

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券  
投资基金  
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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	20
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
8.3 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 .....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	80
8.6 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 .....	80
8.7 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 .....	80
8.8 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 .....	80
8.9 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 .....	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12 投资组合报告附注 .....	81
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>82</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	82
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
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 .....	83
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>83</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>83</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	83
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 .....	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4 基金投资策略的改变 .....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
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 .....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	84
11.8 其他重大事件 .....	86
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>88</b>
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 .....	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	88
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>89</b>
13.1 备查文件目录 .....	89
13.2 存放地点 .....	89
13.3 查阅方式 .....	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 1000
场内简称	中证 1000 (扩位证券简称: 中证 1000ETF 华泰柏瑞)
基金主代码	516300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,012,592.00 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	2021 年 3 月 24 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内, 年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	1、股票的投资策略; 2、存托凭证的投资策略; 3、债券投资策略; 4、股指期货的投资策略; 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
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	韩鑫普
	联系电话	021-38601777	0755-82943666
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95565
传真		021-38601799	0755-82960794
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

邮政编码	200135	518000
法定代表人	贾波	霍达

## 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

## 2.5 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
本期已实现收益	11,846,318.33	-2,028,509.73	-9,404,893.50
本期利润	24,875,905.37	-407,450.95	-24,514,078.93
加权平均基金份额本期利润	0.1732	-0.0030	-0.2276
本期加权平均净值利润率	17.12%	-0.29%	-21.29%
本期基金份额净值增长率	4.93%	-3.41%	-20.85%
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	2,815,138.00	-4,535,440.78	416,709.35
期末可供分配基金份额利润	0.0386	-0.0315	0.0027
期末基金资产净值	175,961,635.75	139,566,741.22	157,018,891.35
期末基金份额净值	2.4100	0.9685	1.0027

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	1.62%	-3.15%	0.27%

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。

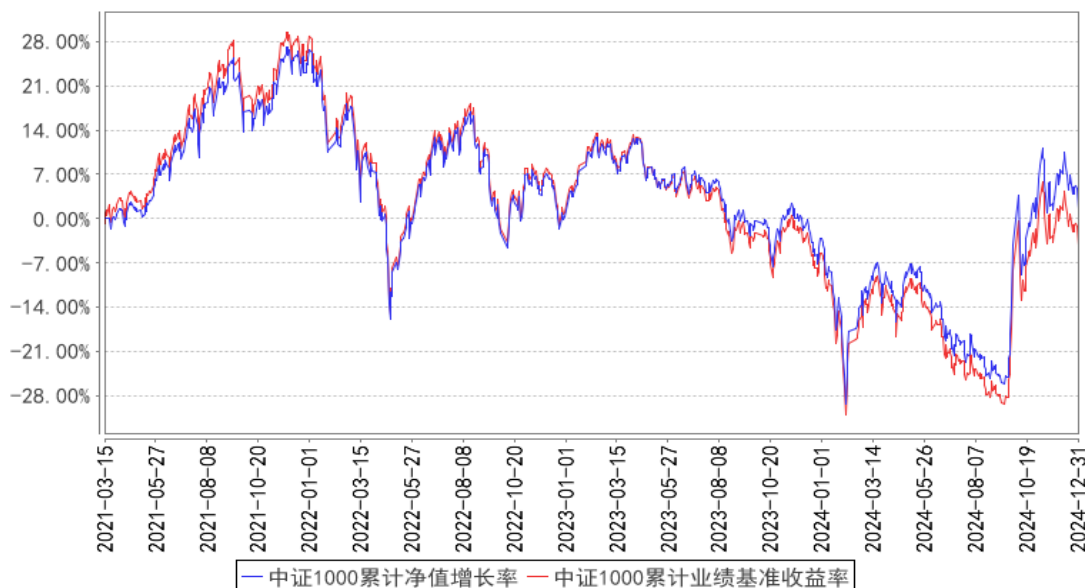
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	6.11%	2.35%	4.36%	2.40%	1.75%	-0.05%
过去六个月	24.40%	2.21%	21.69%	2.24%	2.71%	-0.03%
过去一年	4.93%	2.09%	1.20%	2.12%	3.73%	-0.03%
过去三年	-19.79%	1.60%	-25.62%	1.62%	5.83%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.62%	1.50%	-4.22%	1.53%	5.84%	-0.03%

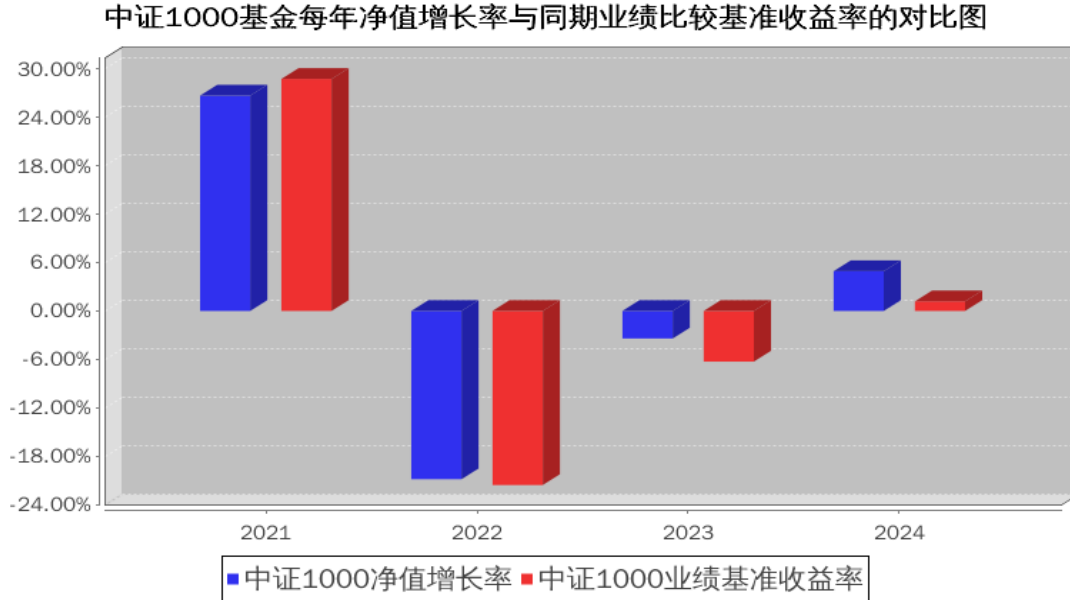
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中证1000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 2021 年 3 月 15 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：本基金合同自 2021 年 3 月 15 日起生效，2021 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		
李茜	本基金的基金经理	2021 年 3 月 15 日	-	9 年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 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。2019



				<p>年 11 月至 2022 年 12 月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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 11 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。2020 年 12 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、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任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 2 月至 2024 年 5 月任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土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 1000 交易型开放式指数证券投资基金和华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞中证港股通 50 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。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利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 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资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沪港深云计算产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 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利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 3 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月起任华泰柏瑞中证 A50</p>
--	--	--	--	---

					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 9 月起任华泰柏瑞恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞恒生创新药交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金的基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
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。

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。李茜 2025 年 1 月 23 日离任本基金基金经理。柳叶青 2025 年 1 月 23 日离任本基金基金经理助理。

#### 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。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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。

## 4.4 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

本基金以完全复制中证 1000 指数为投资策略，产品回报主要取决于标的指数收益。2024 年宏观基本面恢复较慢，市场一度持续缩量下行，9 月末之后迅速抬升，中证 1000 全年小幅上行 1.20%。产品规模以全年维度看相对稳固，我们严格遵守合同约定，以紧密跟踪标的指数、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 0.038%，期间日跟踪误差为 0.059%，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 2.4100 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.93%，业绩比较基准收益率为 1.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场的主要影响因素来自三个方面，一是基本面的修复进度，二是地缘政治关系，三是 DeepSeek 出现后 AI 的竞争与应用端的发展状况，三者在不同阶段影响的权重可能变化。9 月政治局会议后，政策加码，经济大盘有所稳固，虽然至今修复斜率仍然相对平缓，但随政策效果逐步

落地、信心逐步回暖，修复斜率有望回升。地缘上面临一定的不确定性，截至目前，未有超预期负向的事件发生，考虑到竞争对手内部也面临掣肘，且近几年我们也积攒了较多的应对经验，其影响或相对可控。DeepSeek 的出现除了拔高了相关产业链的预期，也一定程度缓解了科技战上落后的担忧，进一步夯实了整体信心。

回到权益市场，去年 9 月之后市场发生本质变化，成交显著活跃，年内经济大盘的修复有望带动企业盈利的回升，在这样的视角下，当前全 A 维度或仍处于投资价值较高的区间，沪深 300、中证 500、中证 1000 等宽基指数具备整体的配置价值。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金可分配收益为 2,815,138.00 元。

#### 4.9 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，招商证券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关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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_B14 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，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。 我们认为，后附的华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金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 1000 交易型开放式指数证券投资基金 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。
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 1000 交易型开放式指数证券投资基金，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 1000 交易型开放式指数证券投资基金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。 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。 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。

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，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。</p> <p>治理层负责监督华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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 1000 交易型开放式指数证券投资基金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 1000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（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。</p> <p>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。</p>

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 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	6,214,132.20	3,094,850.07
结算备付金		3,255,276.66	303,884.41
存出保证金		1,273,176.42	408,001.06
交易性金融资产	7.4.7.2	165,627,047.65	136,056,061.71
其中：股票投资		165,627,047.65	136,011,358.63
基金投资		-	-
债券投资		-	44,703.08
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		-	228,716.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		176,369,632.93	140,091,514.06
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		7,905.90	870.40



衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		73,152.60	60,234.05
应付托管费		14,630.50	12,046.83
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		52,829.64	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	259,478.54	451,621.56
负债合计		407,997.18	524,772.84
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	173,146,497.75	144,102,182.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,815,138.00	-4,535,440.78
净资产合计		175,961,635.75	139,566,741.22
负债和净资产总计		176,369,632.93	140,091,514.06

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.4100 元，基金份额总额 73,012,592.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		26,106,450.22	789,212.25
1. 利息收入		137,030.42	53,377.31
其中：存款利息收入	7.4.7.13	137,030.42	53,377.31
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）		12,315,351.05	-1,290,885.46
其中：股票投资收益	7.4.7.14	8,719,320.20	-2,802,442.23
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.15	15,392.57	122,867.64
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	1,947,887.64	-61.62
股利收益	7.4.7.19	1,632,750.64	1,388,750.75
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）	7.4.7.20	13,029,587.04	1,621,058.78
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	624,481.71	405,661.62
<b>减：二、营业总支出</b>		1,230,544.85	1,196,663.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	740,016.30	713,885.95
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	148,003.24	142,777.16
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		7,018.46	0.09
8. 其他费用	7.4.7.23	335,506.85	340,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		24,875,905.37	-407,450.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		24,875,905.37	-407,450.95
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		24,875,905.37	-407,450.95

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	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	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	29,044,315.75	-	7,350,578.78	36,394,894.53
(一)、综合收益总额	-	-	24,875,905.37	24,875,905.37
(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)	29,044,315.75	-	-17,525,326.59	11,518,989.16
其中：1. 基金申购款	545,374,432.77	-	-57,664,948.04	487,709,484.73
2. 基金赎回款	-516,330,117.02	-	40,139,621.45	-476,190,495.57
(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	173,146,497.75	-	2,815,138.00	175,961,635.75
项目	上年度可比期间			
	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	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,500,000.00	-	-4,952,150.13	-17,452,150.13
(一)、综合收益总额	-	-	-407,450.95	-407,450.95
(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)	-12,500,000.00	-	-4,544,699.18	-17,044,699.18
其中：1. 基金申购款	195,000,000.00	-	4,446,399.17	199,446,399.17
2. 基金赎回款	-207,500,000.00	-	-8,991,098.35	-216,491,098.35
(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	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22

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 1000 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[2021]第 235 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 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 222,600,550.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0294 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,602,182.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,632.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]118 号核准,本基金 222,602,182.00 份基金份额于 2021 年 3 月 24 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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的比例不得低于基金资产净值的 90%,且不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;本基金参与融资业务时,在任何交易日日终,持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内,年化跟踪误差控制在 2%以内。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 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商业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商业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。

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；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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 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。

#### 7.4.4.13 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[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。

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	6,214,132.20	3,094,850.07
等于：本金	6,211,087.26	3,093,343.08
加：应计利息	3,044.94	1,506.99
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	6,214,132.20	3,094,850.07

#### 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	162,074,230.21	-	165,627,047.65	3,552,817.44
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	162,074,230.21	-	165,627,047.65	3,552,817.44
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	145,690,236.23	-	136,011,358.63	-9,678,877.60
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	44,700.00	3.08	44,703.08
	银行间市场	-	-	-
	合计	44,700.00	3.08	44,703.08
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	145,734,936.23	3.08	136,056,061.71	-9,678,877.60

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	8,481,480.00	-	-	-
其中：股指期货投资	8,481,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,481,480.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,384,800.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,384,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,384,800.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 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
IM2503	中证1000股指期货 2503	7.00	8,233,960.00	-247,520.00
合计				-247,520.00
减：可抵销期货暂收款				-247,520.00
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。

#### 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投资。

##### 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投资。

#### 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 2024年12月31日	上年度末 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	69,478.54	99,896.45

其中：交易所市场	69,478.54	99,896.45
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	190,000.00	230,000.00
应退退补款	-	121,725.11
合计	259,478.54	451,621.56

#### 7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	144,102,182.00	144,102,182.00
本期申购	460,000,000.00	460,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-402,500,000.00	-402,500,000.00
2024年10月25日基金拆分/ 份额折算前	201,602,182.00	201,602,182.00
基金拆分/份额折算调整	-116,591,435.00	-
本期申购	36,001,845.00	85,374,432.77
本期赎回（以“-”号填列）	-48,000,000.00	-113,830,117.02
本期末	73,012,592.00	173,146,497.75

注：1、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。

2、本基金已于2024年10月25日进行了基金份额合并，合并比例为0.42167573。

#### 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	907,641.82	-5,443,082.60	-4,535,440.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	907,641.82	-5,443,082.60	-4,535,440.78
本期利润	11,846,318.33	13,029,587.04	24,875,905.37
本期基金份额交易产生的 变动数	-854,142.83	-16,671,183.76	-17,525,326.59
其中：基金申购款	-17,488,910.76	-40,176,037.28	-57,664,948.04
基金赎回款	16,634,767.93	23,504,853.52	40,139,621.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,899,817.32	-9,084,679.32	2,815,138.00



### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	92,830.10	47,507.56
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	40,848.76	3,406.96
其他	3,351.56	2,462.79
合计	137,030.42	53,377.31

### 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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	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	8,390,339.58	-445,599.03
股票投资收益——赎回 差价收入	328,980.62	-2,356,843.20
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	8,719,320.20	-2,802,442.23

#### 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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	337,977,960.09	174,434,427.83
减：卖出股票成本总额	329,060,412.85	174,389,977.34
减：交易费用	527,207.66	490,049.52
买卖股票差价收入	8,390,339.58	-445,599.03

### 7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	476,190,495.57	216,491,098.35
减：现金支付赎回款总额	302,179,093.57	141,356,280.35
减：赎回股票成本总额	173,682,421.38	77,491,661.20
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	328,980.62	-2,356,843.20

### 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 债券投资收益

#### 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	29.62	89.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,362.95	122,778.11
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	15,392.57	122,867.64

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,404.26	574,998.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	188,000.00	452,100.00
减：应计利息总额	33.23	97.53
减：交易费用	8.08	23.01
买卖债券差价收入	15,362.95	122,778.11

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 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。

##### 7.4.7.16.3 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。

##### 7.4.7.16.4 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。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 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。

##### 7.4.7.17.2 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。

##### 7.4.7.17.3 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。

##### 7.4.7.17.4 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。

### 7.4.7.18 衍生工具收益

#### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.18.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股指期货投资收益	1,947,887.64	-61.62

### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利 收益	1,632,750.64	1,388,750.75
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	1,632,750.64	1,388,750.75

### 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	13,231,695.04	1,667,218.78
股票投资	13,231,695.04	1,671,672.78
债券投资	-	-4,454.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-201,360.00	-46,160.00
权证投资	-	-
期货投资	-201,360.00	-46,160.00
3. 其他	-748.00	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	13,029,587.04	1,621,058.78

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	624,481.71	405,661.62
合计	624,481.71	405,661.62

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。

### 7.4.7.22 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。

### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
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	15,506.85	20,000.00
合计	335,506.85	340,000.00

## 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
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人、申购赎回代理券商、基金销售机构
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
------------------------	--------------------

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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 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 (%)
招商证券	695,248,891.01	100.00	340,771,177.20	100.00

###### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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 (%)
招商证券	203,404.26	100.00	574,998.65	100.00

###### 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 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。

###### 7.4.10.1.5 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 (%)
招商证券	313,606.52	100.00	69,478.54	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
招商证券	316,502.74	100.00	99,896.45	100.00

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	740,016.30	713,885.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,158.59	14,124.46
应支付基金管理人的净管理费	724,857.71	699,761.49

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

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	148,003.24	142,777.16

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

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

#### 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 2024年12月31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	944,656.00	1.2938	3,172,400.00	2.2015

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

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 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	688726	拉普拉斯	网下申购	7,527	132,324.66
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	479	13,900.58
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	6,424	72,526.96
招商证券	301631	壹连科技	网下申购	711	51,895.89
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	2,252	50,354.72
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	1,559	33,877.07
上年度可比期间					



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	127100	神码转债	网上配售	217	21,700.00
华泰联合证券	113674	华设转债	网上配售	60	6,000.00
华泰联合证券	123208	孩王转债	网上配售	66	6,600.00
华泰联合证券	123188	水羊转债	网上配售	98	9,800.00
华泰联合证券	127084	柳工转 2	网上配售	361	36,100.00
华泰联合证券	113666	爱玛转债	网上配售	140	14,000.00
招商证券	113679	芯能转债	网上配售	110	11,000.00
招商证券	127088	赫达转债	网上配售	58	5,800.00
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	3,582	58,171.68
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	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,156	18,380.40
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	2,667	55,793.64
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	18,353	104,428.57
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	6,747	74,891.70
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	1,313	55,736.85
华泰联合证券	301487	盟固利	网下申购	5,984	31,834.88
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	1,968	37,785.60
华泰联合证券	688602	康鹏科技	网下申购	2,752	23,832.32
华泰联合证券	301421	波长光电	网下申购	1,264	37,136.32
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	3,683	32,778.70
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,009	33,549.25
招商证券	301428	世纪恒通	网下申购	1,430	37,680.50
招商证券	301305	朗坤环境	网下申购	2,549	64,362.25
招商证券	688610	埃科光电	网下申购	759	55,657.47

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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	1,243	2,858.90	8,452.40	-
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	新股锁定期内	6.88	24.84	543	3,735.84	13,488.12	-
301551	无线传媒	2024年9月19日	6个月	新股锁定期内	9.40	43.23	616	5,790.40	26,629.68	-
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	272	3,030.08	11,105.76	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股锁定期内	23.95	35.85	183	4,382.85	6,560.55	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新股锁定期内	18.09	53.14	180	3,256.20	9,565.20	-
301607	富特科技	2024年8月28日	6个月	新股锁定期内	14.00	36.14	254	3,556.00	9,179.56	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股锁定期内	8.00	56.10	406	3,248.00	22,776.60	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股锁定期内	27.70	41.77	169	4,681.30	7,059.13	-
301617	博	2024	6个月	新股	27.76	39.79	155	4,302.80	6,167.45	-

	苑股份	年 12 月 3 日		锁定期内						
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	22.36	44.92	226	5,053.36	10,151.92	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	21.23	65.78	706	14,988.38	46,440.68	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	72.99	101.96	72	5,255.28	7,341.12	-
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	1,187	14,600.10	14,600.10	-
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	132	1,623.60	1,623.60	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	20.32	28.13	122	2,479.04	3,431.86	-
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	-
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	718	8,077.50	21,137.92	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	11.29	53.68	643	7,259.47	34,516.24	-
688708	佳	2024	6 个月	新股	27.08	48.95	307	8,313.56	15,027.65	-

	驰科技	年 11 月 27 日		锁定期内						
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	17.58	33.06	753	13,237.74	24,894.18	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	7.16	15.44	1,139	8,155.24	17,586.16	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔生物	2024 年 12 月 23 日	重要公告	35.20	2025 年 1 月 7 日	30.60	4,656	167,222.60	163,891.20	-

注：本基金截至 2024 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重要公告可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.12.4 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%)。

#### 7.4.13.3 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 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。

##### 7.4.13.3.1 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 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 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	6,214,132.20	-	-	-	-	-	6,214,132.20
结算备付金	3,255,276.66	-	-	-	-	-	3,255,276.66

存出保证金	285,101.22	-	-	-	-	988,075.20	1,273,176.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-165,627,047.65	165,627,047.65
资产总计	9,754,510.08	-	-	-	-	-166,615,122.85	176,369,632.93
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	7,905.90	7,905.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,152.60	73,152.60
应付托管费	-	-	-	-	-	14,630.50	14,630.50
应交税费	-	-	-	-	-	52,829.64	52,829.64
其他负债	-	-	-	-	-	259,478.54	259,478.54
负债总计	-	-	-	-	-	407,997.18	407,997.18
利率敏感度缺口	9,754,510.08	-	-	-	-	-166,207,125.67	175,961,635.75
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	3,094,850.07	-	-	-	-	-	3,094,850.07
结算备付金	303,884.41	-	-	-	-	-	303,884.41
存出保证金	127,364.26	-	-	-	-	280,636.80	408,001.06
交易性金融资产	-	-	-23,001.51	21,701.57	136,011,358.63	136,056,061.71	
应收清算款	-	-	-	-	-	228,716.81	228,716.81
资产总计	3,526,098.74	-	-23,001.51	21,701.57	136,520,712.24	140,091,514.06	
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	870.40	870.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	60,234.05	60,234.05
应付托管费	-	-	-	-	-	12,046.83	12,046.83
其他负债	-	-	-	-	-	451,621.56	451,621.56
负债总计	-	-	-	-	-	524,772.84	524,772.84
利率敏感度缺口	3,526,098.74	-	-23,001.51	21,701.57	135,995,939.40	139,566,741.22	

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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：0.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023年12月31日：同)。



7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 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	165,627,047.65	94.13	136,011,358.63	97.45
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	-7,905.90	-0.00	-870.40	0.00
合计	165,619,141.75	94.12	136,010,488.23	97.45

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下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。

7.4.13.4.3.2 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%	8,579,533.75	6,767,650.86
	业绩比较基准下降 5%	-8,579,533.75	-6,767,650.86

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	165,113,248.69	135,438,421.92
第二层次	180,114.90	354,014.54
第三层次	333,684.06	263,625.25
合计	165,627,047.65	136,056,061.71

###### 7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 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 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	-	263,625.25	263,625.25
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	182,946.05	182,946.05
转出第三层次	-	335,467.34	335,467.34
当期利得或损失总额	-	222,580.10	222,580.10
其中：计入损益的利得或损失	-	222,580.10	222,580.10
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	333,684.06	333,684.06
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	-	212,481.30	212,481.30
项目	上年度可比期间 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	-	392,896.85	392,896.85
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	617,183.59	617,183.59
转出第三层次	-	1,150,796.81	1,150,796.81
当期利得或损失总额	-	404,341.62	404,341.62
其中：计入损益的利得或损失	-	404,341.62	404,341.62
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	263,625.25	263,625.25
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	75,599.58	75,599.58

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。

#### 7.4.14.2.3.2 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	333,684.06	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.4607~5.7444	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
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	263,625.25	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1969~2.1752	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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 487,709,484.73 元(2023 年度：199,446,399.17 元)，其中包括以股票支付的申购款 160,255,277.99 元和以现金支付的申购款 327,454,206.74 元(2023 年度：其中包括以股票支付的申购款 58,057,132.05 元和以现金支付的申购款 141,389,267.12 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	165,627,047.65	93.91
	其中：股票	165,627,047.65	93.91
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	9,469,408.86	5.37
8	其他各项资产	1,273,176.42	0.72
9	合计	176,369,632.93	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	1,079,204.60	0.61
B	采矿业	4,075,446.04	2.32
C	制造业	106,752,539.41	60.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,593,776.94	2.61
E	建筑业	2,828,005.60	1.61
F	批发和零售业	5,131,918.16	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	5,340,941.00	3.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,342,219.70	10.99
J	金融业	4,660,508.33	2.65
K	房地产业	2,673,062.00	1.52
L	租赁和商务服务业	3,177,979.76	1.81
M	科学研究和技术服务业	1,242,915.83	0.71

N	水利、环境和公共设施管理业	1,282,700.50	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	540,614.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	1,976,980.00	1.12
S	综合	-	-
	合计	164,698,811.87	93.60

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	753,263.21	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	111,438.62	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,533.95	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	928,235.78	0.53

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 8.2.3 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。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	002456	欧菲光	85,900	1,029,082.00	0.58
2	002130	沃尔核材	26,400	666,600.00	0.38
3	002851	麦格米特	10,400	639,184.00	0.36
4	300757	罗博特科	2,800	630,896.00	0.36
5	002405	四维图新	61,800	595,752.00	0.34
6	600171	上海贝岭	14,600	579,328.00	0.33
7	300346	南大光电	14,900	574,991.00	0.33
8	688608	恒玄科技	1,655	538,487.35	0.31
9	000528	柳工	41,200	496,872.00	0.28
10	603005	晶方科技	16,956	479,007.00	0.27
11	600363	联创光电	9,600	459,648.00	0.26
12	002837	英维克	11,314	457,085.60	0.26
13	001696	宗申动力	17,800	443,220.00	0.25
14	688027	国盾量子	1,477	440,677.72	0.25
15	002139	拓邦股份	32,300	439,603.00	0.25
16	300458	全志科技	11,300	437,988.00	0.25
17	300623	捷捷微电	12,800	437,248.00	0.25
18	002402	和而泰	24,100	436,451.00	0.25
19	600100	同方股份	61,200	435,132.00	0.25
20	002312	川发龙蟒	29,700	429,759.00	0.24
21	688235	百济神州	2,644	425,736.88	0.24
22	000415	渤海租赁	112,400	423,748.00	0.24
23	300085	银之杰	11,000	420,750.00	0.24
24	300459	汤姆猫	73,100	419,594.00	0.24
25	300088	长信科技	63,500	415,290.00	0.24
26	605589	圣泉集团	17,600	415,008.00	0.24
27	300857	协创数据	3,800	406,182.00	0.23
28	002126	银轮股份	21,600	404,352.00	0.23
29	002583	海能达	28,300	402,143.00	0.23
30	600559	老白干酒	18,800	394,612.00	0.22
31	000766	通化金马	25,100	394,070.00	0.22
32	300679	电连技术	6,600	394,020.00	0.22
33	300315	掌趣科技	71,200	391,600.00	0.22
34	601677	明泰铝业	32,160	386,884.80	0.22
35	688347	华虹公司	8,224	382,169.28	0.22
36	000099	中信海直	14,000	369,040.00	0.21

37	300068	南都电源	22,700	366,378.00	0.21
38	002400	省广集团	45,300	361,947.00	0.21
39	688037	芯源微	4,318	361,114.34	0.21
40	300077	国民技术	15,100	359,984.00	0.20
41	688568	中科星图	7,044	359,455.32	0.20
42	601777	力帆科技	46,900	358,785.00	0.20
43	688116	天奈科技	9,088	352,705.28	0.20
44	002497	雅化集团	30,000	351,000.00	0.20
45	300762	上海瀚讯	16,320	343,209.60	0.20
46	300627	华测导航	8,200	342,760.00	0.19
47	300115	长盈精密	21,100	342,664.00	0.19
48	300779	惠城环保	3,500	341,600.00	0.19
49	300568	星源材质	34,800	338,256.00	0.19
50	300296	利亚德	52,400	337,456.00	0.19
51	688018	乐鑫科技	1,547	337,246.00	0.19
52	300229	拓尔思	16,000	335,040.00	0.19
53	688050	爱博医疗	3,668	333,898.04	0.19
54	600072	中船科技	23,500	330,175.00	0.19
55	002176	江特电机	44,500	329,745.00	0.19
56	002389	航天彩虹	18,100	326,705.00	0.19
57	300182	捷成股份	55,400	325,198.00	0.18
58	300253	卫宁健康	45,300	324,348.00	0.18
59	002506	协鑫集成	121,400	324,138.00	0.18
60	002222	福晶科技	9,910	321,084.00	0.18
61	002245	蔚蓝锂芯	30,000	320,700.00	0.18
62	300666	江丰电子	4,600	319,470.00	0.18
63	688343	云天励飞	6,430	318,928.00	0.18
64	600577	精达股份	43,700	318,573.00	0.18
65	002416	爱施德	19,500	317,265.00	0.18
66	601975	招商南油	100,900	315,817.00	0.18
67	300170	汉得信息	25,200	312,480.00	0.18
68	603236	移远通信	4,554	311,675.76	0.18
69	601375	中原证券	71,800	310,176.00	0.18
70	002617	露笑科技	40,200	307,530.00	0.17
71	688266	泽璟制药	4,912	306,066.72	0.17
72	600323	瀚蓝环境	12,900	304,698.00	0.17
73	601333	广深铁路	88,300	302,869.00	0.17
74	002003	伟星股份	21,100	298,987.00	0.17
75	002145	中核钛白	70,290	298,029.60	0.17
76	605111	新洁能	8,746	296,576.86	0.17
77	600446	金证股份	17,100	294,804.00	0.17
78	002151	北斗星通	11,100	294,594.00	0.17
79	300432	富临精工	19,100	293,758.00	0.17



80	300738	奥飞数据	20,172	292,494.00	0.17
81	000875	吉电股份	55,300	290,878.00	0.17
82	300570	太辰光	4,000	290,800.00	0.17
83	688019	安集科技	2,079	289,729.44	0.16
84	000686	东北证券	36,300	288,222.00	0.16
85	601528	瑞丰银行	50,970	286,961.10	0.16
86	600601	XR*ST 方	65,200	286,228.00	0.16
87	300045	华力创通	13,700	286,193.00	0.16
88	600761	安徽合力	16,200	285,930.00	0.16
89	002075	沙钢股份	45,600	285,456.00	0.16
90	300674	宇信科技	14,600	284,992.00	0.16
91	603083	剑桥科技	7,000	284,200.00	0.16
92	600331	宏达股份	37,100	282,702.00	0.16
93	300083	创世纪	43,300	281,883.00	0.16
94	000581	威孚高科	14,900	281,312.00	0.16
95	002807	江阴银行	64,000	278,400.00	0.16
96	300735	光弘科技	9,900	277,101.00	0.16
97	300181	佐力药业	18,000	276,480.00	0.16
98	688208	道通科技	7,032	275,373.12	0.16
99	600216	浙江医药	17,300	274,378.00	0.16
100	000628	高新发展	4,400	274,076.00	0.16
101	002698	博实股份	16,000	272,000.00	0.15
102	600388	ST 龙净	21,500	271,975.00	0.15
103	002936	郑州银行	128,400	269,640.00	0.15
104	600908	无锡银行	45,600	269,496.00	0.15
105	000681	视觉中国	12,900	268,578.00	0.15
106	002484	江海股份	15,200	267,216.00	0.15
107	300035	中科电气	17,800	266,110.00	0.15
108	601222	林洋能源	37,600	265,832.00	0.15
109	600186	莲花健康	46,500	265,050.00	0.15
110	600667	太极实业	38,300	265,036.00	0.15
111	600602	云赛智联	16,700	264,194.00	0.15
112	688183	生益电子	6,724	263,984.24	0.15
113	300777	中简科技	9,300	263,097.00	0.15
114	002701	奥瑞金	46,400	263,088.00	0.15
115	000860	顺鑫农业	13,500	262,845.00	0.15
116	000917	电广传媒	37,000	261,590.00	0.15
117	000970	中科三环	25,200	261,324.00	0.15
118	002036	联创电子	27,800	261,320.00	0.15
119	600562	国睿科技	13,100	261,083.00	0.15
120	600728	佳都科技	55,700	260,676.00	0.15
121	688327	云从科技	21,467	259,750.70	0.15
122	002249	大洋电机	44,100	258,867.00	0.15

123	300438	鹏辉能源	9,200	258,612.00	0.15
124	600133	东湖高新	27,600	258,060.00	0.15
125	002428	云南锗业	13,600	257,040.00	0.15
126	600452	涪陵电力	24,086	255,070.74	0.14
127	600338	西藏珠峰	23,900	255,013.00	0.14
128	300773	拉卡拉	14,400	254,880.00	0.14
129	600285	羚锐制药	11,500	254,840.00	0.14
130	000951	中国重汽	15,000	254,700.00	0.14
131	600850	电科数字	10,620	253,818.00	0.14
132	300672	国科微	3,800	253,650.00	0.14
133	000690	宝新能源	56,500	253,120.00	0.14
134	002747	埃斯顿	13,600	251,600.00	0.14
135	300101	振芯科技	11,600	251,256.00	0.14
136	000422	湖北宜化	19,900	251,138.00	0.14
137	688676	金盘科技	6,055	250,798.10	0.14
138	300133	华策影视	34,600	249,812.00	0.14
139	688322	奥比中光	5,369	249,658.50	0.14
140	300303	聚飞光电	36,600	249,612.00	0.14
141	300624	万兴科技	3,937	248,621.55	0.14
142	300827	上能电气	5,659	248,430.10	0.14
143	300525	博思软件	15,900	247,722.00	0.14
144	603871	嘉友国际	12,800	247,680.00	0.14
145	601137	博威合金	12,200	247,660.00	0.14
146	300775	三角防务	9,900	246,807.00	0.14
147	600120	浙江东方	52,900	246,514.00	0.14
148	600064	南京高科	31,500	244,755.00	0.14
149	688088	虹软科技	6,332	244,161.92	0.14
150	600641	万业企业	16,700	244,154.00	0.14
151	603766	隆鑫通用	26,800	243,880.00	0.14
152	600771	广誉远	12,900	243,294.00	0.14
153	600877	电科芯片	18,400	242,696.00	0.14
154	000829	天音控股	18,400	242,512.00	0.14
155	000627	天茂集团	51,500	240,505.00	0.14
156	002335	科华数据	8,300	240,036.00	0.14
157	688484	南芯科技	6,657	239,918.28	0.14
158	300348	长亮科技	16,700	238,810.00	0.14
159	600206	有研新材	15,200	238,184.00	0.14
160	600399	抚顺特钢	41,000	237,800.00	0.14
161	000810	创维数字	14,900	237,208.00	0.13
162	605090	九丰能源	8,300	236,799.00	0.13
163	603300	华铁应急	40,920	236,517.60	0.13
164	002270	华明装备	14,000	236,460.00	0.13
165	002745	木林森	27,100	236,312.00	0.13

166	300294	博雅生物	7,800	236,184.00	0.13
167	600864	哈投股份	32,100	235,935.00	0.13
168	300638	广和通	11,660	234,949.00	0.13
169	000620	新华联	106,700	233,673.00	0.13
170	002396	星网锐捷	12,300	233,577.00	0.13
171	002221	东华能源	24,600	233,454.00	0.13
172	000543	皖能电力	29,500	233,345.00	0.13
173	603662	柯力传感	3,600	232,560.00	0.13
174	000762	西藏矿业	10,800	232,200.00	0.13
175	000801	四川九洲	16,200	231,822.00	0.13
176	600718	东软集团	21,500	231,555.00	0.13
177	300811	铂科新材	4,292	231,381.72	0.13
178	600986	浙文互联	38,600	230,828.00	0.13
179	002354	天娱数科	42,900	230,373.00	0.13
180	300456	赛微电子	13,400	230,212.00	0.13
181	600246	万通发展	30,900	230,205.00	0.13
182	688166	博瑞医药	7,597	229,429.40	0.13
183	300180	华峰超纤	36,400	229,320.00	0.13
184	300657	弘信电子	10,100	228,866.00	0.13
185	300409	道氏技术	16,800	228,648.00	0.13
186	300783	三只松鼠	6,200	228,594.00	0.13
187	600330	天通股份	32,048	227,540.80	0.13
188	002063	远光软件	39,500	227,520.00	0.13
189	600621	华鑫股份	13,800	227,424.00	0.13
190	600827	百联股份	20,800	227,344.00	0.13
191	002544	普天科技	10,600	227,158.00	0.13
192	300298	三诺生物	8,800	227,128.00	0.13
193	000680	山推股份	23,400	226,980.00	0.13
194	300075	数字政通	13,100	226,630.00	0.13
195	001301	尚太科技	3,300	226,215.00	0.13
196	600552	凯盛科技	19,800	225,918.00	0.13
197	603063	禾望电气	11,300	225,548.00	0.13
198	688333	铂力特	5,703	224,869.29	0.13
199	002123	梦网科技	20,800	224,848.00	0.13
200	600635	大众公用	50,500	224,725.00	0.13
201	300319	麦捷科技	18,000	224,640.00	0.13
201	600821	金开新能	41,600	224,640.00	0.13
202	000676	智度股份	26,500	224,190.00	0.13
203	301078	孩子王	19,700	224,186.00	0.13
204	688409	富创精密	4,343	223,968.51	0.13
205	301050	雷电微力	4,340	223,857.20	0.13
206	000682	东方电子	20,900	223,839.00	0.13
207	688582	芯动联科	4,436	223,175.16	0.13

208	002174	游族网络	23,800	222,530.00	0.13
208	300776	帝尔激光	3,500	222,530.00	0.13
209	601126	四方股份	13,100	222,176.00	0.13
210	002839	张家港行	50,800	221,996.00	0.13
211	000035	中国天楹	45,500	221,585.00	0.13
212	603283	赛腾股份	3,200	221,312.00	0.13
213	300166	东方国信	23,500	220,900.00	0.13
214	300036	超图软件	13,000	220,740.00	0.13
215	300327	中颖电子	9,000	220,230.00	0.13
216	600750	江中药业	9,700	220,190.00	0.13
217	603678	火炬电子	7,200	219,600.00	0.12
218	002127	南极电商	49,900	219,560.00	0.12
219	300379	东方通	14,500	218,805.00	0.12
220	300130	新国都	10,100	218,766.00	0.12
221	600572	康恩贝	46,900	218,554.00	0.12
222	000503	国新健康	19,900	218,502.00	0.12
223	600179	安通控股	76,900	217,627.00	0.12
224	300049	福瑞股份	6,900	217,626.00	0.12
225	601860	紫金银行	76,200	217,170.00	0.12
226	600422	昆药集团	13,700	217,145.00	0.12
227	688596	正帆科技	6,106	217,068.30	0.12
228	688408	中信博	3,013	216,936.00	0.12
229	688318	财富趋势	1,261	215,631.00	0.12
230	600596	新安股份	24,557	215,610.46	0.12
231	002317	众生药业	17,700	215,055.00	0.12
232	603881	数据港	9,472	214,540.80	0.12
233	601020	华钰矿业	17,000	214,540.00	0.12
234	300598	诚迈科技	4,430	214,412.00	0.12
235	000969	安泰科技	19,200	214,080.00	0.12
236	688289	圣湘生物	9,411	213,629.70	0.12
237	603565	中谷物流	21,785	213,493.00	0.12
238	002948	青岛银行	55,000	213,400.00	0.12
239	688141	杰华特	6,963	213,137.43	0.12
240	300236	上海新阳	5,700	213,009.00	0.12
241	002183	怡亚通	47,400	212,826.00	0.12
242	600587	新华医疗	12,770	212,620.50	0.12
243	000902	新洋丰	16,300	212,552.00	0.12
244	002654	万润科技	17,500	212,275.00	0.12
245	300113	顺网科技	12,600	211,806.00	0.12
246	603306	华懋科技	6,700	211,787.00	0.12
247	603920	世运电路	7,200	211,680.00	0.12
248	600456	宝钛股份	7,400	210,530.00	0.12
249	000685	中山公用	22,800	210,444.00	0.12

250	002675	东诚药业	17,200	210,184.00	0.12
251	002906	华阳集团	6,800	209,100.00	0.12
252	601778	晶科科技	74,100	208,962.00	0.12
253	301171	易点天下	7,400	208,606.00	0.12
254	600114	东睦股份	12,900	208,593.00	0.12
255	600151	航天机电	26,100	208,278.00	0.12
256	600210	紫江企业	31,500	208,215.00	0.12
257	600633	浙数文化	19,900	208,154.00	0.12
258	300185	通裕重工	80,900	207,913.00	0.12
259	688503	聚和材料	4,685	207,498.65	0.12
260	600595	中孚实业	73,000	206,590.00	0.12
261	600420	国药现代	17,300	206,562.00	0.12
262	600269	赣粤高速	36,700	205,887.00	0.12
263	002597	金禾实业	9,000	205,470.00	0.12
264	300026	红日药业	54,200	205,418.00	0.12
265	688016	心脉医疗	1,869	205,309.65	0.12
266	300475	香农芯创	7,200	205,128.00	0.12
267	300663	科蓝软件	11,800	204,848.00	0.12
268	002332	仙琚制药	20,600	204,764.00	0.12
269	002215	诺普信	18,200	204,386.00	0.12
270	600185	格力地产	28,400	204,196.00	0.12
271	002239	奥特佳	66,900	204,045.00	0.12
272	600993	马应龙	7,800	203,658.00	0.12
273	002020	京新药业	15,900	203,520.00	0.12
274	600320	振华重工	51,900	203,448.00	0.12
275	002182	宝武镁业	18,000	203,040.00	0.12
276	600428	中远海特	27,800	202,940.00	0.12
277	002681	奋达科技	32,500	202,800.00	0.12
278	603323	苏农银行	38,200	202,078.00	0.11
279	300079	数码视讯	37,300	201,793.00	0.11
280	300109	新开源	12,650	201,767.50	0.11
281	300087	荃银高科	17,040	201,072.00	0.11
282	600273	嘉化能源	25,200	200,844.00	0.11
283	601678	滨化股份	53,400	200,784.00	0.11
284	300678	中科信息	5,500	200,035.00	0.11
285	300284	苏交科	19,700	199,955.00	0.11
286	000429	粤高速 A	13,600	199,920.00	0.11
287	603393	新天然气	6,600	199,782.00	0.11
288	300576	容大感光	4,400	198,792.00	0.11
289	002212	天融信	30,800	198,660.00	0.11
290	002171	楚江新材	24,200	198,440.00	0.11
291	002292	奥飞娱乐	22,900	198,085.00	0.11
292	688110	东芯股份	7,915	197,083.50	0.11

293	600201	生物股份	28,700	196,882.00	0.11
294	600461	洪城环境	19,700	196,015.00	0.11
295	000727	冠捷科技	70,500	195,990.00	0.11
296	603108	润达医疗	12,300	195,939.00	0.11
297	600123	兰花科创	22,890	195,938.40	0.11
298	002315	焦点科技	4,700	195,896.00	0.11
299	002015	协鑫能科	25,200	195,552.00	0.11
300	600759	ST 洲际	86,100	195,447.00	0.11
301	002541	鸿路钢构	10,800	193,644.00	0.11
302	601187	厦门银行	34,300	193,452.00	0.11
303	002832	比音勒芬	9,000	192,690.00	0.11
304	300618	寒锐钴业	5,700	192,489.00	0.11
305	300457	赢合科技	10,000	191,400.00	0.11
306	002567	唐人神	37,400	190,740.00	0.11
307	002773	康弘药业	9,700	190,120.00	0.11
308	002351	漫步者	11,500	189,750.00	0.11
309	002421	达实智能	55,200	189,336.00	0.11
310	300027	华谊兄弟	72,200	189,164.00	0.11
311	002488	金固股份	18,100	188,964.00	0.11
312	601718	际华集团	66,200	188,008.00	0.11
313	600037	歌华有线	25,200	187,992.00	0.11
314	600916	中国黄金	21,800	187,916.00	0.11
315	603997	继峰股份	16,400	187,780.00	0.11
316	601519	大智慧	20,300	187,775.00	0.11
317	600550	保变电气	23,900	187,615.00	0.11
318	000012	南玻 A	35,500	187,440.00	0.11
319	600645	中源协和	9,700	187,210.00	0.11
320	300685	艾德生物	8,200	186,960.00	0.11
321	300034	钢研高纳	11,980	186,888.00	0.11
322	688063	派能科技	4,664	186,793.20	0.11
323	002004	华邦健康	41,300	186,676.00	0.11
324	300188	国投智能	13,500	186,165.00	0.11
325	002265	建设工业	8,000	186,160.00	0.11
326	600967	内蒙一机	21,900	186,150.00	0.11
327	603505	金石资源	7,836	186,026.64	0.11
328	002100	天康生物	28,400	186,020.00	0.11
329	002847	盐津铺子	2,970	185,922.00	0.11
330	002091	江苏国泰	25,300	185,196.00	0.11
331	000420	吉林化纤	51,300	185,193.00	0.11
332	688200	华峰测控	1,768	184,756.00	0.10
333	688498	源杰科技	1,375	184,525.00	0.10
334	600057	厦门象屿	28,400	184,316.00	0.10
335	000089	深圳机场	26,700	183,963.00	0.10

336	002668	TCL 智家	14,000	183,680.00	0.10
337	600717	天津港	37,700	183,599.00	0.10
338	001309	德明利	2,100	183,120.00	0.10
339	002649	博彦科技	15,100	183,012.00	0.10
340	601963	重庆银行	19,700	182,816.00	0.10
341	300910	瑞丰新材	3,820	181,793.80	0.10
342	300655	晶瑞电材	19,420	181,771.20	0.10
343	600267	海正药业	21,900	181,770.00	0.10
344	000062	深圳华强	8,100	181,440.00	0.10
345	603220	中贝通信	7,880	181,003.60	0.10
346	300613	富瀚微	3,070	179,595.00	0.10
347	000758	中色股份	36,300	179,322.00	0.10
348	600328	中盐化工	22,760	179,121.20	0.10
349	301297	富乐德	4,200	178,500.00	0.10
350	002011	盾安环境	16,500	178,365.00	0.10
351	002706	良信股份	23,200	178,176.00	0.10
352	688362	甬矽电子	5,272	177,560.96	0.10
353	603398	沐邦高科	7,700	177,177.00	0.10
354	603308	应流股份	12,500	176,250.00	0.10
355	600252	中恒集团	71,600	176,136.00	0.10
356	002192	融捷股份	5,500	175,450.00	0.10
357	002895	川恒股份	7,100	174,660.00	0.10
358	600248	陕建股份	38,900	174,272.00	0.10
359	603690	至纯科技	6,940	174,263.40	0.10
360	002643	万润股份	14,500	174,000.00	0.10
361	002716	湖南白银	51,300	173,907.00	0.10
362	000712	锦龙股份	11,500	173,880.00	0.10
363	688262	国芯科技	6,268	173,623.60	0.10
364	600116	三峡水利	24,800	173,352.00	0.10
365	600409	三友化工	32,100	173,340.00	0.10
366	300323	华灿光电	20,900	173,052.00	0.10
367	603699	纽威股份	7,800	172,926.00	0.10
368	000156	华数传媒	24,000	172,800.00	0.10
369	002276	万马股份	20,400	172,584.00	0.10
370	300693	盛弘股份	6,400	172,544.00	0.10
371	000795	英洛华	17,700	172,221.00	0.10
372	688548	广钢气体	17,076	171,955.32	0.10
373	002079	苏州固锝	16,700	171,509.00	0.10
374	300641	正丹股份	6,900	171,396.00	0.10
375	002539	云图控股	21,900	171,258.00	0.10
376	300682	朗新集团	14,000	170,800.00	0.10
377	603599	广信股份	14,160	170,628.00	0.10
378	300398	飞凯材料	10,800	170,208.00	0.10

379	600729	重庆百货	5,800	169,650.00	0.10
380	300747	锐科激光	8,850	169,566.00	0.10
381	600556	天下秀	32,600	169,520.00	0.10
382	000811	冰轮环境	13,800	169,188.00	0.10
383	000555	神州信息	15,100	169,120.00	0.10
384	688029	南微医学	2,500	168,975.00	0.10
385	301039	中集车辆	18,600	168,330.00	0.10
386	300482	万孚生物	7,500	168,075.00	0.10
387	300633	开立医疗	5,700	167,523.00	0.10
388	688279	峰岬科技	1,061	167,319.70	0.10
389	688629	华丰科技	4,992	167,182.08	0.10
390	000657	中钨高新	18,110	166,793.10	0.09
391	688332	中科蓝讯	1,276	166,518.00	0.09
392	002061	浙江交科	40,720	166,137.60	0.09
393	603588	高能环境	31,640	165,793.60	0.09
394	000927	中国铁物	63,000	165,690.00	0.09
395	600158	中体产业	20,000	165,400.00	0.09
396	000650	仁和药业	28,700	165,312.00	0.09
397	600266	城建发展	32,300	164,730.00	0.09
398	300415	伊之密	8,200	164,492.00	0.09
399	002324	普利特	17,200	163,916.00	0.09
400	688139	海尔生物	4,656	163,891.20	0.09
401	600782	新钢股份	49,000	163,660.00	0.09
402	002010	传化智联	36,100	163,533.00	0.09
403	600894	广日股份	11,200	163,520.00	0.09
404	301029	怡合达	6,600	163,152.00	0.09
405	000821	京山轻机	13,100	163,095.00	0.09
406	002468	申通快递	16,100	163,093.00	0.09
407	002048	宁波华翔	12,900	162,798.00	0.09
408	603279	景津装备	9,100	162,708.00	0.09
409	300357	我武生物	8,000	162,560.00	0.09
410	603027	千禾味业	13,420	162,516.20	0.09
411	600012	皖通高速	9,200	162,380.00	0.09
412	600509	天富能源	25,000	161,750.00	0.09
413	603039	ST 泛微	3,300	161,700.00	0.09
414	600055	万东医疗	10,700	161,570.00	0.09
415	603218	日月股份	13,400	161,470.00	0.09
416	000923	河钢资源	11,600	161,240.00	0.09
417	600664	哈药股份	39,000	161,070.00	0.09
418	300761	立华股份	8,260	160,739.60	0.09
419	603496	恒为科技	5,900	160,362.00	0.09
420	301293	三博脑科	3,700	160,136.00	0.09
421	300352	北信源	30,300	159,984.00	0.09



422	000735	罗牛山	24,000	159,840.00	0.09
423	600933	爱柯迪	9,800	159,740.00	0.09
424	002458	益生股份	16,600	159,526.00	0.09
425	000901	航天科技	14,500	159,065.00	0.09
426	603619	中曼石油	8,200	158,752.00	0.09
427	002006	精工科技	9,600	158,400.00	0.09
428	300470	中密控股	4,200	158,340.00	0.09
429	600480	凌云股份	14,600	157,826.00	0.09
430	300224	正海磁材	12,800	157,568.00	0.09
431	300031	宝通科技	8,600	157,552.00	0.09
432	688076	诺泰生物	3,031	157,369.52	0.09
433	688702	盛科通信	1,868	156,912.00	0.09
434	300232	洲明科技	22,800	156,636.00	0.09
435	300593	新雷能	13,980	156,576.00	0.09
436	601369	陕鼓动力	17,900	155,730.00	0.09
437	002737	葵花药业	7,600	155,724.00	0.09
438	300620	光库科技	3,200	155,520.00	0.09
439	002726	龙大美食	19,600	155,232.00	0.09
440	003021	兆威机电	2,100	155,211.00	0.09
441	600459	贵研铂业	11,300	155,149.00	0.09
442	300123	亚光科技	26,700	154,860.00	0.09
443	002043	兔宝宝	13,000	154,440.00	0.09
444	002446	盛路通信	23,500	153,925.00	0.09
445	600017	日照港	48,100	153,920.00	0.09
446	002023	海特高新	15,100	153,265.00	0.09
447	600063	皖维高新	38,300	153,200.00	0.09
448	600757	长江传媒	16,000	153,120.00	0.09
449	600597	光明乳业	17,900	152,866.00	0.09
450	000552	甘肃能化	55,500	152,625.00	0.09
451	600138	中青旅	15,000	152,100.00	0.09
452	600888	新疆众和	21,400	151,940.00	0.09
453	600006	东风汽车	20,600	151,822.00	0.09
454	688100	威胜信息	4,190	151,678.00	0.09
455	688352	颀中科技	12,504	151,673.52	0.09
456	601311	骆驼股份	18,200	150,878.00	0.09
457	600315	上海家化	8,900	150,499.00	0.09
458	300634	彩讯股份	6,900	150,420.00	0.09
459	600094	大名城	41,300	150,332.00	0.09
460	603358	华达科技	4,500	150,300.00	0.09
461	002326	永太科技	16,800	150,192.00	0.09
462	605507	国邦医药	7,200	149,976.00	0.09
463	600502	安徽建工	31,300	149,614.00	0.09
464	002226	江南化工	27,600	149,592.00	0.09

465	002237	恒邦股份	14,800	149,480.00	0.08
466	002254	泰和新材	15,900	149,460.00	0.08
467	600835	上海机电	8,300	148,736.00	0.08
468	600971	恒源煤电	15,800	148,678.00	0.08
469	002099	海翔药业	28,800	148,608.00	0.08
470	688270	臻镭科技	4,244	148,540.00	0.08
471	688559	海目星	4,318	148,539.20	0.08
472	600211	西藏药业	4,020	148,498.80	0.08
473	688123	聚辰股份	2,525	147,763.00	0.08
474	300244	迪安诊断	13,000	147,550.00	0.08
475	600259	广晟有色	5,300	147,393.00	0.08
476	600366	宁波韵升	20,000	147,200.00	0.08
477	002081	金螳螂	41,200	147,084.00	0.08
478	002097	山河智能	19,600	147,000.00	0.08
479	300446	航天智造	8,900	146,939.00	0.08
480	002605	姚记科技	5,500	146,630.00	0.08
481	603337	杰克股份	4,800	146,208.00	0.08
482	301035	润丰股份	3,000	146,160.00	0.08
483	000913	钱江摩托	8,100	145,881.00	0.08
484	600507	方大特钢	36,000	145,800.00	0.08
485	300770	新媒股份	3,600	145,476.00	0.08
486	603100	川仪股份	6,750	145,462.50	0.08
487	600649	城投控股	32,600	145,070.00	0.08
488	603267	鸿远电子	4,000	144,920.00	0.08
489	600059	古越龙山	16,300	144,744.00	0.08
490	000848	承德露露	16,100	144,417.00	0.08
491	300602	飞荣达	7,500	144,150.00	0.08
492	002761	浙江建投	16,400	143,992.00	0.08
493	300463	迈克生物	10,900	143,880.00	0.08
494	600586	金晶科技	25,600	143,872.00	0.08
495	002815	崇达技术	14,100	143,820.00	0.08
496	300451	创业慧康	32,100	143,808.00	0.08
497	300260	新莱应材	5,300	143,577.00	0.08
498	002993	奥海科技	3,500	143,500.00	0.08
499	688083	中望软件	1,672	143,073.04	0.08
500	600787	中储股份	22,400	142,912.00	0.08
501	000737	北方铜业	18,300	142,740.00	0.08
502	000837	秦川机床	15,900	142,623.00	0.08
503	600478	科力远	34,507	142,513.91	0.08
504	600575	淮河能源	35,800	142,126.00	0.08
505	601900	南方传媒	9,400	142,034.00	0.08
506	600110	诺德股份	35,500	142,000.00	0.08
507	688766	普冉股份	1,400	141,764.00	0.08

508	603281	江瀚新材	5,800	141,520.00	0.08
509	601200	上海环境	17,320	141,504.40	0.08
510	000928	中钢国际	22,200	141,414.00	0.08
511	002163	海南发展	15,100	141,185.00	0.08
512	601702	华峰铝业	7,700	141,064.00	0.08
513	301291	明阳电气	3,211	141,027.12	0.08
514	600395	盘江股份	27,700	140,993.00	0.08
515	000049	德赛电池	5,990	140,824.90	0.08
516	301219	腾远钴业	3,110	140,603.10	0.08
517	300772	运达股份	10,600	140,344.00	0.08
518	688127	蓝特光学	5,175	140,242.50	0.08
519	000090	天健集团	34,100	140,151.00	0.08
520	601952	苏垦农发	14,300	139,997.00	0.08
521	600776	东方通信	12,500	139,875.00	0.08
522	601028	玉龙股份	12,200	139,812.00	0.08
523	688575	亚辉龙	8,846	139,766.80	0.08
524	603197	保隆科技	3,700	139,675.00	0.08
525	002233	塔牌集团	18,200	139,594.00	0.08
526	300151	昌红科技	8,200	139,400.00	0.08
527	002214	大立科技	12,500	139,375.00	0.08
528	600125	铁龙物流	23,500	139,355.00	0.08
529	002219	新里程	52,700	139,128.00	0.08
530	002038	双鹭药业	18,600	138,942.00	0.08
531	002390	信邦制药	30,500	138,775.00	0.08
532	000582	北部湾港	17,600	138,688.00	0.08
533	301071	力量钻石	3,820	138,475.00	0.08
534	600866	星湖科技	21,400	138,458.00	0.08
535	300393	中来股份	22,100	138,125.00	0.08
536	600976	健民集团	3,300	137,544.00	0.08
537	002518	科士达	6,100	137,433.00	0.08
538	600623	华谊集团	19,600	137,200.00	0.08
539	688739	成大生物	5,317	137,072.26	0.08
540	600033	福建高速	35,300	136,964.00	0.08
541	688789	宏华数科	2,062	136,875.56	0.08
542	600869	远东股份	28,800	136,800.00	0.08
542	600996	贵广网络	16,000	136,800.00	0.08
543	688321	微芯生物	7,361	136,767.38	0.08
544	600305	恒顺醋业	17,100	136,458.00	0.08
545	300705	九典制药	7,600	136,420.00	0.08
546	300841	康华生物	2,500	136,300.00	0.08
547	603866	桃李面包	20,600	135,960.00	0.08
548	000028	国药一致	4,640	135,720.00	0.08
549	603033	三维股份	10,693	135,694.17	0.08

550	002891	中宠股份	3,800	135,660.00	0.08
551	301316	慧博云通	5,300	135,521.00	0.08
552	301095	广立微	2,600	135,382.00	0.08
553	688403	汇成股份	15,083	135,143.68	0.08
554	600740	山西焦化	33,500	135,005.00	0.08
555	601890	亚星锚链	17,300	134,767.00	0.08
556	600773	西藏城投	12,500	134,750.00	0.08
557	300687	赛意信息	7,400	134,680.00	0.08
558	300725	药石科技	4,000	134,400.00	0.08
559	600313	农发种业	19,900	134,325.00	0.08
560	000930	中粮科技	24,100	133,755.00	0.08
561	002077	大港股份	9,100	133,497.00	0.08
562	600458	时代新材	10,400	133,224.00	0.08
563	603713	密尔克卫	2,600	133,120.00	0.08
564	688388	嘉元科技	9,027	132,967.71	0.08
565	600675	中华企业	47,300	132,913.00	0.08
566	688639	华恒生物	4,123	132,801.83	0.08
567	688400	凌云光	6,051	132,637.92	0.08
568	300820	英杰电气	2,400	132,600.00	0.08
569	688779	长远锂科	24,896	132,446.72	0.08
570	600490	鹏欣资源	40,200	132,258.00	0.08
571	603128	华贸物流	20,500	131,815.00	0.07
572	300171	东富龙	9,900	131,472.00	0.07
573	601500	通用股份	24,600	131,118.00	0.07
574	300726	宏达电子	4,200	130,620.00	0.07
575	688612	威迈斯	5,548	130,599.92	0.07
576	002635	安洁科技	8,200	130,544.00	0.07
577	300119	瑞普生物	7,100	130,427.00	0.07
578	603368	柳药集团	7,300	130,378.00	0.07
579	300226	上海钢联	5,700	130,359.00	0.07
580	600169	太原重工	52,100	129,729.00	0.07
581	000966	长源电力	27,300	129,675.00	0.07
582	000915	华特达因	4,600	129,628.00	0.07
583	688062	迈威生物	6,413	129,542.60	0.07
584	603026	胜华新材	3,700	129,500.00	0.07
585	600389	江山股份	8,950	129,327.50	0.07
586	300363	博腾股份	8,200	129,314.00	0.07
587	000550	江铃汽车	5,500	128,975.00	0.07
588	002243	力合科创	16,000	128,960.00	0.07
589	603328	依顿电子	13,000	128,180.00	0.07
590	000065	北方国际	13,100	128,118.00	0.07
591	301155	海力风电	2,400	127,944.00	0.07
592	600531	豫光金铅	19,900	127,758.00	0.07

593	600197	伊力特	7,400	127,650.00	0.07
594	603305	旭升集团	9,700	127,555.00	0.07
595	002777	久远银海	7,400	127,428.00	0.07
596	600710	苏美达	13,700	127,410.00	0.07
597	688696	极米科技	1,299	127,327.98	0.07
598	688146	中船特气	4,382	127,253.28	0.07
599	688106	金宏气体	7,447	126,673.47	0.07
600	002928	华夏航空	16,300	126,488.00	0.07
601	601619	嘉泽新能	38,000	126,160.00	0.07
602	688556	高测股份	11,268	125,976.24	0.07
603	000603	盛达资源	10,500	125,895.00	0.07
604	603612	索通发展	9,300	125,643.00	0.07
605	600557	康缘药业	9,200	125,304.00	0.07
606	002925	盈趣科技	8,000	125,280.00	0.07
607	601326	秦港股份	37,300	124,955.00	0.07
608	000048	京基智农	6,900	124,200.00	0.07
609	002697	红旗连锁	21,000	124,110.00	0.07
610	000061	农产品	17,700	124,077.00	0.07
611	000990	诚志股份	16,000	124,000.00	0.07
612	002108	沧州明珠	34,500	123,855.00	0.07
613	002727	一心堂	9,500	123,690.00	0.07
614	601163	三角轮胎	8,200	123,574.00	0.07
615	600775	南京熊猫	12,300	123,492.00	0.07
616	002550	千红制药	19,900	123,380.00	0.07
617	300455	航天智装	9,500	123,120.00	0.07
618	002967	广电计量	7,500	123,000.00	0.07
618	603383	顶点软件	3,280	123,000.00	0.07
619	600751	海航科技	46,700	122,821.00	0.07
620	688091	上海谊众	3,074	122,714.08	0.07
621	601101	昊华能源	14,900	122,627.00	0.07
622	002537	海联金汇	21,300	122,475.00	0.07
623	300660	江苏雷利	3,200	122,304.00	0.07
624	688007	光峰科技	8,266	122,254.14	0.07
625	002985	北摩高科	5,200	122,200.00	0.07
626	601208	东材科技	16,200	122,148.00	0.07
627	300596	利安隆	4,000	122,000.00	0.07
628	688700	东威科技	4,137	121,876.02	0.07
629	001287	中电港	6,000	121,860.00	0.07
630	002291	遥望科技	19,300	121,783.00	0.07
631	300580	贝斯特	5,300	121,635.00	0.07
632	002705	新宝股份	8,100	121,500.00	0.07
633	002068	黑猫股份	11,400	121,296.00	0.07
634	300913	兆龙互连	2,100	120,771.00	0.07

635	600163	中闽能源	19,700	119,973.00	0.07
636	600682	南京新百	17,500	119,700.00	0.07
637	300443	金雷股份	6,000	119,520.00	0.07
638	000950	重药控股	22,200	119,436.00	0.07
639	000756	新华制药	7,600	119,396.00	0.07
640	002626	金达威	7,900	119,290.00	0.07
641	000059	华锦股份	24,900	119,271.00	0.07
642	300366	创意信息	12,800	119,040.00	0.07
643	688192	迪哲医药	2,866	118,853.02	0.07
644	300261	雅本化学	17,300	118,505.00	0.07
645	300129	泰胜风能	16,800	118,440.00	0.07
646	603888	新华网	5,300	118,402.00	0.07
647	000719	中原传媒	10,400	118,144.00	0.07
648	300183	东软载波	6,100	118,035.00	0.07
649	000557	西部创业	22,700	117,813.00	0.07
650	603533	掌阅科技	5,800	117,798.00	0.07
651	002929	润建股份	3,500	117,670.00	0.07
652	600963	岳阳林纸	23,100	117,348.00	0.07
653	603477	巨星农牧	6,600	117,150.00	0.07
654	002154	报喜鸟	26,500	116,865.00	0.07
655	002194	武汉凡谷	10,400	116,688.00	0.07
656	600073	上海梅林	16,800	116,592.00	0.07
657	300821	东岳硅材	15,000	116,400.00	0.07
658	600882	妙可蓝多	6,500	116,350.00	0.07
659	002498	汉缆股份	34,300	116,277.00	0.07
660	603583	捷昌驱动	4,700	116,137.00	0.07
661	300134	大富科技	9,900	116,127.00	0.07
662	600075	新疆天业	26,600	115,710.00	0.07
663	603008	喜临门	6,900	115,644.00	0.07
664	002511	中顺洁柔	16,900	115,089.00	0.07
665	002274	华昌化工	14,800	114,996.00	0.07
666	600812	华北制药	22,200	114,774.00	0.07
667	600648	外高桥	9,600	114,336.00	0.06
668	600861	北京人力	5,900	114,165.00	0.06
669	001914	招商积余	10,800	114,156.00	0.06
670	601969	海南矿业	16,100	114,149.00	0.06
671	002859	洁美科技	5,500	114,125.00	0.06
672	601908	京运通	37,400	114,070.00	0.06
673	002320	海峡股份	17,400	113,970.00	0.06
674	600217	中再资环	21,500	113,950.00	0.06
675	605376	博迁新材	3,900	112,905.00	0.06
676	601606	长城军工	9,600	112,896.00	0.06
677	002987	京北方	7,932	112,872.36	0.06

678	002461	珠江啤酒	11,400	112,746.00	0.06
679	603567	珍宝岛	9,700	112,520.00	0.06
680	002349	精华制药	14,700	112,455.00	0.06
681	601827	三峰环境	13,100	112,398.00	0.06
682	002960	青鸟消防	9,630	112,382.10	0.06
683	600301	华锡有色	6,600	112,266.00	0.06
684	000828	东莞控股	10,500	112,245.00	0.06
685	688006	杭可科技	6,280	112,160.80	0.06
686	688598	金博股份	5,303	111,681.18	0.06
687	002216	三全食品	9,300	111,600.00	0.06
688	601801	皖新传媒	15,200	111,568.00	0.06
689	603638	艾迪精密	6,600	111,474.00	0.06
690	603733	仙鹤股份	5,400	111,402.00	0.06
691	300039	上海凯宝	18,000	111,240.00	0.06
692	600449	宁夏建材	7,400	111,148.00	0.06
693	002545	东方铁塔	15,800	111,074.00	0.06
694	688066	航天宏图	5,437	110,914.80	0.06
695	002191	劲嘉股份	26,400	110,880.00	0.06
696	300416	苏试试验	9,400	110,544.00	0.06
697	600477	杭萧钢构	43,000	110,510.00	0.06
698	688300	联瑞新材	1,707	109,930.80	0.06
699	688432	有研硅	9,699	109,598.70	0.06
700	688522	纳睿雷达	1,944	109,524.96	0.06
701	600997	开滦股份	16,200	109,512.00	0.06
702	603118	共进股份	12,300	109,470.00	0.06
703	002588	史丹利	14,800	109,224.00	0.06
704	300850	新强联	5,700	108,927.00	0.06
705	000488	晨鸣纸业	35,700	108,885.00	0.06
706	601595	上海电影	4,400	108,680.00	0.06
707	600961	株冶集团	13,800	108,606.00	0.06
708	688366	昊海生科	1,784	108,074.72	0.06
709	603317	天味食品	8,100	108,054.00	0.06
710	601609	金田股份	18,300	107,970.00	0.06
711	603919	金徽酒	5,500	107,800.00	0.06
712	605333	沪光股份	3,300	107,679.00	0.06
713	600651	飞乐音响	26,000	107,640.00	0.06
714	600643	爱建集团	20,800	107,536.00	0.06
715	688326	经纬恒润	1,273	107,059.30	0.06
716	301363	美好医疗	3,300	106,986.00	0.06
717	002060	广东建工	29,200	106,872.00	0.06
718	300579	数字认证	3,400	106,828.00	0.06
719	600966	博汇纸业	20,700	106,812.00	0.06
720	605368	蓝天燃气	9,300	106,299.00	0.06

721	601949	中国出版	14,800	106,264.00	0.06
722	603995	甬金股份	5,800	106,082.00	0.06
723	002434	万里扬	17,100	106,020.00	0.06
724	300428	立中集团	6,500	105,950.00	0.06
725	688167	炬光科技	1,661	105,805.70	0.06
726	301325	曼恩斯特	1,940	105,128.60	0.06
727	688515	裕太微	1,061	105,039.00	0.06
728	688630	芯碁微装	1,816	104,819.52	0.06
729	000600	建投能源	18,500	104,710.00	0.06
730	000688	国城矿业	8,800	104,632.00	0.06
731	002051	中工国际	12,800	104,448.00	0.06
732	301510	固高科技	4,000	104,400.00	0.06
733	603229	奥翔药业	10,444	104,335.56	0.06
734	002101	广东鸿图	8,700	104,226.00	0.06
735	301031	中熔电气	1,000	104,020.00	0.06
736	300855	图南股份	4,740	103,900.80	0.06
737	688131	皓元医药	2,909	103,851.30	0.06
738	002399	海普瑞	9,700	103,693.00	0.06
739	002258	利尔化学	12,500	103,375.00	0.06
740	301175	中科环保	19,100	103,140.00	0.06
741	688443	智翔金泰	4,108	103,069.72	0.06
742	000567	海德股份	15,081	103,003.23	0.06
743	001270	铖昌科技	2,702	102,946.20	0.06
744	000881	中广核技	14,000	102,620.00	0.06
745	000029	深深房 A	6,800	102,408.00	0.06
746	000767	晋控电力	40,300	101,959.00	0.06
747	002158	汉钟精机	5,500	101,860.00	0.06
748	300406	九强生物	7,600	101,536.00	0.06
749	688190	云路股份	1,103	101,476.00	0.06
750	605168	三人行	2,823	101,402.16	0.06
751	688372	伟测科技	1,731	101,298.12	0.06
752	002041	登海种业	9,300	101,277.00	0.06
753	603876	鼎胜新材	11,440	101,244.00	0.06
754	002840	华统股份	8,000	100,880.00	0.06
755	300527	中船应急	12,500	100,875.00	0.06
756	003006	百亚股份	4,200	100,758.00	0.06
757	688707	振华新材	9,197	100,707.15	0.06
758	603171	税友股份	3,300	100,650.00	0.06
759	301511	德福科技	8,000	100,480.00	0.06
760	603043	广州酒家	6,000	99,780.00	0.06
761	688147	微导纳米	3,706	99,654.34	0.06
762	002204	大连重工	20,000	99,600.00	0.06
763	688150	莱特光电	4,412	99,358.24	0.06



764	000088	盐田港	20,400	99,348.00	0.06
765	600508	上海能源	7,500	99,225.00	0.06
766	600223	鲁商发展	13,100	99,036.00	0.06
767	301087	可孚医疗	2,800	99,008.00	0.06
768	600020	中原高速	23,400	98,748.00	0.06
769	601869	长飞光纤	3,300	98,637.00	0.06
770	600548	深高速	7,300	98,404.00	0.06
771	301487	盟固利	4,600	97,842.00	0.06
772	600335	国机汽车	15,700	97,811.00	0.06
773	002125	湘潭电化	9,700	97,776.00	0.06
774	600639	浦东金桥	8,800	97,680.00	0.06
775	688502	茂莱光学	485	97,679.00	0.06
776	603636	南威软件	9,300	97,650.00	0.06
777	688097	博众精工	3,718	97,597.50	0.06
778	600783	鲁信创投	7,700	97,559.00	0.06
779	000597	东北制药	18,500	97,495.00	0.06
780	002267	陕天然气	11,500	97,175.00	0.06
781	001213	中铁特货	23,300	97,161.00	0.06
782	600640	国脉文化	8,100	96,714.00	0.05
783	000672	上峰水泥	12,600	96,390.00	0.05
784	002516	旷达科技	19,000	96,330.00	0.05
785	688549	中巨芯	11,276	96,071.52	0.05
786	688389	普门科技	6,433	95,787.37	0.05
787	300861	美畅股份	4,800	95,760.00	0.05
788	600929	雪天盐业	17,100	95,589.00	0.05
789	002585	双星新材	17,900	95,586.00	0.05
790	600874	创业环保	16,000	95,520.00	0.05
791	002327	富安娜	10,800	95,472.00	0.05
792	601515	东峰集团	23,980	95,440.40	0.05
793	000498	山东路桥	16,000	95,200.00	0.05
794	002612	朗姿股份	5,800	94,888.00	0.05
795	301015	百洋医药	3,900	94,419.00	0.05
796	002833	弘亚数控	5,600	94,248.00	0.05
797	301239	普瑞眼科	2,000	93,800.00	0.05
798	002941	新疆交建	8,300	92,711.00	0.05
799	600987	航民股份	13,300	92,302.00	0.05
800	000718	苏宁环球	39,100	92,276.00	0.05
801	688439	振华风光	1,791	91,860.39	0.05
802	688690	纳微科技	5,211	91,713.60	0.05
803	603169	兰石重装	16,800	91,560.00	0.05
804	300257	开山股份	10,000	91,200.00	0.05
805	600657	信达地产	21,900	91,104.00	0.05
806	605599	菜百股份	8,000	90,800.00	0.05

807	002489	浙江永强	28,000	90,720.00	0.05
808	601921	浙版传媒	11,500	90,620.00	0.05
809	600662	外服控股	17,800	90,246.00	0.05
810	002755	奥赛康	7,100	90,241.00	0.05
811	688631	莱斯信息	1,036	90,225.24	0.05
812	601096	宏盛华源	20,700	90,045.00	0.05
813	300973	立高食品	2,300	89,769.00	0.05
814	300856	科思股份	3,500	89,670.00	0.05
815	301238	瑞泰新材	5,700	89,262.00	0.05
816	603299	苏盐井神	8,000	89,120.00	0.05
817	603025	大豪科技	5,820	88,755.00	0.05
818	600195	中牧股份	13,200	88,572.00	0.05
819	000935	四川双马	6,100	88,328.00	0.05
820	300737	科顺股份	17,400	88,218.00	0.05
821	603466	风语筑	9,450	88,074.00	0.05
822	000813	德展健康	28,100	87,953.00	0.05
823	601882	海天精工	4,000	87,720.00	0.05
824	001337	四川黄金	4,200	87,696.00	0.05
825	601107	四川成渝	16,700	87,341.00	0.05
826	002581	未名医药	8,200	87,248.00	0.05
827	002302	西部建设	13,200	86,856.00	0.05
828	600604	市北高新	18,200	86,632.00	0.05
829	000885	城发环境	6,600	86,526.00	0.05
830	603801	志邦家居	6,740	86,339.40	0.05
831	000791	甘肃能源	14,300	86,229.00	0.05
832	300768	迪普科技	4,900	85,750.00	0.05
833	300080	易成新能	19,600	85,652.00	0.05
834	688232	新点软件	2,945	85,375.55	0.05
835	002190	成飞集成	4,400	85,096.00	0.05
836	002991	甘源食品	900	84,168.00	0.05
837	600810	神马股份	10,400	84,136.00	0.05
838	688658	悦康药业	5,823	83,909.43	0.05
839	600475	华光环能	9,300	83,793.00	0.05
840	000968	蓝焰控股	12,600	83,790.00	0.05
841	002034	旺能环境	5,400	83,700.00	0.05
842	301205	联特科技	1,100	83,259.00	0.05
843	001323	慕思股份	2,200	83,182.00	0.05
844	601038	一拖股份	5,600	82,768.00	0.05
845	000736	中交地产	9,600	82,560.00	0.05
846	688380	中微半导	2,760	82,524.00	0.05
847	600780	通宝能源	14,600	82,198.00	0.05
848	688209	英集芯	4,651	82,183.17	0.05
849	002242	九阳股份	7,900	81,844.00	0.05

850	603566	普莱柯	6,400	81,664.00	0.05
851	688298	东方生物	2,780	81,537.40	0.05
852	688107	安路科技	2,752	81,404.16	0.05
853	603609	禾丰股份	9,400	81,028.00	0.05
854	002378	章源钨业	12,510	80,939.70	0.05
855	603123	翠微股份	10,000	80,500.00	0.05
856	601069	西部黄金	7,000	80,150.00	0.05
857	003012	东鹏控股	12,100	79,981.00	0.05
858	002053	云南能投	7,000	79,800.00	0.05
859	603915	国茂股份	6,800	79,696.00	0.05
860	301348	蓝箭电子	3,100	79,422.00	0.05
861	000025	特力A	4,800	79,296.00	0.05
862	688048	长光华芯	2,025	78,954.75	0.04
863	000869	张裕A	3,400	78,846.00	0.04
864	003040	楚天龙	6,000	78,420.00	0.04
865	301153	中科江南	2,800	78,232.00	0.04
866	603348	文灿股份	3,300	78,078.00	0.04
867	600058	五矿发展	10,900	77,608.00	0.04
868	301216	万凯新材	7,600	77,520.00	0.04
869	688586	江航装备	8,075	77,277.75	0.04
870	605020	永和股份	3,800	77,254.00	0.04
871	603730	岱美股份	8,461	76,064.39	0.04
872	002096	易普力	6,400	76,032.00	0.04
873	300723	一品红	4,450	75,917.00	0.04
874	603055	台华新材	6,800	75,344.00	0.04
875	605123	派克新材	1,400	75,264.00	0.04
876	603297	永新光学	800	75,056.00	0.04
877	301047	义翘神州	1,200	74,220.00	0.04
878	688351	微电生理	3,889	74,046.56	0.04
879	301207	华兰疫苗	4,200	73,542.00	0.04
880	688531	日联科技	1,544	73,540.72	0.04
881	603301	振德医疗	3,300	72,567.00	0.04
882	301536	星辰科技	900	71,910.00	0.04
883	002959	小熊电器	1,500	71,865.00	0.04
884	600903	贵州燃气	9,200	71,760.00	0.04
885	603983	丸美股份	2,200	70,972.00	0.04
886	002901	大博医疗	2,300	70,932.00	0.04
887	688261	东微半导	1,689	70,921.11	0.04
888	301217	铜冠铜箔	6,400	70,912.00	0.04
889	601015	陕西黑猫	21,000	70,140.00	0.04
890	688337	普源精电	1,784	69,576.00	0.04
891	301589	诺瓦星云	400	69,440.00	0.04
892	603327	福蓉科技	5,710	69,319.40	0.04

893	301327	华宝新能	900	69,039.00	0.04
894	301526	国际复材	18,585	68,764.50	0.04
895	300926	博俊科技	3,100	68,231.00	0.04
896	301268	铭利达	4,100	67,978.00	0.04
897	603355	莱克电气	3,000	67,950.00	0.04
898	002088	鲁阳节能	5,300	67,787.00	0.04
899	603439	贵州三力	5,200	67,600.00	0.04
900	000030	富奥股份	13,100	67,203.00	0.04
901	301339	通行宝	3,300	67,122.00	0.04
902	603985	恒润股份	5,700	66,576.00	0.04
903	688348	昱能科技	1,364	66,563.20	0.04
904	002314	南山控股	27,800	66,164.00	0.04
905	002534	西子洁能	5,900	65,549.00	0.04
906	300492	华图山鼎	900	65,520.00	0.04
907	605116	奥锐特	3,100	65,472.00	0.04
908	000899	赣能股份	7,500	65,325.00	0.04
909	002275	桂林三金	4,300	64,887.00	0.04
910	603162	海通发展	7,020	64,584.00	0.04
911	688185	康希诺	1,055	64,407.75	0.04
912	001308	康冠科技	2,330	64,075.00	0.04
913	688686	奥普特	842	63,663.62	0.04
914	601033	永兴股份	4,375	63,262.50	0.04
915	601886	江河集团	11,700	63,180.00	0.04
916	002978	安宁股份	2,200	62,524.00	0.04
917	603989	艾华集团	4,100	61,828.00	0.04
918	000761	本钢板材	19,300	61,760.00	0.04
919	688105	诺唯赞	2,773	61,477.41	0.03
920	000058	深赛格	7,600	61,028.00	0.03
921	002946	新乳业	4,200	60,942.00	0.03
922	688336	三生国健	2,835	60,725.70	0.03
923	002913	奥士康	2,500	60,275.00	0.03
924	605009	豪悦护理	1,500	59,940.00	0.03
925	603530	神马电力	2,400	59,304.00	0.03
926	301376	致欧科技	3,093	59,138.16	0.03
927	300755	华致酒行	3,300	58,872.00	0.03
928	003009	中天火箭	1,500	58,500.00	0.03
929	600618	氯碱化工	5,900	58,174.00	0.03
930	601083	锦江航运	6,100	58,072.00	0.03
931	301069	凯盛新材	3,900	57,798.00	0.03
932	300894	火星人	4,200	57,540.00	0.03
933	300741	华宝股份	3,300	57,387.00	0.03
934	300702	天宇股份	3,440	57,310.40	0.03
935	002651	利君股份	7,800	57,174.00	0.03

936	300869	康泰医学	4,100	57,154.00	0.03
937	603013	亚普股份	3,800	56,924.00	0.03
938	603719	良品铺子	4,000	56,840.00	0.03
939	688206	概伦电子	2,991	56,559.81	0.03
940	001258	立新能源	7,100	56,516.00	0.03
941	688315	诺禾致源	4,492	56,150.00	0.03
942	301246	宏源药业	4,100	55,473.00	0.03
943	605296	神农集团	2,000	55,400.00	0.03
944	002911	佛燃能源	4,380	55,363.20	0.03
945	688177	百奥泰	2,855	55,329.90	0.03
946	000517	荣安地产	24,800	55,304.00	0.03
947	688001	华兴源创	2,031	55,040.10	0.03
948	688526	科前生物	3,843	54,916.47	0.03
949	601022	宁波远洋	6,800	54,604.00	0.03
950	000019	深粮控股	8,300	54,531.00	0.03
951	688776	国光电气	1,150	54,429.50	0.03
952	301558	三态股份	6,200	54,312.00	0.03
953	301367	怡和嘉业	860	54,180.00	0.03
954	603093	南华期货	4,500	53,550.00	0.03
955	001236	弘业期货	5,500	53,020.00	0.03
956	301371	敷尔佳	1,400	52,906.00	0.03
957	603877	太平鸟	3,500	51,800.00	0.03
958	688268	华特气体	1,106	50,787.52	0.03
959	601811	新华文轩	3,200	50,720.00	0.03
960	001311	多利科技	1,930	49,774.70	0.03
961	688392	骄成超声	1,218	49,694.40	0.03
962	605577	龙版传媒	3,400	49,402.00	0.03
963	002990	盛视科技	2,100	48,657.00	0.03
964	688383	新益昌	1,083	48,594.21	0.03
965	605222	起帆电缆	3,100	47,740.00	0.03
966	603057	紫燕食品	2,300	46,207.00	0.03
967	301381	赛维时代	2,000	45,520.00	0.03
968	605011	杭州热电	2,100	44,982.00	0.03
969	603489	八方股份	1,828	43,542.96	0.02
970	003039	顺控发展	3,300	43,164.00	0.02
971	603693	江苏新能	4,320	42,552.00	0.02
972	688128	中国电研	1,959	41,158.59	0.02
973	603219	富佳股份	2,900	41,093.00	0.02
974	605365	立达信	2,600	40,820.00	0.02
975	688433	华曙高科	1,740	40,611.60	0.02
976	001389	广合科技	803	40,390.90	0.02
977	001269	欧晶科技	1,340	38,176.60	0.02
978	301500	飞南资源	2,100	37,800.00	0.02

979	301090	华润材料	5,400	37,476.00	0.02
980	688523	航天环宇	1,868	37,360.00	0.02
981	001322	箭牌家居	4,600	37,214.00	0.02
982	600403	大有能源	12,500	36,750.00	0.02
983	301559	中集环科	2,300	35,305.00	0.02
984	601068	中铝国际	7,800	34,398.00	0.02
985	301508	中机认检	1,000	34,000.00	0.02
986	603132	金徽股份	2,900	32,567.00	0.02
987	603103	横店影视	2,000	28,780.00	0.02
988	601279	英利汽车	7,400	28,342.00	0.02
989	301606	绿联科技	700	26,460.00	0.02
990	301177	迪阿股份	1,100	25,124.00	0.01
991	301262	海看股份	1,000	24,870.00	0.01
992	301180	万祥科技	1,400	21,658.00	0.01
993	603075	热威股份	1,000	18,630.00	0.01
994	001376	百通能源	1,100	16,082.00	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301626	苏州天脉	2,352	200,407.52	0.11
2	688798	艾为电子	2,139	149,344.98	0.08
3	001391	国货航	12,425	111,438.62	0.06
4	301613	新铝时代	1,688	94,629.48	0.05
5	688800	瑞可达	1,500	75,165.00	0.04
6	688605	先锋精科	643	34,516.24	0.02
7	301551	无线传媒	616	26,629.68	0.02
8	688726	拉普拉斯	753	24,894.18	0.01
9	301611	珂玛科技	406	22,776.60	0.01
10	688449	联芸科技	718	21,137.92	0.01
11	688750	金天钛业	1,139	17,586.16	0.01
12	603072	天和磁材	1,319	16,223.70	0.01
13	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
14	688708	佳驰科技	307	15,027.65	0.01
15	301522	上大股份	543	13,488.12	0.01
16	301571	国科天成	272	11,105.76	0.01
17	301622	英思特	226	10,151.92	0.01
18	301586	佳力奇	180	9,565.20	0.01
19	301607	富特科技	254	9,179.56	0.01
20	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
21	301631	壹连科技	72	7,341.12	0.00
22	301585	蓝宇股份	183	6,560.55	0.00

23	301617	博苑股份	155	6,167.45	0.00
24	301591	肯特股份	147	5,628.63	0.00
25	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
26	301587	中瑞股份	156	3,666.00	0.00
27	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
28	603194	中力股份	122	3,431.86	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	002456	欧菲光	2,604,470.00	1.87
2	300339	润和软件	2,275,680.00	1.63
3	002405	四维图新	1,730,983.00	1.24
4	300476	胜宏科技	1,515,481.00	1.09
5	300346	南大光电	1,440,270.00	1.03
6	002318	久立特材	1,382,669.00	0.99
7	002085	万丰奥威	1,363,515.00	0.98
8	000528	柳工	1,335,103.00	0.96
9	002176	江特电机	1,329,675.00	0.95
10	002151	北斗星通	1,259,698.00	0.90
11	300672	国科微	1,252,696.00	0.90
12	002312	川发龙蟒	1,232,184.00	0.88
13	002126	银轮股份	1,211,064.00	0.87
14	300315	掌趣科技	1,208,399.00	0.87
15	000034	神州数码	1,205,890.00	0.86
16	300775	三角防务	1,200,041.00	0.86
17	000426	兴业银锡	1,187,367.00	0.85
18	000766	通化金马	1,160,181.00	0.83
19	300666	江丰电子	1,152,547.00	0.83
20	002837	英维克	1,131,316.90	0.81

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 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	300339	润和软件	3,836,183.00	2.75
2	002456	欧菲光	2,610,881.00	1.87
3	300476	胜宏科技	2,200,008.58	1.58
4	002085	万丰奥威	2,090,898.00	1.50

5	002318	久立特材	1,769,374.00	1.27
6	002405	四维图新	1,710,264.00	1.23
7	000034	神州数码	1,660,019.00	1.19
8	000426	兴业银锡	1,516,963.00	1.09
9	002312	川发龙蟒	1,432,798.00	1.03
10	300346	南大光电	1,399,086.00	1.00
11	002176	江特电机	1,302,278.00	0.93
12	300672	国科微	1,280,485.00	0.92
13	000403	派林生物	1,249,963.36	0.90
14	000528	柳工	1,225,885.00	0.88
15	002151	北斗星通	1,215,326.00	0.87
16	300315	掌趣科技	1,214,972.00	0.87
17	002837	英维克	1,212,218.00	0.87
18	300735	光弘科技	1,185,707.00	0.85
19	300458	全志科技	1,166,726.20	0.84
20	300666	江丰电子	1,147,555.00	0.82

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	358,871,550.22
卖出股票收入（成交）总额	337,977,960.09

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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



## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，欧菲光（002456）在报告编制日前一年内曾受到深圳证监局的处罚。

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

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

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	1,273,176.42
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	-
8	其他	-
9	合计	1,273,176.42

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301626	苏州天脉	46,440.68	0.03	新股锁定期内
2	001391	国货航	8,452.40	0.00	新股锁定期内
3	301613	新铝时代	7,059.13	0.00	新股锁定期内

### 8.12.6 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。

## § 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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,634	27,719.28	27,277,779.00	37.36	45,734,813.00	62.64

### 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	8,654,691.00	11.85
2	张郭堃	4,339,652.00	5.94
3	中国国际金融股份有限公司	2,850,933.00	3.90
4	方正证券股份有限公司	2,607,558.00	3.57
5	张华东	2,310,784.00	3.16
6	张岳旋	2,150,800.00	2.95
7	广发证券股份有限公司	1,851,237.00	2.54
8	兴银理财有限责任公司—兴银理财天天万利宝稳利3号净值型理财产品S款	1,790,584.00	2.45
9	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利3号净值型理财产品M款	1,591,800.00	2.18
10	深圳前海国恩资本管	1,538,800.00	2.11

	理有限公司—国恩中证 1000 指数增强 3 号 私募证券投资基金		
--	-----------------------------------	--	--

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 3 月 15 日) 基金份额总额	222,602,182.00
本报告期期初基金份额总额	144,102,182.00
本报告期基金总申购份额	496,001,845.00
减：本报告期基金总赎回份额	450,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-116,591,435.00
本报告期期末基金份额总额	73,012,592.00

## § 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。

基金托管人重大人事变动：

2024 年 7 月 22 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去易卫东担任的托管部总经理职务，另有任用。

2024 年 7 月 22 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘赵斗斗担任托管部总经理。

2024 年 7 月 22 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去牛中强担任的托管部副总经理职务，另有任用。

2024 年 7 月 25 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘蒋伟担任托管部副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

### 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、公募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 50,000.00 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：本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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 (%)	
招商证券	6	695,248,891.	100.00	313,606.52	100.00	-

		01				
华泰证券	2	-	-	-	-	-

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，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，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	
	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(%)
招商证券	203,404.26	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 05 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 27 日
4	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
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 13 日
6	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
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 28 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 24 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额合并期间相关业务安排的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 23 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额合并及调整最小申购、赎回单位相关业务安排的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 22 日
11	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
12	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
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	关于同意广发证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	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
19	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
20	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
21	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
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日

	事非法活动的公告		
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 日
24	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
25	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
26	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
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 日

## § 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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
个人	1	20240207-20240208;	0.00	257,122,600.00	257,122,600.00	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日