 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《华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具，其中境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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。境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、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)、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、债券回购、资产支持证券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的相关规定)。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的业绩比较基准为中证韩交所中韩半导体指数收益率。

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) (以下简称“华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接(QDII)”)。华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接(QDII)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 2025 年 3 月 28 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1)金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，

仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2)金融负债

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

(3)衍生金融工具

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支

持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

### 7.4.4.8 损益平准金

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

### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相

应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

### 7.4.4.13 分部报告

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

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

部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关境内外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 日前取得的基金、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基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 58,622,033.68 | 13,780,552.54 |
| 等于：本金 | 58,618,725.03 | 13,779,884.72 |
| 加：应计利息 | 3,308.65 | 667.82 |

| | | |
|---|---|---|
| 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 | 58,622,033.68 | 13,780,552.54 |

注：于 2024 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 38,301,935.74 元，韩国元活期存款 2,342.00 元(折合人民币 11.56 元)和美元活期存款 2,826,788.49 元(折合人民币 20,320,086.38 元)（于 2023 年 12 月 31 日，人民币活期存款 10,994,803.38 元，韩国元活期存款 902.00 元(折合人民币 4.97 元)和美元活期存款 393,316.70 元(折合人民币 2,785,744.19 元)。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2024 年 12 月 31 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 632,278,383.73 | - | 653,495,852.59 | 21,217,468.86 |
| 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 | | 632,278,383.73 | - | 653,495,852.59 | 21,217,468.86 |
| 项目 | | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | | | |
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 170,174,967.27 | - | 183,866,852.59 | 13,691,885.32 |
| 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 | | 170,174,967.27 | - | 183,866,852.59 | 13,691,885.32 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

| |
|---|
| 注：无。 |

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

### 7.4.7.7 其他权益工具投资

#### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 117,999.16 | 40,231.33 |
| 其中：交易所市场 | 117,999.16 | 40,231.33 |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 200,000.00 | 215,000.00 |
| 应退退补款 | 78,789,913.03 | 183,427.28 |
| 合计 | 79,107,912.19 | 438,658.61 |

### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 157,427,000.00 | 157,427,000.00 |
| 本期申购 | 909,000,000.00 | 909,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -605,000,000.00 | -605,000,000.00 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 461,427,000.00 | 461,427,000.00 |

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| --- | --- | --- | --- |
| 上年度末 | 11,880,428.84 | 25,174,514.61 | 37,054,943.45 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 11,880,428.84 | 25,174,514.61 | 37,054,943.45 |
| 本期利润 | 50,111,012.69 | 7,507,508.62 | 57,618,521.31 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 20,848,111.13 | 83,544,600.08 | 104,392,711.21 |
| 其中：基金申购款 | 91,925,942.05 | 214,272,991.55 | 306,198,933.60 |
| 基金赎回款 | -71,077,830.92 | -130,728,391.47 | -201,806,222.39 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 82,839,552.66 | 116,226,623.31 | 199,066,175.97 |

### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
| --- | --- | --- |
| 活期存款利息收入 | 152,497.47 | 65,126.28 |
| 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 | 17,609.14 | 12,304.60 |
| 其他 | 943.96 | 581.82 |
| 合计 | 171,050.57 | 78,012.70 |

### 7.4.7.14 股票投资收益

### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
| --- | --- | --- |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 58,636,236.85 | 6,925,096.16 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 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 | 58,636,236.85 | 6,925,096.16 |

### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 925,949,585.15 | 224,131,559.29 |
| 减：卖出股票成本总额 | 865,470,749.42 | 216,605,498.11 |
| 减：交易费用 | 1,842,598.88 | 600,965.02 |
| 买卖股票差价收入 | 58,636,236.85 | 6,925,096.16 |

### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——赎回差价收入。

### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——申购差价收入。

### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

### 7.4.7.15 基金投资收益

无。

### 7.4.7.16 债券投资收益

### 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

### 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——买卖债券差价收入。

### 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

### 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

### 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

#### 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

### 7.4.7.18 贵金属投资收益

#### 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

#### 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

### 7.4.7.19 衍生工具收益

#### 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出权证成交总额 | 46,001.23 | - |
| 减：卖出权证成本总额 | - | - |
| 减：交易费用 | 105.75 | - |
| 减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额 | 1,339.84 | - |
| 买卖权证差价收入 | 44,555.64 | - |

#### 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

## 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,170,456.21 | 1,255,438.51 |
| 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 | 2,170,456.21 | 1,255,438.51 |

## 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 7,525,583.54 | 20,735,828.72 |
| 股票投资 | 7,525,583.54 | 20,735,828.72 |
| 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 | -18,074.92 | 16,292.65 |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | 7,507,508.62 | 20,752,121.37 |

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

## 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | - | - |
| 替代损益 | -1,762,370.58 | -787,893.37 |
| 合计 | -1,762,370.58 | -787,893.37 |

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

股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

### 7.4.7.23 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

### 7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 60,000.00 | 55,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 注册登记费 | 150,000.00 | 150,000.00 |
| IOPV 计算发布费 | 547.95 | 20,000.00 |
| 其他费用 | - | 400.00 |
| 银行划款手续费 | 55,619.73 | 22,854.80 |
| 合计 | 386,167.68 | 368,254.80 |

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人 |
| 摩根大通银行有限公司(“摩根大通银行”) | 境外资产托管人 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”) | 基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构 |
| PineBridge Investment LLC | 基金管理人的股东 |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”) | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司 |
| 华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）(“华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接基金(QDII)”) | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 794,413.36 | 0.04 | 62,107,202.31 | 16.00 |

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 基金交易

无。

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 388.79 | 0.11 | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 华泰证券 | 38,575.50 | 15.73 | 2.01 | - |

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、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不

得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,094,463.84 | 848,799.15 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 86,335.89 | 32,225.53 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 4,008,127.95 | 816,573.62 |

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 767,711.96 | 159,149.89 |

注：支付基金托管人中国建设银行(含境外托管人收取的费用)的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期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。

### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未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。

### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未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。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>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） | 37,661,183.00 | 8.1619 | 50,115,500.00 | 31.8341 |

### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 摩根大通银行 | 20,320,071.20 | 95,126.43 | 2,785,748.45 | 53,273.72 |
| 中国建设银行 | 38,301,962.48 | 57,371.04 | 10,994,804.09 | 11,852.56 |

注：本基金由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管的银行存款按适用利率或约定利率计息。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张 ） | 总金额 |
| 华泰联合证券 | 688709 | 成都华微 | 网下申购 | 3,552.00 | 55,730.88 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 华泰联合证券 | 603341 | 龙旗科技 | 网下申购 | 1,103.00 | 28,678.00 |
| 华泰联合证券 | 301606 | 绿联科技 | 网下申购 | 3,959.00 | 83,970.39 |
| 华泰联合证券 | 688726 | 拉普拉斯 | 网下申购 | 9,785.00 | 172,020.30 |
| 华泰联合证券 | 688605 | 先锋精科 | 网下申购 | 7,433.00 | 83,918.57 |
| 华泰联合证券 | 301622 | 英思特 | 网下申购 | 3,056.00 | 68,332.16 |

| 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张 ） | 总金额 |
| 华泰联合证券 | 600925 | 苏能股份 | 网下申购 | 8,512 | 52,604.16 |
| 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 | 688469 | 中芯集成 | 网上申购 | 1,000 | 5,690.00 |

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：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。

### 7.4.10.9 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.11 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001279 | 强邦新材 | 2024 年 9 月 27 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 9.68 | 27.91 | 265 | 2,565.20 | 7,396.15 | - |
| 001391 | 国货航 | 2024 年 12 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 2.30 | 6.80 | 4,686 | 10,777.80 | 31,864.80 | - |
| 301522 | 上大股份 | 2024 年 10 月 9 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 6.88 | 24.84 | 816 | 5,614.08 | 20,269.44 | - |
| 301551 | 无线传媒 | 2024 年 9 月 19 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 9.40 | 43.23 | 652 | 6,128.80 | 28,185.96 | - |
| 301556 | 托普云农 | 2024 年 10 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 14.50 | 59.05 | 267 | 3,871.50 | 15,766.35 | - |
| 301571 | 国科天成 | 2024 年 8 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 11.14 | 40.83 | 350 | 3,899.00 | 14,290.50 | - |
| 301585 | 蓝宇股份 | 2024 年 12 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 23.95 | 35.85 | 210 | 5,029.50 | 7,528.50 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301586 | 佳力奇 | 2024 年 8 月 21 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 18.09 | 53.14 | 215 | 3,889.35 | 11,425.10 | - |
| 301606 | 绿联科技 | 2024 年 7 月 17 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 21.21 | 36.49 | 396 | 8,399.16 | 14,450.04 | - |
| 301607 | 富特科技 | 2024 年 8 月 28 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 14.00 | 36.14 | 257 | 3,598.00 | 9,287.98 | - |
| 301608 | 博实结 | 2024 年 7 月 25 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 44.50 | 65.38 | 184 | 8,188.00 | 12,029.92 | - |
| 301611 | 珂玛科技 | 2024 年 8 月 7 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 8.00 | 56.10 | 804 | 6,432.00 | 45,104.40 | - |
| 301613 | 新铝时代 | 2024 年 10 月 18 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 27.70 | 41.77 | 276 | 7,645.20 | 11,528.52 | - |
| 301617 | 博苑股份 | 2024 年 12 月 3 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 27.76 | 39.79 | 253 | 7,023.28 | 10,066.87 | - |
| 301622 | 英思特 | 2024 年 11 月 26 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 22.36 | 44.92 | 306 | 6,842.16 | 13,745.52 | - |
| 301626 | 苏州天脉 | 2024 年 10 月 17 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 21.23 | 65.78 | 957 | 20,317.11 | 62,951.46 | - |
| 301631 | 壹连科技 | 2024 年 11 月 12 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 72.99 | 101.96 | 153 | 11,167.47 | 15,599.88 | - |
| 603072 | 天和磁材 | 2024 年 12 月 24 日 | 1 个月内（含） | 新股未上市 | 12.30 | 12.30 | 2,029 | 24,956.70 | 24,956.70 | - |
| 603072 | 天和磁材 | 2024 年 12 月 24 日 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 12.30 | 12.30 | 226 | 2,779.80 | 2,779.80 | - |
| 603091 | 众鑫股份 | 2024 年 9 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 26.50 | 44.43 | 94 | 2,491.00 | 4,176.42 | - |
| 603194 | 中力股份 | 2024 年 12 月 17 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 20.32 | 28.13 | 291 | 5,913.12 | 8,185.83 | - |
| 603205 | 健尔康 | 2024 年 10 月 29 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 14.65 | 27.35 | 128 | 1,875.20 | 3,500.80 | - |
| 603207 | 小方制药 | 2024 年 8 月 19 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 12.47 | 26.65 | 185 | 2,306.95 | 4,930.25 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024 年 6 月 28 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 18.65 | 22.61 | 129 | 2,405.85 | 2,916.69 | - |
| 603310 | 巍华新 | 2024 年 8 | 6 个月 | 新股锁 | 17.39 | 17.95 | 254 | 4,417.06 | 4,559.30 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 材 | 月 7 日 | | 定期内 | | | | | | |
| 603350 | 安乃达 | 2024 年 6 月 26 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 20.56 | 36.17 | 106 | 2,179.36 | 3,834.02 | - |
| 603391 | 力聚热能 | 2024 年 7 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 40.00 | 41.35 | 100 | 4,000.00 | 4,135.00 | - |
| 603395 | 红四方 | 2024 年 11 月 19 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 7.98 | 35.77 | 154 | 1,228.92 | 5,508.58 | - |
| 688449 | 联芸科技 | 2024 年 11 月 20 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 11.25 | 29.44 | 1,406 | 15,817.50 | 41,392.64 | - |
| 688605 | 先锋精科 | 2024 年 12 月 4 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 11.29 | 53.68 | 744 | 8,399.76 | 39,937.92 | - |
| 688615 | 合合信息 | 2024 年 9 月 19 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 55.18 | 165.78 | 289 | 15,947.02 | 47,910.42 | - |
| 688708 | 佳驰科技 | 2024 年 11 月 27 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 27.08 | 48.95 | 780 | 21,122.40 | 38,181.00 | - |
| 688710 | 益诺思 | 2024 年 8 月 27 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 19.06 | 33.58 | 332 | 6,327.92 | 11,148.56 | - |
| 688721 | 龙图光罩 | 2024 年 7 月 30 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 18.50 | 56.85 | 279 | 5,161.50 | 15,861.15 | - |
| 688726 | 拉普拉斯 | 2024 年 10 月 22 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 17.58 | 33.06 | 979 | 17,210.82 | 32,365.74 | - |
| 688750 | 金天钛业 | 2024 年 11 月 12 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 7.16 | 15.44 | 1,685 | 12,064.60 | 26,016.40 | - |

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

### 7.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.11.4 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。

### 7.4.12 金融工具风险及管理

#### 7.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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

### 7.4.12.2 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开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.12.3 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 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 7.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 7.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 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 | 58,622,033.68 | - | - | - | - | - | 58,622,033.68 |
| 结算备付金 | 176,830.90 | - | - | - | - | - | 176,830.90 |
| 存出保证金 | 149,206.90 | - | - | - | - | - | 149,206.90 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 653,495,852.59 | 653,495,852.59 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 302,875.86 | 302,875.86 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 27,477,888.25 | 27,477,888.25 |
| 资产总计 | 58,948,071.48 | - | - | - | - | 681,276,616.70 | 740,224,688.18 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 523,873.19 | 523,873.19 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 98,226.20 | 98,226.20 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1,500.63 | 1,500.63 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 79,107,912.19 | 79,107,912.19 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 79,731,512.21 | 79,731,512.21 |
| 利率敏感度缺口 | 58,948,071.48 | - | - | - | - | 601,545,104.49 | 660,493,175.97 |
| 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 | 13,780,552.54 | - | - | - | - | - | 13,780,552.54 |
| 结算备付金 | 128,509.92 | - | - | - | - | - | 128,509.92 |
| 存出保证金 | 10,537.69 | - | - | - | - | - | 10,537.69 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 183,866,852.59 | 183,866,852.59 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 1,453.13 | 1,453.13 |
| 资产总计 | 13,919,600.15 | - | - | - | - | 183,868,305.72 | 197,787,905.87 |
| 负债 | | | | | | | |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | 768,562.57 | 768,562.57 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 117,513.21 | 117,513.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 22,033.74 | 22,033.74 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 1,959,194.29 | 1,959,194.29 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 438,658.61 | 438,658.61 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 3,305,962.42 | 3,305,962.42 |
| 利率敏感度缺口 | 13,919,600.15 | - | - | - | - | 180,562,343.30 | 194,481,943.45 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 7.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

### 7.4.12.4.2 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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

### 7.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 美元<br>折合人民币 | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 货币资金 | 20,320,086.38 | - | 11.56 | 20,320,097.94 |
| 交易性金融资产 | - | - | 311,451,587.26 | 311,451,587.26 |
| 应收股利 | - | - | 302,875.86 | 302,875.86 |
| 应收清算款 | - | - | 27,478,207.05 | 27,478,207.05 |
| 资产合计 | 20,320,086.38 | - | 339,232,681.73 | 359,552,768.11 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 20,320,086.38 | - | 339,232,681.73 | 359,552,768.11 |
| 项目 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | | | |
| | 美元<br>折合人民币 | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 货币资金 | 2,785,744.19 | - | 4.97 | 2,785,749.16 |
| 交易性金融资产 | - | - | 95,275,995.25 | 95,275,995.25 |
| 资产合计 | 2,785,744.19 | - | 95,276,000.22 | 98,061,744.41 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付清算款 | - | - | 1,959,194.29 | 1,959,194.29 |
| 负债合计 | - | - | 1,959,194.29 | 1,959,194.29 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 2,785,744.19 | - | 93,316,805.93 | 96,102,550.12 |

### 7.4.12.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率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 12 月 31 日） | 上年度末 （2023 年 12 月 31 日 ） |
| | 所有外币相对人民币升值 5% | 17,977,638.41 | 4,805,127.51 |
| | 所有外币相对人民币贬值 5% | -17,977,638.41 | -4,805,127.51 |

### 7.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 7.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 12 月 31 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 | 653,495,852.59 | 98.94 | 183,866,852.59 | 94.54 |
| 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 | - | - | -768,562.57 | -0.40 |
| 合计 | 653,495,852.59 | 98.94 | 183,098,290.02 | 94.15 |

注：其他为可退替代款。

### 7.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准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 12 月 31 日） | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 31,541,760.37 | 8,436,457.37 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -31,541,760.37 | -8,436,457.37 |

## 7.4.13 公允价值

### 7.4.13.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 652,842,063.98 | 183,866,852.59 |
| 第二层次 | 27,736.50 | - |
| 第三层次 | 626,052.11 | - |
| 合计 | 653,495,852.59 | 183,866,852.59 |

### 7.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 7.4.13.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

### 7.4.13.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | - | - |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 298,326.91 | 298,326.91 |
| 转出第三层次 | - | 100,056.74 | 100,056.74 |
| 当期利得或损失总额 | - | 427,781.94 | 427,781.94 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 427,781.94 | 427,781.94 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 626,052.11 | 626,052.11 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 375,795.52 | 375,795.52 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | | |
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | - | - |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | - | - |
| 当期利得或损失总额 | - | - | - |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | - | - |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | - | - |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | - | - |

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2024 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

### 7.4.13.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 证券交易所上市但尚在限售期内的股票 | 626,052.11 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 0.2665~5.7444 | 负相关 |
| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| - | - | - | - | - | - |

### 7.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

### 7.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)基金申购款

于 2024 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 1,215,198,933.60 元(2023 年度：153,763,919.10 元)，其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 1,215,198,933.60 元(2023 年度：其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 153,763,919.10 元)。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 653,495,852.59 | 88.28 |
| | 其中：普通股 | 653,495,852.59 | 88.28 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 58,798,864.58 | 7.94 |
| 8 | 其他各项资产 | 27,929,971.01 | 3.77 |
| 9 | 合计 | 740,224,688.18 | 100.00 |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 中国 | 342,044,265.33 | 51.79 |
| 韩国 | 311,451,587.26 | 47.15 |

| | | |
|---|---|---|
| 合计 | 653,495,852.59 | 98.94 |

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 境内股票投资组合分类： | - | - |
| 农、林、牧、渔业 | - | - |
| 采矿业 | - | - |
| 制造业 | 291,943,911.07 | 44.20 |
| 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| 建筑业 | - | - |
| 批发和零售业 | - | - |
| 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| 住宿和餐饮业 | - | - |
| 信息传输、软件和信息技术服务业 | 49,058,226.00 | 7.43 |
| 金融业 | - | - |
| 房地产业 | - | - |
| 租赁和商务服务业 | - | - |
| 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| 教育 | - | - |
| 卫生和社会工作 | - | - |
| 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| 综合 | - | - |
| 境外股票投资组合分类： | - | - |
| 信息科技 | 311,451,587.26 | 47.15 |
| 电信服务 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 必需消费品 | - | - |
| 非必需消费品 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 通信服务 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 公共事业 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 合计 | 652,453,724.33 | 98.78 |

注：1.上述股票价值不包括可退替代估增。

2.境外股票投资采用彭博行业分类标准。

### 8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 境内股票投资组合分类： | - | - |
| 农、林、牧、渔业 | - | - |
| 采矿业 | - | - |
| 制造业 | 477,519.88 | 0.07 |
| 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| 建筑业 | - | - |
| 批发和零售业 | - | - |
| 交通运输、仓储和邮政业 | 420,204.45 | 0.06 |
| 住宿和餐饮业 | - | - |
| 信息传输、软件和信息技术服务业 | 133,255.37 | 0.02 |
| 金融业 | - | - |
| 房地产业 | - | - |
| 租赁和商务服务业 | - | - |
| 科学研究和技术服务业 | 11,148.56 | 0.00 |
| 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| 教育 | - | - |
| 卫生和社会工作 | - | - |
| 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| 综合 | - | - |
| 境外股票投资组合分类： | - | - |
| 通信服务 | - | - |
| 非必需消费品 | - | - |
| 必需消费品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 信息科技 | - | - |
| 公共事业 | - | - |
| 合计 | 1,042,128.26 | 0.16 |

注：1.上述股票价值不包括可退替代估增。

2.境外股票投资采用彭博行业分类标准。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

### 8.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英 | 公司名称（中文） | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

| | 文） | | | | | | | （%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 三星电子有限公司 | 005930 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 337,811 | 88,739,606.95 | 13.44 |
| 2 | SK HYNIX INC | SK 海力士株式会社 | 000660 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 85,174 | 73,137,263.48 | 11.07 |
| 3 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 中芯国际 | 688981 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 595,886 | 56,382,733.32 | 8.54 |
| 4 | Hygon Information Technology Co.,Ltd. | 海光信息 | 688041 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 278,631 | 41,736,137.49 | 6.32 |
| 5 | Cambricon Technologies Corporation Limited | 寒武纪 | 688256 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 62,557 | 41,162,506.00 | 6.23 |
| 6 | Naura Technology Group Co.,Ltd. | 北方华创 | 002371 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 95,482 | 37,333,462.00 | 5.65 |
| 7 | Will Semiconductor Co.,Ltd.Shanghai | 韦尔股份 | 603501 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 255,188 | 26,644,179.08 | 4.03 |
| 8 | Advanced Micro-F | 中微公司 | 688012 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 130,547 | 24,694,270.52 | 3.74 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | abrication Equipment Inc.China | | | | | | | |
| 9 | Montage Technology Co.,Ltd. | 澜起科技 | 688008 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 342,391 | 23,248,348.90 | 3.52 |
| 10 | LEENO INDUSTRIAL INC | LEENO 工业股份有限公司 | 058470 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 24,104 | 22,804,297.85 | 3.45 |
| 11 | HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD | 韩美半导体有限公司 | 042700 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 52,820 | 21,517,134.11 | 3.26 |
| 12 | Gigadevice Semiconductor Inc. | 兆易创新 | 603986 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 199,100 | 21,263,880.00 | 3.22 |
| 13 | Jcet Group Co.,Ltd. | 长电科技 | 600584 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 429,025 | 17,529,961.50 | 2.65 |
| 14 | HPSP CO LTD | HPSP CO LTD | 403870 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 113,204 | 14,561,348.02 | 2.20 |
| 15 | TECHWING INC | TECHWING INC | 089030 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 76,276 | 14,481,592.93 | 2.19 |
| 16 | EO TECHNICS CO LTD | EO 技术有限公司 | 039030 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 20,351 | 13,988,046.61 | 2.12 |
| 17 | Unigroup Guoxin Microelectronics Co.,Ltd. | 紫光国微 | 002049 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 203,737 | 13,114,550.69 | 1.99 |
| 18 | DB HITEK CO LTD | DB HiTek 股份有限公司 | 000990 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 75,471 | 12,353,662.11 | 1.87 |
| 19 | JEL | 周星工程株式会社 | 036930 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 83,915 | 12,202,729.36 | 1.85 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 20 | Maxscend Microelectronics Company Limited | 卓胜微 | 300782 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 112,222 | 10,066,313.40 | 1.52 |
| 21 | National Silicon Industry Group Co.,Ltd. | 沪硅产业 | 688126 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 493,898 | 9,295,160.36 | 1.41 |
| 22 | WONIK IPS CO LTD | Wonik IPS 有限公司 | 240810 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 80,100 | 8,839,793.60 | 1.34 |
| 23 | ISC CO LTD | ISC 株式会社 | 095340 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 24,734 | 8,805,655.74 | 1.33 |
| 24 | Empyrean Technology Co.,Ltd. | 华大九天 | 301269 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 65,200 | 7,895,720.00 | 1.20 |
| 25 | China Resources Microelectronics Limited | 华润微 | 688396 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 158,747 | 7,491,270.93 | 1.13 |
| 26 | LX SEMICON CO LTD | LX 半导体株式会社 | 108320 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 26,560 | 7,462,295.08 | 1.13 |
| 27 | TOKAI CARBON KOREA CO LTD | 韩国东海碳素株式会社 | 064760 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 14,233 | 4,982,815.03 | 0.75 |
| 28 | YC CORP | YC CORP | 232140 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 95,660 | 4,822,677.27 | 0.73 |
| 29 | Galaxycore Inc. | 格科微 | 688728 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 233,902 | 3,143,642.88 | 0.48 |
| 30 | PSK HOLDING | PSK HOLDINGS | 031980 KS | 韩国证券交易所 | 韩国 | 14,651 | 2,752,669.12 | 0.42 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | S INC | INC | | | | | | |

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

### 8.4.2 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权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 公司名称（中文） | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Air China Cargo Co., Ltd. | 国货航 | 001391 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 46,851 | 420,204.45 | 0.06 |
| 2 | Suzhou Tianmai Thermal Technology Co., Ltd. | 苏州天脉 | 301626 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 957 | 62,951.46 | 0.01 |
| 3 | Intsig Information Co.,Ltd. | 合合信息 | 688615 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 289 | 47,910.42 | 0.01 |
| 4 | Suzhou Kematek, Inc. | 珂玛科技 | 301611 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 804 | 45,104.40 | 0.01 |
| 5 | Maxio Technology (Hangzhou) Co.,Ltd. | 联芸科技 | 688449 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 1,406 | 41,392.64 | 0.01 |
| 6 | Sprint Precision Technologies Co.,Ltd. | 先锋精科 | 688605 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 744 | 39,937.92 | 0.01 |
| 7 | Chengdu Jiachi Electro | 佳驰科技 | 688708 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 780 | 38,181.00 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | nic Technology Co., Ltd. | | | | | | | |
| 8 | Laplace Renewable Energy Technology Co., Ltd. | 拉普拉斯 | 688726 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 979 | 32,365.74 | 0.00 |
| 9 | Hebei Broadcasting Wireless Media Co.,Ltd. | 无线传媒 | 301551 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 652 | 28,185.96 | 0.00 |
| 10 | Baotou Tianhe Magnetics Technology Co., Ltd. | 天和磁材 | 603072 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 2,255 | 27,736.50 | 0.00 |
| 11 | Hunan Xiangtou Goldsky Titanium Industry Technology Co.,Ltd. | 金天钛业 | 688750 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 1,685 | 26,016.40 | 0.00 |
| 12 | Zhonghang Shangda Superalloys | 上大股份 | 301522 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 816 | 20,269.44 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Co.,Ltd. | | | | | | | |
| 13 | Shenzhen Longtu Photomask Co.,Ltd. | 龙图光罩 | 688721 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 279 | 15,861.15 | 0.00 |
| 14 | Zhejiang Top Cloud-Agri Technology Co.,Ltd. | 托普云农 | 301556 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 267 | 15,766.35 | 0.00 |
| 15 | Shenzhen Uniconn Technology Co.,Ltd. | 壹连科技 | 301631 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 153 | 15,599.88 | 0.00 |
| 16 | Ugreen Group Limited | 绿联科技 | 301606 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 396 | 14,450.04 | 0.00 |
| 17 | Teemsun Technology Co.,Ltd. | 国科天成 | 301571 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 350 | 14,290.50 | 0.00 |
| 18 | Baotou Inst Magnetic New Materials Co.,Ltd. | 英思特 | 301622 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 306 | 13,745.52 | 0.00 |
| 19 | Shenzhen Boshijie Technology Co.,Ltd. | 博实结 | 301608 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 184 | 12,029.92 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 20 | Alnera Aluminium Co., Ltd. | 新铝时代 | 301613 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 276 | 11,528.52 | 0.00 |
| 21 | Anhui Jialiqi Advanced Composites Technology Co.,Ltd. | 佳力奇 | 301586 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 215 | 11,425.10 | 0.00 |
| 22 | Shanghai Innostar Bio-Tech Co.,Ltd. | 益诺思 | 688710 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 332 | 11,148.56 | 0.00 |
| 23 | Shandong Boyuan Pharmaceutical &Chemical Co.,Ltd. | 博苑股份 | 301617 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 253 | 10,066.87 | 0.00 |
| 24 | Zhejiang Ev-Tech Co.,Ltd. | 富特科技 | 301607 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 257 | 9,287.98 | 0.00 |
| 25 | Zhejiang E-P Equipment Co., Ltd. | 中力股份 | 603194 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 291 | 8,185.83 | 0.00 |
| 26 | Zhejiang Lanyu Digital Technology Co | 蓝宇股份 | 301585 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 210 | 7,528.50 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | .,Ltd. | | | | | | | |
| 27 | Anhui Strong State New Materials Co.,Ltd. | 强邦新材 | 001279 SZ | 深圳证券交易所 | 中国 | 265 | 7,396.15 | 0.00 |
| 28 | Cnsig Anhui Hongsifang Fertilizer Co.,Ltd. | 红四方 | 603395 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 154 | 5,508.58 | 0.00 |
| 29 | Shanghai Xiao Fang Pharmaceutical Co.,Ltd. | 小方制药 | 603207 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 185 | 4,930.25 | 0.00 |
| 30 | Zhejiang Weihua New Material Co.,Ltd. | 巍华新材 | 603310 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 254 | 4,559.30 | 0.00 |
| 31 | Zhejiang Zhongxin Environmental Protection Technology Group Co.,Ltd. | 众鑫股份 | 603091 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 94 | 4,176.42 | 0.00 |
| 32 | Zhejiang Liju | 力聚热能 | 603391 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 100 | 4,135.00 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Thermal Equipment Co.,Ltd. | | | | | | | |
| 33 | Ananda Drive Techniques(Shanghai)Co.,Ltd. | 安乃达 | 603350 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 106 | 3,834.02 | 0.00 |
| 34 | Jianerkang Medical Co., Ltd. | 健尔康 | 603205 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 128 | 3,500.80 | 0.00 |
| 35 | Shandong Jianbang New Material Co.,Ltd. | 键邦股份 | 603285 SH | 上海证券交易所 | 中国 | 129 | 2,916.69 | 0.00 |

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 005930 KS | 196,917,964.43 | 101.25 |
| 2 | SK HYNIX INC | 000660 KS | 145,089,498.29 | 74.60 |
| 3 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 688981 SH | 89,761,745.18 | 46.15 |
| 4 | Naura Technology Group Co.,Ltd. | 002371 SZ | 85,812,066.70 | 44.12 |
| 5 | Will Semiconductor Co.,Ltd.Shanghai | 603501 SH | 69,303,271.91 | 35.63 |
| 6 | Hygon Information Technology Co.,Ltd. | 688041 SH | 64,066,769.88 | 32.94 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 7 | HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD | 042700 KS | 63,496,640.30 | 32.65 |
| 8 | Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc.China | 688012 SH | 53,424,881.61 | 27.47 |
| 9 | Gigadevice Semiconductor Inc. | 603986 SH | 45,618,777.48 | 23.46 |
| 10 | Cambricon Technologies Corporation Limited | 688256 SH | 43,610,215.54 | 22.42 |
| 11 | Montage Technology Co.,Ltd. | 688008 SH | 42,447,183.42 | 21.83 |
| 12 | LEENO INDUSTRIAL INC | 058470 KS | 40,403,134.21 | 20.77 |
| 13 | Jcet Group Co.,Ltd. | 600584 SH | 36,911,418.50 | 18.98 |
| 14 | HPSP CO LTD | 403870 KS | 31,993,632.40 | 16.45 |
| 15 | Unigroup Guoxin Microelectronics Co.,Ltd. | 002049 SZ | 31,203,961.40 | 16.04 |
| 16 | EO TECHNICS CO LTD | 039030 KS | 28,487,560.79 | 14.65 |
| 17 | Maxscend Microelectronics Company Limited | 300782 SZ | 25,962,440.96 | 13.35 |
| 18 | DB HITEK CO LTD | 000990 KS | 25,264,627.89 | 12.99 |
| 19 | JEL | 036930 KS | 22,122,304.64 | 11.37 |
| 20 | National Silicon Industry Group Co.,Ltd. | 688126 SH | 21,704,214.78 | 11.16 |
| 21 | WONIK IPS CO LTD | 240810 KS | 20,036,554.86 | 10.30 |
| 22 | China Resources Microelectronics Limited | 688396 SH | 17,469,112.18 | 8.98 |
| 23 | TECHWING INC | 089030 KS | 15,883,595.65 | 8.17 |
| 24 | LX SEMICON CO LTD | 108320 KS | 14,647,919.24 | 7.53 |
| 25 | Empyrean Technology Co.,Ltd. | 301269 SZ | 14,052,921.00 | 7.23 |
| 26 | ISC CO LTD | 095340 KS | 12,311,369.67 | 6.33 |
| 27 | HANA MICRON INC | 067310 KS | 11,681,632.02 | 6.01 |
| 28 | TOKAI CARBON KOREA CO LTD | 064760 KS | 11,519,848.26 | 5.92 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 29 | KOH YOUNG TECHNOLOGY INC | 098460 KS | 9,561,864.22 | 4.92 |
| 30 | Acm Research (Shanghai), Inc. | 688082 SH | 6,988,969.20 | 3.59 |
| 31 | YC CORP | 232140 KS | 5,909,050.07 | 3.04 |
| 32 | GAONCHIPS CO LTD | 399720 KS | 4,673,170.14 | 2.40 |
| 33 | Galaxycore Inc. | 688728 SH | 4,660,408.31 | 2.40 |

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 005930 KS | 91,525,173.90 | 47.06 |
| 2 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 688981 SH | 84,185,029.07 | 43.29 |
| 3 | SK HYNIX INC | 000660 KS | 78,637,392.45 | 40.43 |
| 4 | Naura Technology Group Co.,Ltd. | 002371 SZ | 69,684,175.82 | 35.83 |
| 5 | Hygon Information Technology Co.,Ltd. | 688041 SH | 60,230,792.61 | 30.97 |
| 6 | HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD | 042700 KS | 52,909,063.81 | 27.21 |
| 7 | Cambricon Technologies Corporation Limited | 688256 SH | 52,667,723.91 | 27.08 |
| 8 | Will Semiconductor Co.,Ltd.Shanghai | 603501 SH | 50,618,568.38 | 26.03 |
| 9 | Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc.China | 688012 SH | 46,967,068.55 | 24.15 |
| 10 | Gigadevice Semiconductor Inc. | 603986 SH | 35,665,692.20 | 18.34 |
| 11 | Jcet Group Co.,Ltd. | 600584 SH | 30,810,821.50 | 15.84 |
| 12 | Montage Technology Co.,Ltd. | 688008 SH | 30,449,044.57 | 15.66 |
| 13 | Unigroup Guoxin | 002049 SZ | 25,064,434.22 | 12.89 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Microelectronics Co.,Ltd. | | | |
| 14 | Maxscend Microelectronics Company Limited | 300782 SZ | 19,944,823.86 | 10.26 |
| 15 | National Silicon Industry Group Co.,Ltd. | 688126 SH | 18,662,256.22 | 9.60 |
| 16 | LEENO INDUSTRIAL INC | 058470 KS | 18,452,150.99 | 9.49 |
| 17 | China Resources Microelectronics Limited | 688396 SH | 14,278,204.81 | 7.34 |
| 18 | HPSP CO LTD | 403870 KS | 13,475,939.24 | 6.93 |
| 19 | Empyrean Technology Co.,Ltd. | 301269 SZ | 12,960,469.49 | 6.66 |
| 20 | EO TECHNICS CO LTD | 039030 KS | 12,480,588.78 | 6.42 |
| 21 | DB HITEK CO LTD | 000990 KS | 12,127,794.47 | 6.24 |
| 22 | JEL | 036930 KS | 9,947,552.29 | 5.11 |
| 23 | WONIK IPS CO LTD | 240810 KS | 9,068,856.17 | 4.66 |
| 24 | HANA MICRON INC | 067310 KS | 8,850,420.39 | 4.55 |
| 25 | Acm Research (Shanghai), Inc. | 688082 SH | 7,983,861.89 | 4.11 |
| 26 | Sg Micro Corp | 300661 SZ | 7,454,733.93 | 3.83 |
| 27 | KOH YOUNG TECHNOLOGY INC | 098460 KS | 7,262,848.91 | 3.73 |
| 28 | LX SEMICON CO LTD | 108320 KS | 6,790,312.33 | 3.49 |
| 29 | ISC CO LTD | 095340 KS | 5,388,890.49 | 2.77 |
| 30 | TOKAI CARBON KOREA CO LTD | 064760 KS | 5,010,866.45 | 2.58 |
| 31 | FADU INC | 440110 KS | 4,777,020.90 | 2.46 |
| 32 | SIMMTECH CO LTD | 222800 KS | 4,409,030.36 | 2.27 |

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入成本（成交）总额 | 1,327,574,165.88 |
| 卖出收入（成交）总额 | 925,949,585.15 |

注：不考虑相关交易费用。

## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

## 8.11 投资组合报告附注

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

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

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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 | 149,206.90 |
| 2 | 应收清算款 | 27,477,888.25 |
| 3 | 应收股利 | 302,875.86 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 27,929,971.01 |

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.11.5.1 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。

#### 8.11.5.2 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 | 公司名称 | 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 | 301626 | 苏州天脉 | 62,951.46 | 0.01 | 新股锁定期内 |
| 2 | 688615 | 合合信息 | 47,910.42 | 0.01 | 新股锁定期内 |
| 3 | 301611 | 珂玛科技 | 45,104.40 | 0.01 | 新股锁定期内 |
| 4 | 688449 | N 联芸 | 41,392.64 | 0.01 | 新股锁定期内 |
| 5 | 001391 | C 国货航 | 31,864.80 | 0.00 | 新股锁定期内 |

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | | 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） | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 14,554 | 31,704.48 | 149,401,270.00 | 32.38 | 274,364,547.00 | 59.46 | 37,661,183.00 | 8.16 |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | BARCLAYS BANK PLC | 55,102,806.00 | 11.94 |
| 2 | 上海宁苑资产管理有限公司－宁苑沛华二号私募证券投资基金 | 33,466,021.00 | 7.25 |
| 3 | OPTIVER AUSTRALIA PTY LIMITED－自有资金－R | 24,198,637.00 | 5.24 |
| 4 | 江木溪 | 9,699,300.00 | 2.10 |
| 5 | 郑州上正安廷私募股权投资基金管理合伙企业（有限合伙） | 4,081,400.00 | 0.88 |
| 6 | 陈晓原 | 3,750,300.00 | 0.81 |
| 7 | 上海弈倍私募基金管理有限公司－弈倍定制二号私募证券投资基金 | 3,650,000.00 | 0.79 |
| 8 | 上海宁苑资产管理有限公司－宁苑沛 | 3,594,200.00 | 0.78 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 华稳定增长一号私募证券投资基金 | | |
| 9 | 上海弈倍私募基金管理有限公司－弈倍龙杉七号私募证券投资基金 | 3,458,300.00 | 0.75 |
| 10 | UBS AG | 3,007,503.00 | 0.65 |
| 11 | 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） | 37,661,183.00 | 8.16 |

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。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2022 年 11 月 2 日）基金份额总额 | 354,427,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 157,427,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 909,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 605,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 461,427,000.00 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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，陆桢女士不再担任公司独立董事。

2024 年 7 月 2 日，经公司董事会审议通过，柳军先生、王文慧女士任公司副总经理。

2024 年 7 月 12 日，经公司董事会审议通过，李晓西先生不再担任公司副总经理。

2024 年 7 月 2 日，柳军先生任公司副总经理，根据法规要求，不再担任职工监事。

2024 年 7 月 11 日，公司全体员工投票推选赵景云女士担任公司职工监事。

2024 年 8 月 16 日，公司股东会书面决定卢龙威先生担任公司监事，卞时珍女士不再担任公司监事。

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：

经中国建设银行股份有限公司研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 海通证券 | 3 | 586,449,841.46 | 26.06 | 138,333.96 | 16.16 | - |
| 方正证券 | 3 | 540,431,638. | 24.01 | 108,088.60 | 12.63 | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 23 | | | | |
| CLSA Securities | 2 | 361,493,019.44 | 16.06 | 180,760.82 | 21.12 | - |
| Samsung | 2 | 344,087,720.86 | 15.29 | 172,043.96 | 20.10 | - |
| Daishin Securities | 2 | 310,792,526.36 | 13.81 | 155,380.27 | 18.15 | - |
| 长江证券 | 1 | 98,900,788.71 | 4.39 | 93,550.87 | 10.93 | - |
| 国投证券 | 1 | 4,543,384.12 | 0.20 | 4,297.50 | 0.50 | - |
| 华金证券 | 1 | 2,224,015.00 | 0.10 | 2,081.55 | 0.24 | - |
| 东海证券 | 1 | 935,804.00 | 0.04 | 885.24 | 0.10 | - |
| 华泰证券 | 2 | 794,413.36 | 0.04 | 388.79 | 0.05 | - |
| 东方财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1.选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司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综合考虑下列因素：

(1)具有相应的业务经营资格；

(2)具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时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，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3)诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；

(4)财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5)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；

(6)被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2.选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

（1)公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

（2)基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

（3)如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3.本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

4.本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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(%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例(%) |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CLSA-S | - | - | - | - | 46,001.23 | 100.00 | - | - |
| SAMSUNG-S | - | - | - | - | - | - | - | - |
| DAISHIN-S | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Daishin Securities | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Samsung | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CLSA-P | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 12 月 27 日 |
| 2 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 12 月 20 日 |
| 3 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 12 月 19 日 |
| 4 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 12 月 05 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 11 月 27 日 |
| 6 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止乾道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 11 月 18 日 |
| 7 | 华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 11 月 02 日 |
| 8 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 10 月 24 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 9 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 09 月 27 日 |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 09 月 27 日 |
| 11 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银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 09 月 19 日 |
| 12 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 09 月 11 日 |
| 13 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳前海财厚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 09 月 04 日 |
| 14 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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 08 月 16 日 |
| 15 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 08 月 12 日 |
| 16 | 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 07 月 24 日 |
| 17 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 19 日 |
| 18 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 18 日 |
| 19 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 13 日 |
| 20 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 06 日 |
| 21 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 03 日 |
| 22 | 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 |
| 23 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 06 月 04 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 放式指数证券投资基金(QDII)暂停申购和赎回业务的公告 | | |
| 24 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 06 月 03 日 |
| 25 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 05 月 11 日 |
| 26 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 04 月 26 日 |
| 27 | 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 |
| 28 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购和赎回业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 02 月 26 日 |
| 29 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 02 月 24 日 |
| 30 | 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 |
| 31 | 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 |
| 32 | 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 |
| 33 | 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 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |

| | | 间区间 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 机构 | 1 | 20240202-20240229;20240327-20240327;20240712-20240716;20240718-20240731;20240805-20240812;20240925-20240927;20241009-20241009;20241011-20241018;20241023-20241023;20241030-20241111;20241113-20241113;20241127-20241127;20241129-20241129;20241212-20241212;20241218-20241218;20241223-20241225;20241227-20241230; | 1,519,802.00 | 1,919,840,691.00 | 1,866,257,687.00 | 55,102,806.00 | 11.94 |
| 联接基金 | 1 | 20240101-20240201; | 50,115,500.00 | 97,145,983.00 | 109,600,300.00 | 37,661,183.00 | 8.16 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金报告期内有单一持有人和本基金联接基金持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。 | | | | | |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 注：无。 |

# §13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

## 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

## 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

**华泰柏瑞基金管理有限公司**

**2025 年 3 月 31 日**