

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 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

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	47
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	47
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	1000 增强
场内简称	1000 增强（扩位简称：中证 1000 增强 ETF）
基金主代码	561590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 23 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	61,499,645.00 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 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求有效跟踪标的指数的基础上，利用定量投资模型，力争实现超越标的指数的投资回报，追求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票的投资策略</p> <p>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制相对业绩基准指数跟踪误差的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>本基金运用的量化投资模型主要包括：</p> <p>（1）多因子 alpha 模型——股票超额回报预测</p> <p>多因子 alpha 模型以中国股票市场较长期的回溯研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。</p> <p>多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适合调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>（2）风险估测模型——有效控制预期风险</p> <p>本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。</p> <p>（3）交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩</p> <p>本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上，</p>

	<p>进行投资收益的优化。</p> <p>(4) 投资组合的优化和调整</p> <p>本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。投资组合构建完成后，本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况，对投资组合进行相应调整，并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。</p> <p>本基金对标的指数的跟踪目标是力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不得超过 6.5%。</p> <p>本基金以 T-1 日优化投资组合为基础，考虑 T 日将会发生的成份股公司变动等情况，设计 T 日申购、赎回清单并公告。</p> <p>2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；</p> <p>4、衍生品投资策略：(1) 股指期货投资策略 (2) 股票期权投资策略 (3) 国债期货投资策略；</p> <p>5、资产支持证券的投资策略；6、融资及转融通证券出借业务的投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金同时是指数型基金，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。

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	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	021-38601799	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200135	200336
法定代表人	贾波	任德奇

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公	北京市西城区太平桥大街 17 号

	司	
--	---	--

§ 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	-6,042,214.94
本期利润	-4,753,290.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0669
本期加权平均净值利润率	-7.71%
本期基金份额净值增长率	-10.05%
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	-10,792,981.68
期末可供分配基金份额利润	-0.1755
期末基金资产净值	50,706,663.32
期末基金份额净值	0.8245
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	-17.55%

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。

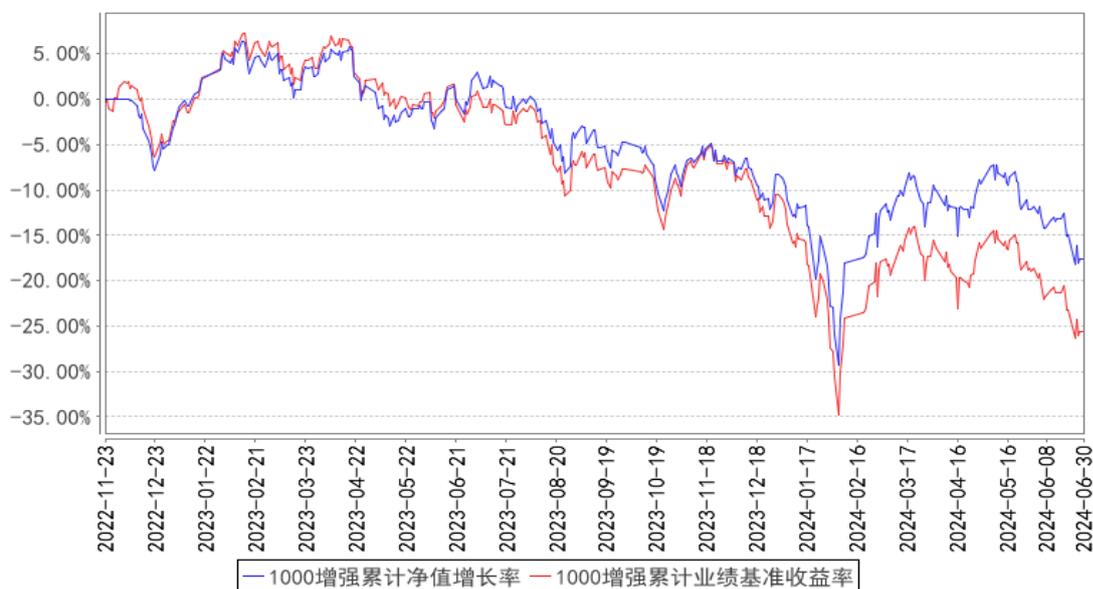
3.2 基金净值表现

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	-6.41%	1.28%	-8.58%	1.43%	2.17%	-0.15%
过去三个月	-6.94%	1.33%	-10.02%	1.49%	3.08%	-0.16%
过去六个月	-10.05%	1.81%	-16.84%	1.97%	6.79%	-0.16%
过去一年	-19.23%	1.43%	-25.84%	1.55%	6.61%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-17.55%	1.25%	-25.63%	1.34%	8.08%	-0.09%

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

1000增强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 2022 年 11 月 23 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。
笪篁	量化与海外投资部总监助理、本基	2022 年 11 月 23 日	-	10 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助

	金的基金经理				理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020年5月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年11月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021年9月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2022年11月起任华泰柏瑞中证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9月起任华泰柏瑞中证1000指数增强型证券投资基金的基金经理。
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2022年11月23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。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基

金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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，A 股整体呈震荡走势，风格上分化较大。春节过后，市场从前期由短期资金流造成的剧烈波动中恢复，转而更加关注公司基本面。一方面，随着美国 OpenAI 公司和苹果公司在 AI 软件和硬件上的推陈出新，AI 算力的成长性打开向上空间。同时，伴随着海外产能和基础设施建设，供应链转移等因素，上游大宗商品和设备出口迎来涨价和业绩兑现。而另一方面，大部分中下游和内需相关产业链经历了业绩预期下修的过程。上半年，A 股市场中银行、能源、公用事业等高股息相关行业表现较强，同时以人工智能创新链、消费电子复苏链为代表的“科特估”主题先后成为市场热点。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别上涨 2.95% 和 0.89%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数上涨 11.03%；代表小市值公司的中证 1000 和中证 2000 指数同期涨跌幅分别为 -16.84% 和 -23.28%。横向比较来看，大市值与高股息板块相对较强，中小市值下跌较多。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的

投资策略。由于我们对上市公司财务质量和经营质量的把控较为系统和严谨，在投资全流程中的风控较为严格，因而在本轮小微盘急跌过程和上市公司退市风波中，超额收益几乎不受影响，超额收益波动较小。

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 0.251%，期间日跟踪误差为 0.325%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8245 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.05%，业绩比较基准收益率为-16.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，中国经济的韧性仍然值得期待。上半年，出口数据显示出强劲的景气度，往后看短期或许会受到海外政治周期扰动，但我们预计许多企业的“出海”战略布局长期有望持续贡献增长。时隔十年，“国九条”再次发布，投资者可能更加重视公司基本面质量的定价，证券市场的定价有效性有望逐步提高。当前，A 股市场许多股票已处于超跌状态，整体估值较低，等待投资人情绪的恢复。在不出现极端情况的前提下，我们对未来几个季度的 A 股股票市场持比较乐观的态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，我们看到市场正逐渐回归基本面逻辑。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的质量因子近期表现较好，我们预期其趋势或仍将延续，而我们的成长因子可能会继续表现良好；同时，小微盘的风险得到释放之后，大小市值、各行业股票可能均有机会，量化投资全市场选股的优势可能将得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值偏低，投资人交易行为更加注重基本面，我们认为专注于基本面的量化投资超额收益有望得到进一步提高，或是很不错的配置风格均衡的基本面量化基金的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由华泰柏瑞基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 1000 增强策略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	2,759,409.75	1,244,845.51
结算备付金		438,382.61	406,474.40
存出保证金		359,510.24	299,992.86

交易性金融资产	6.4.7.2	47,235,910.83	75,355,295.90
其中：股票投资		47,235,910.83	75,232,287.81
基金投资		-	-
债券投资		-	123,008.09
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		50,868,622.55	77,306,608.67
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		29,954.62	45,527.65
应付托管费		4,279.20	6,503.96
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	127,725.41	263,521.33
负债合计		161,959.23	315,553.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	61,499,645.00	83,999,645.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-10,792,981.68	-7,008,589.49
净资产合计		50,706,663.32	76,991,055.51

负债和净资产总计		50,868,622.55	77,306,608.67
----------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8245 元，基金份额总额 61,499,645.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,370,139.03	14,780,192.65
1. 利息收入		7,438.83	7,838.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,438.83	7,838.39
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）		-5,717,327.22	1,927,060.30
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,395,753.64	827,732.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	23,067.05	56,108.85
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	-112,220.46	-
股利收益	6.4.7.19	767,579.83	1,043,218.86
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	1,288,923.96	12,793,788.20
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	50,825.40	51,505.76
减：二、营业总支出		383,151.95	602,103.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	216,026.61	372,872.88
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	6.4.10.2.2	30,860.93	53,267.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.05	0.15
8. 其他费用	6.4.7.23	136,264.36	175,962.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,753,290.98	14,178,089.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,753,290.98	14,178,089.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,753,290.98	14,178,089.56

6.3 净资产变动表

会计主体：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

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	83,999,645.00	-	-7,008,589.49	76,991,055.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	83,999,645.00	-	-7,008,589.49	76,991,055.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,500,000.00	-	-3,784,392.19	-26,284,392.19
（一）、综合收益总额	-	-	-4,753,290.98	-4,753,290.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-22,500,000.00	-	968,898.79	-21,531,101.21

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	60,000,000.00	-	-11,877,614.69	48,122,385.31
2. 基金赎回款	-82,500,000.00	-	12,846,513.48	-69,653,486.52
(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	61,499,645.00	-	-10,792,981.68	50,706,663.32
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	203,999,645.00	-	-10,341,073.97	193,658,571.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	203,999,645.00	-	-10,341,073.97	193,658,571.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	302,500,000.00	-	20,886,615.21	323,386,615.21
(一)、综合收益总额	-	-	14,178,089.56	14,178,089.56
(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)	302,500,000.00	-	6,708,525.65	309,208,525.65
其中：1. 基金申购款	457,500,000.00	-	7,665,215.66	465,165,215.66
2. 基金赎回款	-155,000,000.00	-	-956,690.01	-155,956,690.01
	0			

(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	506,499,645.00	-	10,545,541.24	517,045,186.24

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 1000 增强策略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[2022]2600 号《关于准予华泰柏瑞中证 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 1000 增强策略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 298,999,645.00 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 0961 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2022 年 11 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 298,999,645.00 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]333 号核准,本基金 298,999,645.00 份基金份额于 2022 年 12 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 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、

债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)的比例不得低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 1000 指数收益率。

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 1000 增强策略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	2,759,409.75
等于：本金	2,759,258.48
加：应计利息	151.27
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,759,409.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	49,968,756.09	-	47,235,910.83	-2,732,845.26
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	49,968,756.09	-	47,235,910.83	-2,732,845.26

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	2,966,880.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,966,880.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,966,880.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2409	中证1000股指期货 2409	3.00	2,868,120.00	-98,760.00
合计				-98,760.00
减：可抵销期货暂收款				-98,760.00
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	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	48,164.11
其中：交易所市场	48,164.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,561.30
合计	127,725.41

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	83,999,645.00	83,999,645.00
本期申购	60,000,000.00	60,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-82,500,000.00	-82,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	61,499,645.00	61,499,645.00

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,768,422.55	-2,240,166.94	-7,008,589.49
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,768,422.55	-2,240,166.94	-7,008,589.49
本期利润	-6,042,214.94	1,288,923.96	-4,753,290.98
本期基金份额交易产生的变动数	3,284,342.73	-2,315,443.94	968,898.79
其中：基金申购款	-6,338,328.05	-5,539,286.64	-11,877,614.69
基金赎回款	9,622,670.78	3,223,842.70	12,846,513.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,526,294.76	-3,266,686.92	-10,792,981.68

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	1,822.17
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	5,258.01
其他	358.65
合计	7,438.83

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	-4,829,667.03
股票投资收益——赎回差价收入	-1,566,086.61
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	-6,395,753.64

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	75,808,789.40
减：卖出股票成本总额	80,466,965.55
减：交易费用	171,490.88
买卖股票差价收入	-4,829,667.03

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	69,653,486.52
减：现金支付赎回款总额	31,727,231.52
减：赎回股票成本总额	39,492,341.61
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,566,086.61

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	20.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	23,046.57
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	23,067.05

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	162,882.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	139,800.00
减：应计利息总额	29.01
减：交易费用	6.52
买卖债券差价收入	23,046.57

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	-112,220.46

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	767,579.83
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	767,579.83

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	1,380,283.96
股票投资	1,380,283.96

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	-91,360.00
权证投资	-
期货投资	-91,360.00
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	1,288,923.96

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	50,825.40
合计	50,825.40

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	39,781.56
证券出借违约金	-
注册登记费	74,590.88
IOPV 计算发布费	-8,959.63
银行划款手续费	1,016.29
合计	136,264.36

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

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	12,054,345.41	8.55	-	-

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	17,901.25	10.99	-	-

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	11,282.12	9.06	-	-
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	216,026.61
其中：应支付销售机构的客户维护 费	4,288.72	11,313.70
应支付基金管理人的净管理费	211,737.89	361,559.18

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 0.70% 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 × 0.70% / 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	30,860.93	53,267.57

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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。

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

注：本基金本报告期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。

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（%）
华泰证券股份 有限公司	1,612,838.00	2.6225	1,935,638.00	2.3043

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
交通银行	2,759,409.75	1,822.17	7,470,476.81	2,336.63

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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
-	-	-	-	-	-
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	2,504	40,664.96
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	127084	柳工转2	网上配售	149	14,900.00
华泰联合证券	113666	爱玛转债	网上配售	340	34,000.00

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2023 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.16%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,759,409.75	-	-	-	-	-	2,759,409.75

结算备付金	438,382.61	-	-	-	-	-	438,382.61
存出保证金	359,510.24	-	-	-	-	-	359,510.24
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-47,235,910.83	47,235,910.83
其他资产	-	-	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	3,557,302.60	-	-	-	-	-47,311,319.95	50,868,622.55
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	29,954.62	29,954.62
应付托管费	-	-	-	-	-	4,279.20	4,279.20
其他负债	-	-	-	-	-	127,725.41	127,725.41
负债总计	-	-	-	-	-	161,959.23	161,959.23
利率敏感度缺口	3,557,302.60	-	-	-	-	-47,149,360.72	50,706,663.32
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	1,244,845.51	-	-	-	-	-	1,244,845.51
结算备付金	406,474.40	-	-	-	-	-	406,474.40
存出保证金	158,680.86	-	-	-	-	141,312.00	299,992.86
交易性金融资产	-	-	-	-123,008.09	-	-75,232,287.81	75,355,295.90
资产总计	1,810,000.77	-	-	-123,008.09	-	-75,373,599.81	77,306,608.67
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,527.65	45,527.65
应付托管费	-	-	-	-	-	6,503.96	6,503.96
应交税费	-	-	-	-	-	0.22	0.22
其他负债	-	-	-	-	-	263,521.33	263,521.33
负债总计	-	-	-	-	-	315,553.16	315,553.16
利率敏感度缺口	1,810,000.77	-	-	-123,008.09	-	-75,058,046.65	76,991,055.51

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：0.16%)，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	47,235,910.83	93.16	75,232,287.81	97.72
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	47,235,910.83	93.16	75,232,287.81	97.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证1000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1000指数上升5%	2,285,688.90	3,888,245.84
	中证1000指数下降5%	-2,285,688.90	-3,888,245.84

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	47,235,910.83	75,077,209.29
第二层次	-	123,008.09
第三层次	-	155,078.52
合计	47,235,910.83	75,355,295.90

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	47,235,910.83	92.86
	其中：股票	47,235,910.83	92.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,197,792.36	6.29
8	其他各项资产	434,919.36	0.85
9	合计	50,868,622.55	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,881,478.00	3.71
C	制造业	32,302,716.86	63.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	927,854.06	1.83
E	建筑业	1,124,109.00	2.22
F	批发和零售业	1,619,069.00	3.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,215,217.60	2.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,023,187.06	9.91
J	金融业	662,367.05	1.31
K	房地产业	206,940.00	0.41
L	租赁和商务服务	485,879.00	0.96

	业		
M	科学研究和技术服务业	252,271.80	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	433,316.00	0.85
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	1,101,505.40	2.17
S	综合	-	-
	合计	47,235,910.83	93.16

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	688016	心脉医疗	8,195	803,519.75	1.58
2	688578	艾力斯	12,261	781,516.14	1.54
3	600312	平高电气	36,800	715,760.00	1.41
4	688608	恒玄科技	4,105	600,889.90	1.19
5	002906	华阳集团	20,424	546,546.24	1.08
6	000951	中国重汽	37,900	542,728.00	1.07
7	300638	广和通	30,080	514,368.00	1.01
8	688088	虹软科技	17,471	504,213.06	0.99
9	300623	捷捷微电	28,700	496,510.00	0.98
10	300857	协创数据	8,500	484,500.00	0.96
11	688318	财富趋势	6,020	475,038.20	0.94
12	603871	嘉友国际	26,240	464,185.60	0.92
13	601137	博威合金	29,800	454,152.00	0.90
14	300685	艾德生物	25,700	453,348.00	0.89
15	600971	恒源煤电	37,800	451,332.00	0.89
16	000923	河钢资源	26,000	447,720.00	0.88
17	688596	正帆科技	13,552	447,216.00	0.88
18	603298	杭叉集团	22,660	445,042.40	0.88

19	002928	华夏航空	67,100	425,414.00	0.84
20	300002	神州泰岳	50,400	409,248.00	0.81
21	002612	朗姿股份	29,100	402,162.00	0.79
22	603995	甬金股份	22,700	397,704.00	0.78
23	000090	天健集团	98,200	394,764.00	0.78
24	688408	中信博	4,034	371,450.72	0.73
25	600502	安徽建工	85,300	366,790.00	0.72
26	300119	瑞普生物	26,700	363,654.00	0.72
27	300679	电连技术	9,000	362,070.00	0.71
28	688123	聚辰股份	5,900	358,897.00	0.71
29	603300	华铁应急	65,300	356,538.00	0.70
30	688233	神工股份	18,285	352,351.95	0.69
31	688389	普门科技	21,663	352,240.38	0.69
32	002396	星网锐捷	26,100	344,781.00	0.68
33	600216	浙江医药	31,000	340,380.00	0.67
34	300428	立中集团	18,300	340,197.00	0.67
35	000672	上峰水泥	55,484	339,562.08	0.67
36	600285	羚锐制药	14,000	338,940.00	0.67
37	688776	国光电气	6,095	337,663.00	0.67
38	601811	新华文轩	24,100	337,641.00	0.67
39	000915	华特达因	11,100	334,776.00	0.66
40	605333	沪光股份	12,000	334,200.00	0.66
41	688798	艾为电子	5,900	334,058.00	0.66
42	300783	三只松鼠	15,200	332,424.00	0.66
43	000921	海信家电	10,200	328,848.00	0.65
44	300953	震裕科技	6,000	325,200.00	0.64
45	600557	康缘药业	20,600	323,420.00	0.64
46	688208	道通科技	13,342	322,075.88	0.64
47	688278	特宝生物	5,958	319,050.90	0.63
48	000737	北方铜业	34,000	315,520.00	0.62
49	603699	纽威股份	18,400	315,008.00	0.62
50	688268	华特气体	5,900	304,499.00	0.60
51	301087	可孚医疗	8,800	298,320.00	0.59
52	688213	思特威	6,116	296,626.00	0.58
53	002891	中宠股份	14,200	296,354.00	0.58
54	688239	航宇科技	8,496	295,660.80	0.58
55	300559	佳发教育	30,600	292,842.00	0.58
56	601001	晋控煤业	17,400	287,448.00	0.57
57	603678	火炬电子	11,600	286,404.00	0.56
58	603727	博迈科	21,700	285,572.00	0.56
59	688127	蓝特光学	15,495	284,953.05	0.56
60	601369	陕鼓动力	35,100	281,502.00	0.56
61	603093	南华期货	32,300	279,718.00	0.55

62	000690	宝新能源	54,000	275,400.00	0.54
63	603439	贵州三力	21,400	273,064.00	0.54
64	603368	柳药集团	15,500	271,250.00	0.53
65	300457	赢合科技	14,800	263,884.00	0.52
66	002746	仙坛股份	46,000	263,580.00	0.52
67	600409	三友化工	51,700	259,534.00	0.51
68	002158	汉钟精机	15,500	259,160.00	0.51
69	688568	中科星图	5,377	256,482.90	0.51
70	605589	圣泉集团	12,500	253,625.00	0.50
71	002351	漫步者	19,200	252,480.00	0.50
72	688516	奥特维	5,928	247,849.68	0.49
73	301207	华兰疫苗	13,900	245,613.00	0.48
74	002315	焦点科技	9,100	245,336.00	0.48
75	002011	盾安环境	24,500	240,835.00	0.47
76	300856	科思股份	7,500	240,075.00	0.47
77	002697	红旗连锁	51,800	239,834.00	0.47
78	002993	奥海科技	6,400	238,080.00	0.47
79	600458	时代新材	23,300	235,330.00	0.46
80	300634	彩讯股份	13,700	230,571.00	0.45
81	002215	诺普信	30,600	227,970.00	0.45
82	688100	威胜信息	5,958	227,297.70	0.45
83	688484	南芯科技	6,095	226,124.50	0.45
84	002847	盐津铺子	5,280	225,825.60	0.45
85	002061	浙江交科	60,100	219,365.00	0.43
86	002705	新宝股份	15,100	212,457.00	0.42
87	688106	金宏气体	12,044	211,010.88	0.42
88	603267	鸿远电子	6,100	208,010.00	0.41
89	600389	江山股份	14,600	206,006.00	0.41
90	601163	三角轮胎	13,400	203,948.00	0.40
91	300726	宏达电子	8,900	202,920.00	0.40
92	600483	福能股份	17,350	202,301.00	0.40
93	300476	胜宏科技	6,200	200,012.00	0.39
94	601801	皖新传媒	28,100	194,733.00	0.38
95	002053	云南能投	16,100	194,649.00	0.38
96	002991	甘源食品	3,200	194,080.00	0.38
97	002171	楚江新材	28,600	188,474.00	0.37
98	300613	富瀚微	5,700	187,587.00	0.37
99	300773	拉卡拉	15,000	186,450.00	0.37
100	300747	锐科激光	10,500	186,375.00	0.37
101	603063	禾望电气	12,100	185,493.00	0.37
102	002283	天润工业	42,800	183,612.00	0.36
103	603583	捷昌驱动	9,000	183,420.00	0.36
104	688595	芯海科技	6,095	182,850.00	0.36

105	601333	广深铁路	56,400	182,736.00	0.36
106	601619	嘉泽新能	60,200	182,406.00	0.36
107	603983	丸美股份	6,600	181,698.00	0.36
108	003012	东鹏控股	29,400	179,634.00	0.35
109	300592	华凯易佰	15,700	179,451.00	0.35
110	002597	金禾实业	9,000	179,010.00	0.35
111	002324	普利特	20,900	178,695.00	0.35
112	002987	京北方	16,848	177,409.44	0.35
113	002212	天融信	36,000	175,320.00	0.35
114	002237	恒邦股份	15,200	174,952.00	0.35
115	601019	山东出版	14,600	172,572.00	0.34
116	000034	神州数码	7,400	169,386.00	0.33
117	603650	彤程新材	5,700	168,435.00	0.33
118	301153	中科江南	5,840	165,038.40	0.33
119	688508	芯朋微	4,433	161,228.21	0.32
120	300860	锋尚文化	7,660	161,166.40	0.32
121	601677	明泰铝业	13,900	160,684.00	0.32
122	603103	横店影视	11,600	160,544.00	0.32
123	300926	博俊科技	7,955	159,259.10	0.31
124	688131	皓元医药	8,260	158,013.80	0.31
125	603505	金石资源	5,600	156,408.00	0.31
126	300687	赛意信息	11,000	153,120.00	0.30
127	000600	建投能源	24,300	153,090.00	0.30
128	603801	志邦家居	11,700	153,036.00	0.30
129	003006	百亚股份	6,400	151,680.00	0.30
130	603055	台华新材	14,800	149,924.00	0.30
131	000550	江铃汽车	6,900	149,799.00	0.30
132	300768	迪普科技	12,500	148,125.00	0.29
133	003038	鑫铂股份	9,820	145,041.40	0.29
134	002946	新乳业	16,500	144,540.00	0.29
135	000928	中钢国际	25,800	143,190.00	0.28
136	601975	招商南油	39,800	142,882.00	0.28
137	300841	康华生物	2,800	141,792.00	0.28
138	002545	东方铁塔	20,600	140,286.00	0.28
139	688590	新致软件	10,800	139,320.00	0.27
140	605376	博迁新材	6,100	137,677.00	0.27
141	688006	杭可科技	7,877	137,453.65	0.27
142	002073	软控股份	18,500	136,715.00	0.27
143	603236	移远通信	2,900	135,517.00	0.27
144	000065	北方国际	13,000	134,810.00	0.27
145	002048	宁波华翔	10,400	134,576.00	0.27
146	688351	微电生理	6,095	134,333.80	0.26
147	300693	盛弘股份	6,339	132,738.66	0.26

148	601969	海南矿业	20,900	132,506.00	0.26
149	603568	伟明环保	6,400	131,712.00	0.26
150	600475	华光环能	14,800	128,908.00	0.25
151	603187	海容冷链	11,000	128,260.00	0.25
152	688138	清溢光电	5,900	126,850.00	0.25
153	601717	郑煤机	8,500	125,800.00	0.25
154	603588	高能环境	19,900	124,972.00	0.25
155	688358	祥生医疗	4,797	124,578.09	0.25
156	300348	长亮科技	18,200	124,124.00	0.24
157	002646	天佑德酒	11,900	121,737.00	0.24
158	300718	长盛轴承	8,800	121,616.00	0.24
159	688362	甬矽电子	6,095	118,608.70	0.23
160	002948	青岛银行	34,900	117,613.00	0.23
161	601126	四方股份	6,000	115,320.00	0.23
162	601155	新城控股	13,000	115,310.00	0.23
163	603733	仙鹤股份	6,400	112,512.00	0.22
164	603612	索通发展	8,800	112,288.00	0.22
165	600596	新安股份	14,600	110,960.00	0.22
166	603229	奥翔药业	11,000	110,550.00	0.22
167	002558	巨人网络	11,700	110,448.00	0.22
168	600966	博汇纸业	22,800	108,984.00	0.21
169	002895	川恒股份	5,919	108,376.89	0.21
170	600861	北京人力	6,500	106,080.00	0.21
171	688510	航亚科技	5,582	102,764.62	0.20
172	300035	中科电气	12,000	102,120.00	0.20
173	300232	洲明科技	19,300	100,746.00	0.20
174	300973	立高食品	3,500	98,315.00	0.19
175	002803	吉宏股份	8,800	97,944.00	0.19
176	002961	瑞达期货	8,500	93,075.00	0.18
177	002533	金杯电工	9,300	92,535.00	0.18
178	300662	科锐国际	5,700	91,941.00	0.18
179	600266	城建发展	24,500	91,630.00	0.18
180	002292	奥飞娱乐	14,900	89,102.00	0.18
181	300218	安利股份	5,900	88,972.00	0.18
182	002152	广电运通	8,500	88,910.00	0.18
183	688252	天德钰	6,095	88,560.35	0.17
184	600737	中粮糖业	8,500	81,515.00	0.16
185	600929	雪天盐业	15,300	81,090.00	0.16
186	600459	贵研铂业	5,900	79,709.00	0.16
187	300596	利安隆	2,900	78,677.00	0.16
188	002068	黑猫股份	11,000	78,100.00	0.15
189	002978	安宁股份	2,800	78,008.00	0.15
190	000997	新大陆	5,500	76,505.00	0.15

191	300529	健帆生物	2,800	76,188.00	0.15
192	300251	光线传媒	8,900	74,849.00	0.15
193	000059	华锦股份	17,600	73,744.00	0.15
194	601890	亚星锚链	10,300	72,615.00	0.14
195	300855	图南股份	2,700	71,388.00	0.14
196	002015	协鑫能科	8,400	66,864.00	0.13
197	002182	宝武镁业	5,840	65,875.20	0.13
198	600901	江苏金租	12,800	64,640.00	0.13
199	300406	九强生物	4,200	64,596.00	0.13
200	002701	奥瑞金	15,100	62,816.00	0.12
201	002276	万马股份	8,500	60,945.00	0.12
202	600587	新华医疗	3,840	60,441.60	0.12
203	002643	万润股份	5,700	57,000.00	0.11
204	002410	广联达	5,900	56,522.00	0.11
205	301015	百洋医药	2,400	56,472.00	0.11
206	688046	药康生物	5,500	56,210.00	0.11
207	688186	广大特材	5,570	54,196.10	0.11
208	603171	税友股份	2,000	54,080.00	0.11
209	605555	德昌股份	2,900	53,969.00	0.11
210	688033	天宜上佳	8,863	53,178.00	0.10
211	300737	科顺股份	12,300	52,890.00	0.10
212	002911	佛燃能源	5,229	47,793.06	0.09
213	300815	玉禾田	4,100	47,724.00	0.09
214	603906	龙蟠科技	6,100	47,519.00	0.09
215	300181	佐力药业	2,900	43,848.00	0.09
216	002649	博彦科技	5,500	43,780.00	0.09
217	600223	鲁商发展	6,100	43,127.00	0.09
218	600705	中航产融	19,300	42,846.00	0.08
219	600988	赤峰黄金	2,600	42,484.00	0.08
220	603323	苏农银行	8,500	40,885.00	0.08
221	002206	海利得	10,400	39,728.00	0.08
222	300036	超图软件	2,800	39,088.00	0.08
223	002585	双星新材	7,800	38,688.00	0.08
224	300384	三联虹普	2,900	38,048.00	0.08
225	600057	厦门象屿	5,500	37,400.00	0.07
226	002918	蒙娜丽莎	4,000	36,240.00	0.07
227	300398	飞凯材料	2,900	35,670.00	0.07
228	300115	长盈精密	2,900	34,771.00	0.07
229	600835	上海机电	3,000	34,530.00	0.07
230	603033	三维股份	2,700	31,590.00	0.06
231	300755	华致酒行	2,300	31,418.00	0.06
232	601311	骆驼股份	3,900	31,278.00	0.06
233	002020	京新药业	2,900	30,363.00	0.06

234	300772	运达股份	2,900	27,840.00	0.05
235	300562	乐心医疗	3,000	26,730.00	0.05
236	600449	宁夏建材	2,100	24,675.00	0.05
237	000567	海德股份	4,205	23,590.05	0.05
238	002745	木林森	2,900	23,374.00	0.05
239	002233	塔牌集团	2,900	21,199.00	0.04
240	600201	生物股份	2,600	18,746.00	0.04
241	002035	华帝股份	2,900	18,067.00	0.04
242	601636	旗滨集团	2,000	12,900.00	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	688016	心脉医疗	970,219.42	1.26
2	300002	神州泰岳	831,301.00	1.08
3	000951	中国重汽	800,606.00	1.04
4	002906	华阳集团	734,676.00	0.95
5	000090	天健集团	730,268.00	0.95
6	300559	佳发教育	670,816.00	0.87
7	300857	协创数据	667,661.00	0.87
8	688318	财富趋势	640,399.32	0.83
9	300685	艾德生物	627,979.00	0.82
10	688213	思特威	627,972.72	0.82
11	300428	立中集团	614,753.00	0.80
12	300119	瑞普生物	578,515.00	0.75
13	002991	甘源食品	554,677.00	0.72
14	300109	新开源	552,739.00	0.72
15	300623	捷捷微电	546,203.00	0.71
16	688018	乐鑫科技	534,596.66	0.69
17	002612	朗姿股份	515,346.00	0.67
18	000672	上峰水泥	511,372.48	0.66
19	000923	河钢资源	506,862.00	0.66
20	002158	汉钟精机	503,693.00	0.65

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	300394	天孚通信	1,248,323.00	1.62
2	300693	盛弘股份	1,076,760.21	1.40
3	000923	河钢资源	998,704.00	1.30
4	002990	盛视科技	922,428.34	1.20
5	000951	中国重汽	855,888.00	1.11
6	300130	新国都	826,977.00	1.07
7	000921	海信家电	773,673.00	1.00
8	002991	甘源食品	770,085.00	1.00
9	301153	中科江南	720,450.00	0.94
10	300860	锋尚文化	692,770.20	0.90
11	002612	朗姿股份	687,684.00	0.89
12	000935	四川双马	687,382.00	0.89
13	300109	新开源	686,227.00	0.89
14	300476	胜宏科技	670,294.59	0.87
15	002318	久立特材	657,280.00	0.85
16	300638	广和通	634,017.00	0.82
17	002158	汉钟精机	631,539.00	0.82
18	002335	科华数据	611,424.00	0.79
19	000521	长虹美菱	608,933.00	0.79
20	000528	柳工	603,950.00	0.78

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	65,231,499.31
卖出股票收入（成交）总额	75,808,789.40

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间因市场流动性较差或者股指期货贴水较大时，我们有使用股指期货套保调整或保持仓位。

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	359,510.24
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	434,919.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,180	52,118.34	40,053,435.00	65.13	21,446,210.00	34.87

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	方正证券股份有限公司	7,797,280.00	12.68
2	太平洋资管—工商银行—太平洋卓越八十三号产品	7,453,200.00	12.12
3	中国银河证券股份有限公司	7,025,000.00	11.42
4	太平洋资管—工商银行—太平洋卓越八十六号产品	6,518,900.00	10.60
5	中信证券股份有限公司	2,500,515.00	4.07
6	大连保税区盛洋石化有限公司	2,000,000.00	3.25
7	华泰证券股份有限公司	1,612,838.00	2.62
8	深圳市前海禾丰正则资产管理有限公司—禾丰多元投资一期私募证券投资基金	1,443,500.00	2.35
9	中国国际金融股份有限公司	1,257,290.00	2.04
10	张盛田	1,050,000.00	1.71

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研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（2022年11月23日） 基金份额总额	298,999,645.00
本报告期期初基金份额总额	83,999,645.00
本报告期基金总申购份额	60,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	82,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	61,499,645.00

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

2024年1月19日，公司股东会书面决定尹雷先生担任公司独立董事，陆楨女士不再担任公司独立董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	2	58,283,694.61	41.32	50,585.18	40.62	-
海通证券	2	47,166,479.83	33.44	44,143.25	35.45	-
银河证券	2	23,535,768.86	16.69	18,525.59	14.88	-
华泰证券	1	12,054,345.41	8.55	11,282.12	9.06	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期内：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

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(%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	144,980.85	89.01	-	-	-	-
华泰证券	17,901.25	10.99	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024年06月25日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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
3	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
4	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
5	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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日