

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券
投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末上市基金前十名持有人	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	70
§ 9 开放式基金份额变动	70
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 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 1000 指数 ETF)
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	146,602,182.00 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
登载基金中期报告正文的基金管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-8,875,828.49
本期利润	-10,333,075.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0715
本期加权平均净值利润率	-8.16%
本期基金份额净值增长率	-15.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-26,845,624.31
期末可供分配基金份额利润	-0.1831
期末基金资产净值	119,756,557.69
期末基金份额净值	0.8169
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-18.31%

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

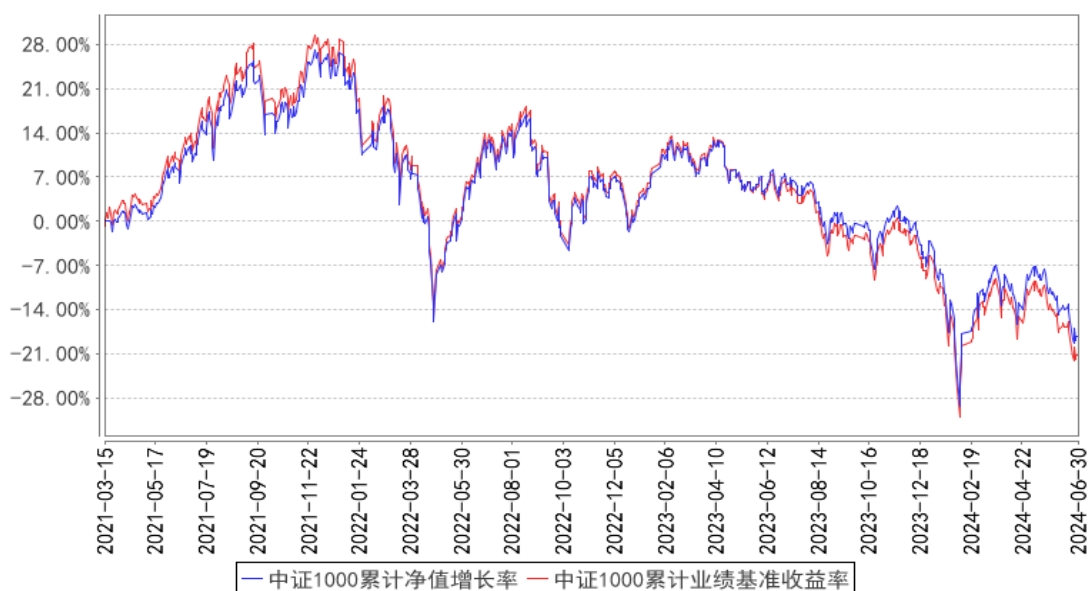
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	-7.98%	1.41%	-8.58%	1.43%	0.60%	-0.02%
过去三个月	-8.82%	1.47%	-10.02%	1.49%	1.20%	-0.02%
过去六个月	-15.65%	1.95%	-16.84%	1.97%	1.19%	-0.02%
过去一年	-23.63%	1.53%	-25.84%	1.55%	2.21%	-0.02%
过去三年	-27.07%	1.40%	-30.88%	1.43%	3.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-18.31%	1.36%	-21.29%	1.39%	2.98%	-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 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下管理 156 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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月起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 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。
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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成

交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 3 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年市场以结构性机会为主，其中银行、煤炭、公用事业、家用电器的表现相对较好，涨跌幅分别为 17.02%、11.96%、11.76%和 8.48%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为 0.89%、-8.96%、-16.84%和-10.99%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为 12.54%和-7.00%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

2024 年上半年，市场呈现先扬后抑，二季度回调较大。随着积极政策的陆续出台，市场情绪显著提振，市场已经逐渐从过度悲观的预期中走出。基本面方面，制造业投资保持一定韧性，设备更新、新质生产力等对制造业投资持续助力。全球制造业回暖，外需延续向好或有利于我国出口。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.032%，期间日跟踪误差为 0.041%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8169 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.65%，业绩比较基准收益率为-16.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，进入中报业绩披露期与政策关键窗口期，市场将受到上市公司业绩与改革力度预期的共振影响。同时，也受到海外流动性对市场仍有扰动，可能更多呈现震荡行情，建议寻找结构性机会。中期来看，随着中国经济迎来新一轮盈利周期、中美经济周期错位进入下半场等利好因素下，中国资产有望相对收益，在历经修复后市场整体估值仍在偏低水平，与全球市场相比 A 股市场的估值比较具有吸引力，建议寻找结构性机会。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研

究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	5,471,755.51	3,094,850.07
结算备付金		1,290,408.92	303,884.41
存出保证金		1,052,314.99	408,001.06
交易性金融资产	6.4.7.2	111,383,162.44	136,056,061.71
其中：股票投资		111,383,162.44	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,044,216.49	228,716.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		120,317,267.47	140,091,514.06
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		0.60	870.40
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		45,708.87	60,234.05
应付托管费		9,141.76	12,046.83
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	505,858.55	451,621.56
负债合计		560,709.78	524,772.84
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	146,602,182.00	144,102,182.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-26,845,624.31	-4,535,440.78
净资产合计		119,756,557.69	139,566,741.22
负债和净资产总计		120,317,267.47	140,091,514.06

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8169 元，基金份额总额 146,602,182.00 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-9,774,774.38	11,043,743.43
1. 利息收入		63,348.25	24,133.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	63,348.25	24,133.58
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）		-9,199,939.11	1,245,136.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,521,720.72	11,845.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	12,953.26	71,389.25
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	269,279.84	-
股利收益	6.4.7.19	1,039,548.51	1,161,902.09
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,457,247.32	9,463,972.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.21	819,063.80	310,500.31

号填列)			
减：二、营业总支出		558,301.43	648,711.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	326,971.46	400,090.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	65,394.28	80,017.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,358.12	0.04
8. 其他费用	6.4.7.23	164,577.57	168,603.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,333,075.81	10,395,032.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,333,075.81	10,395,032.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,333,075.81	10,395,032.08

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	2,500,000.00	-	-22,310,183.53	-19,810,183.53
（一）、综合收益总额	-	-	-10,333,075.81	-10,333,075.81

(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)	2,500,000.00	-	-11,977,107.72	-9,477,107.72
其中: 1. 基金申购款	220,000,000.00	-	-41,256,923.83	178,743,076.17
2. 基金赎回款	-217,500,000.00	-	29,279,816.11	-188,220,183.89
(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	146,602,182.00	-	-26,845,624.31	119,756,557.69
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	-42,500,000.00	-	7,525,502.76	-34,974,497.24
(一)、综合收益总额	-	-	10,395,032.08	10,395,032.08
(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)	-42,500,000.00	-	-2,869,529.32	-45,369,529.32

其中：1. 基金申购款	75,000,000.00	-	5,814,286.67	80,814,286.67
2. 基金赎回款	-117,500,000.00	-	-8,683,815.99	-126,183,815.99
(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	114,102,182.00	-	7,942,212.11	122,044,394.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 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）。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 2024 年 08 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,471,755.51
等于：本金	5,469,117.96
加：应计利息	2,637.55
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	5,471,755.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	122,189,287.36	-	111,383,162.44	-10,806,124.92
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	122,189,287.36	-	111,383,162.44	-10,806,124.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	7,068,440.00	-	-	
其中：股指期货投资	7,068,440.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	7,068,440.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2409	中证1000股指期货 2409	7.00	6,692,280.00	-376,160.00
合计				-376,160.00
减：可抵销期货暂收款				-376,160.00
净额				0.00

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

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	45,069.53
其中：交易所市场	45,069.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,479.84
应退退补款	366,309.18
合计	505,858.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	144,102,182.00	144,102,182.00
本期申购	220,000,000.00	220,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-217,500,000.00	-217,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	146,602,182.00	146,602,182.00

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	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	-8,875,828.49	-1,457,247.32	-10,333,075.81

本期基金份额交易产生的变动数	1,851,219.72	-13,828,327.44	-11,977,107.72
其中：基金申购款	-5,023,993.83	-36,232,930.00	-41,256,923.83
基金赎回款	6,875,213.55	22,404,602.56	29,279,816.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,116,966.95	-20,728,657.36	-26,845,624.31

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		40,363.57
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		21,299.32
其他		1,685.36
合计		63,348.25

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-8,335,261.29
股票投资收益——赎回差价收入		-2,186,459.43
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		-10,521,720.72

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		135,082,729.19
减：卖出股票成本总额		143,105,149.83
减：交易费用		312,840.65
买卖股票差价收入		-8,335,261.29

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		188,220,183.89

减：现金支付赎回款总额	119,724,866.89
减：赎回股票成本总额	70,681,776.43
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,186,459.43

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	18.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,935.14
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	12,953.26

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	107,060.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	94,100.00
减：应计利息总额	21.48
减：交易费用	4.25
买卖债券差价收入	12,935.14

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	269,279.84

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,039,548.51
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,039,548.51
----	--------------

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,127,247.32
股票投资	-1,127,247.32
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-330,000.00
权证投资	-
期货投资	-330,000.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,457,247.32

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	819,063.80
合计	819,063.80

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
注册登记费	74,590.88
IOPV 计算发布费	5,451.33

合计	164,577.57
----	------------

6.4.7.24 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“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
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日

	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	267,827,223.78	100.00	166,646,601.32	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例 (%)
招商证券	107,060.87	100.00	326,109.66	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	228,109.24	100.00	45,069.53	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	153,781.38	100.00	106,757.23	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、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等（截止 2024 年 6 月 30 日）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	326,971.46	400,090.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,509.82	6,609.85
应支付基金管理人的净管理费	320,461.64	393,480.16

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

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6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,394.28	80,017.99

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
华泰证券股份 有限公司	3,029,500.00	2.0665	3,172,400.00	2.2015

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	479	13,900.58
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6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	3,582	58,171.68
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,156	18,380.40
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	688512	慧智微	网下申购	2,667	55,793.64
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	688429	时创能源	网下申购	1,968	37,785.60
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
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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定期内	17.39	20.60	89	1,547.71	1,833.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.98	13.48	98	1,664.04	1,321.04	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	15.38	15.25	113	1,338.06	1,723.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期内	17.43	34.56	103	1,795.29	3,559.68	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定期内	28.01	37.83	91	2,548.91	3,442.53	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期内	16.16	32.27	222	3,587.52	7,163.94	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	55.82	91.24	101	4,019.04	9,215.24	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定期内	10.64	19.82	301	3,202.64	5,965.82	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	新股锁定期内	8.90	16.97	369	3,284.10	6,261.93	-
301587	中	2024	6个月	新股	21.73	25.26	156	3,389.88	3,940.56	-

	瑞股份	年3月27日		锁定期内						
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	14.50	21.25	206	2,987.00	4,377.50	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	126.89	188.01	248	17,510.82	46,626.48	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定期内	19.43	36.98	147	2,856.21	5,436.06	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.20	15.96	175	2,835.00	2,793.00	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定期内	21.28	29.49	52	1,106.56	1,533.48	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	29.02	25.36	48	1,392.96	1,217.28	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定期内	72.46	68.06	22	1,594.12	1,497.32	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	19.18	22.66	81	1,553.58	1,835.46	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定期内	38.18	38.90	33	1,259.94	1,283.70	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期内	19.86	42.51	143	2,839.98	6,078.93	-
688695	中创股	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	22.43	31.55	121	2,714.03	3,817.55	-

	份									
--	---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024年5月6日	重大事项	12.35	2024年7月8日	9.88	6,600	124,937.48	81,510.00	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于交通银行的托管账户，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 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2023 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,471,755.51	-	-	-	-	-	5,471,755.51
结算备付金	1,290,408.92	-	-	-	-	-	1,290,408.92
存出保证金	1,052,314.99	-	-	-	-	-	1,052,314.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	111,383,162.44	111,383,162.44
应收清算款	-	-	-	-	-	1,044,216.49	1,044,216.49
其他资产	-	-	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	7,814,479.42	-	-	-	-	112,502,788.05	120,317,267.47
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	0.60	0.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,708.87	45,708.87

应付托管费	-	-	-	-	-	9,141.76	9,141.76
其他负债	-	-	-	-	-	505,858.55	505,858.55
负债总计	-	-	-	-	-	560,709.78	560,709.78
利率敏感度缺口	7,814,479.42	-	-	-	-	-111,942,078.27	119,756,557.69
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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：0.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	111,383,162.44	93.01	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	-0.60	-0.00	-870.40	-
合计	111,383,161.84	93.01	136,010,488.23	97.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	中证 1000 指数上升 5%	5,848,002.84	6,767,650.86
	中证 1000 指数下降 5%	-5,848,002.84	-6,767,650.86

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	111,180,728.29	135,438,421.92
第二层次	81,510.00	354,014.54
第三层次	120,924.15	263,625.25
合计	111,383,162.44	136,056,061.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2023 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	111,383,162.44	92.57
	其中：股票	111,383,162.44	92.57
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	6,762,164.43	5.62
8	其他各项资产	2,171,940.60	1.81
9	合计	120,317,267.47	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	748,994.60	0.63
B	采矿业	4,160,857.98	3.47
C	制造业	71,586,178.65	59.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,699,620.52	3.09
E	建筑业	1,844,874.00	1.54
F	批发和零售业	3,852,775.01	3.22
G	交通运输、仓储和邮政业	3,465,220.90	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,621,537.43	9.70
J	金融业	3,216,116.81	2.69
K	房地产业	1,715,701.00	1.43
L	租赁和商务服务业	1,856,279.79	1.55
M	科学研究和技术服务业	811,784.60	0.68

N	水利、环境和公共设施管理业	977,853.20	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	379,103.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	1,246,623.80	1.04
S	综合	-	-
	合计	111,183,521.29	92.84

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	189,744.67	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,896.48	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	199,641.15	0.17

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	72,700	567,787.00	0.47
2	601099	太平洋	152,100	463,905.00	0.39
3	300476	胜宏科技	12,900	416,154.00	0.35
4	300573	兴齐眼药	2,432	398,848.00	0.33
5	000426	兴业银锡	28,600	388,388.00	0.32
6	002085	万丰奥威	28,400	376,016.00	0.31
7	300339	润和软件	17,700	365,859.00	0.31
8	002318	久立特材	15,300	356,949.00	0.30
9	600312	平高电气	18,000	350,100.00	0.29
10	000766	通化金马	21,600	349,704.00	0.29
11	000528	柳工	30,900	345,771.00	0.29
12	300346	南大光电	12,000	343,080.00	0.29
13	601918	新集能源	34,600	337,350.00	0.28
14	002405	四维图新	52,900	329,038.00	0.27
15	601677	明泰铝业	27,760	320,905.60	0.27
16	002130	沃尔核材	22,500	317,700.00	0.27
17	002126	银轮股份	18,200	316,862.00	0.26
18	601975	招商南油	86,900	311,971.00	0.26
19	002176	江特电机	38,100	310,515.00	0.26
20	605589	圣泉集团	15,200	308,408.00	0.26
21	601001	晋控煤业	18,500	305,620.00	0.26
22	603005	晶方科技	14,656	298,689.28	0.25
23	600559	老白干酒	16,300	296,334.00	0.25
24	002139	拓邦股份	27,800	295,236.00	0.25
25	688578	艾力斯	4,603	293,395.22	0.24
26	300049	福瑞股份	5,700	286,938.00	0.24
27	300775	三角防务	8,700	266,220.00	0.22
28	600100	同方股份	52,200	265,698.00	0.22
29	002270	华明装备	11,900	264,656.00	0.22
30	600761	安徽合力	12,200	264,008.00	0.22
31	000403	派林生物	9,900	263,934.00	0.22
32	600711	盛屯矿业	70,000	256,900.00	0.21
33	600685	中船防务	9,200	256,680.00	0.21
34	300315	掌趣科技	61,300	255,621.00	0.21
35	300762	上海瀚讯	14,220	254,680.20	0.21
36	688235	百济神州	2,196	254,384.64	0.21

37	000690	宝新能源	48,700	248,370.00	0.21
38	600285	羚锐制药	10,200	246,942.00	0.21
39	000415	渤海租赁	96,500	246,075.00	0.21
40	601333	广深铁路	75,900	245,916.00	0.21
41	688676	金盘科技	4,661	243,071.15	0.20
42	603129	春风动力	1,700	241,978.00	0.20
43	000034	神州数码	10,500	240,345.00	0.20
44	000875	吉电股份	43,700	232,921.00	0.19
45	300083	创世纪	37,700	231,101.00	0.19
46	300458	全志科技	9,800	230,398.00	0.19
47	600323	瀚蓝环境	10,900	227,810.00	0.19
48	301308	江波龙	2,400	227,376.00	0.19
49	002312	川发龙蟒	33,700	226,801.00	0.19
50	000543	皖能电力	25,500	225,675.00	0.19
51	300679	电连技术	5,600	225,288.00	0.19
52	002402	和而泰	20,900	223,839.00	0.19
53	300115	长盈精密	18,600	223,014.00	0.19
54	000422	湖北宜化	18,700	222,904.00	0.19
55	605111	新洁能	7,246	221,655.14	0.19
56	600363	联创光电	7,900	217,408.00	0.18
57	002389	航天彩虹	15,600	216,684.00	0.18
58	300294	博雅生物	6,500	214,500.00	0.18
59	002837	英维克	10,014	214,199.46	0.18
60	688166	博瑞医药	6,104	213,640.00	0.18
61	601126	四方股份	11,100	213,342.00	0.18
62	300459	汤姆猫	62,700	212,553.00	0.18
63	300627	华测导航	7,100	211,935.00	0.18
64	688019	安集科技	1,684	211,847.20	0.18
65	601375	中原证券	61,600	210,056.00	0.18
66	600908	无锡银行	39,200	208,544.00	0.17
67	688327	云从科技	18,396	208,058.76	0.17
68	002151	北斗星通	8,600	207,948.00	0.17
69	688076	诺泰生物	2,650	207,442.00	0.17
70	002807	江阴银行	55,000	207,350.00	0.17
71	600422	昆药集团	11,600	206,828.00	0.17
72	000581	威孚高科	12,700	206,756.00	0.17
73	603556	海兴电力	4,400	206,052.00	0.17
74	600771	广誉远	10,900	205,247.00	0.17
75	688266	泽璟制药	3,778	204,843.16	0.17
76	601222	林洋能源	32,300	202,521.00	0.17
77	002332	仙琚制药	17,600	200,816.00	0.17
78	688050	爱博医疗	2,731	200,236.92	0.17
79	605090	九丰能源	6,900	200,100.00	0.17

80	002245	蔚蓝锂芯	25,800	199,950.00	0.17
81	300666	江丰电子	4,200	199,752.00	0.17
82	600750	江中药业	8,600	198,746.00	0.17
83	002145	中核钛白	60,590	198,735.20	0.17
84	688608	恒玄科技	1,345	196,881.10	0.16
85	000682	东方电子	17,800	196,512.00	0.16
86	603393	新天然气	5,600	194,544.00	0.16
87	603236	移远通信	4,154	194,116.42	0.16
88	002851	麦格米特	7,500	193,800.00	0.16
88	300857	协创数据	3,400	193,800.00	0.16
89	000860	顺鑫农业	11,500	192,510.00	0.16
90	688037	芯源微	2,155	191,795.00	0.16
91	603300	华铁应急	34,920	190,663.20	0.16
92	301301	川宁生物	14,900	190,422.00	0.16
93	300633	开立医疗	4,800	189,984.00	0.16
94	600461	洪城环境	16,400	189,912.00	0.16
95	002222	福晶科技	8,410	189,477.30	0.16
96	688027	国盾量子	1,250	188,750.00	0.16
97	002400	省广集团	38,900	188,665.00	0.16
98	300735	光弘科技	8,700	187,920.00	0.16
99	600667	太极实业	32,900	187,859.00	0.16
100	300624	万兴科技	3,537	187,708.59	0.16
101	600338	西藏珠峰	20,300	187,572.00	0.16
102	300298	三诺生物	7,400	187,516.00	0.16
103	603083	剑桥科技	5,800	187,224.00	0.16
104	600452	涪陵电力	14,776	187,211.92	0.16
105	600330	天通股份	27,500	187,000.00	0.16
106	002745	木林森	23,100	186,186.00	0.16
107	603505	金石资源	6,636	185,343.48	0.15
108	300672	国科微	3,500	184,940.00	0.15
109	000951	中国重汽	12,900	184,728.00	0.15
110	600331	宏达股份	31,900	184,701.00	0.15
111	300045	华力创通	10,400	183,560.00	0.15
112	600821	金开新能	35,500	182,470.00	0.15
113	300133	华策影视	29,600	181,744.00	0.15
114	002675	东诚药业	14,800	181,448.00	0.15
115	002832	比音勒芬	7,500	181,275.00	0.15
116	300456	赛微电子	11,400	180,918.00	0.15
117	600718	东软集团	21,700	179,459.00	0.15
118	600572	康恩贝	40,100	179,247.00	0.15
119	600916	中国黄金	18,600	178,932.00	0.15
120	600201	生物股份	24,800	178,808.00	0.15
121	000035	中国天楹	39,400	178,482.00	0.15

122	002063	远光软件	34,000	178,160.00	0.15
123	000628	高新发展	4,000	177,480.00	0.15
124	300475	香农芯创	6,000	177,420.00	0.15
125	600123	兰花科创	19,790	177,120.50	0.15
126	688568	中科星图	3,710	176,967.00	0.15
127	688278	特宝生物	3,297	176,554.35	0.15
128	002182	宝武镁业	15,600	175,968.00	0.15
129	600728	佳都科技	47,400	175,854.00	0.15
130	603283	赛腾股份	2,300	175,720.00	0.15
131	300638	广和通	10,260	175,446.00	0.15
132	300182	捷成股份	47,200	175,112.00	0.15
133	002249	大洋电机	37,000	175,010.00	0.15
134	002317	众生药业	15,300	174,879.00	0.15
135	000923	河钢资源	10,100	173,922.00	0.15
136	002544	普天科技	9,300	173,817.00	0.15
137	300738	奥飞数据	17,172	173,780.64	0.15
138	002484	江海股份	13,100	173,575.00	0.14
139	000686	东北证券	31,100	173,538.00	0.14
140	002015	协鑫能科	21,800	173,528.00	0.14
141	600993	马应龙	6,500	173,355.00	0.14
142	002773	康弘药业	8,000	173,200.00	0.14
143	002221	东华能源	21,000	172,410.00	0.14
144	603588	高能环境	27,440	172,323.20	0.14
145	002567	唐人神	32,100	172,056.00	0.14
146	600057	厦门象屿	25,200	171,360.00	0.14
147	300811	铂科新材	3,892	170,858.80	0.14
148	600877	电科芯片	15,900	170,448.00	0.14
149	600641	万业企业	14,500	170,375.00	0.14
150	000762	西藏矿业	9,400	169,952.00	0.14
151	300623	捷捷微电	9,800	169,540.00	0.14
152	600587	新华医疗	10,770	169,519.80	0.14
153	000902	新洋丰	14,200	168,554.00	0.14
154	300705	九典制药	6,300	168,462.00	0.14
155	002100	天康生物	24,200	167,706.00	0.14
156	300525	博思软件	13,200	167,640.00	0.14
157	688088	虹软科技	5,798	167,330.28	0.14
158	600850	电科数字	9,220	166,882.00	0.14
159	000970	中科三环	21,700	166,005.00	0.14
160	300757	罗博特科	1,900	165,965.00	0.14
161	300229	拓尔思	12,300	165,189.00	0.14
162	600601	方正科技	55,000	165,000.00	0.14
163	002747	埃斯顿	11,600	164,952.00	0.14
164	300034	钢研高纳	10,380	164,938.20	0.14

165	002617	露笑科技	34,300	164,640.00	0.14
166	300761	立华股份	7,260	164,366.40	0.14
167	002701	奥瑞金	39,500	164,320.00	0.14
168	001696	宗申动力	15,400	163,856.00	0.14
169	300075	数字政通	11,100	163,725.00	0.14
170	600216	浙江医药	14,900	163,602.00	0.14
171	300777	中简科技	7,600	163,400.00	0.14
172	603279	景津装备	7,500	162,675.00	0.14
173	603565	中谷物流	18,585	162,432.90	0.14
174	600064	南京高科	26,700	162,069.00	0.14
175	002003	伟星股份	12,900	161,895.00	0.14
176	601860	紫金银行	64,600	161,500.00	0.13
177	600420	国药现代	15,100	161,268.00	0.13
178	603477	巨星农牧	5,600	160,720.00	0.13
179	000927	中国铁物	67,500	160,650.00	0.13
180	600269	赣粤高速	31,000	160,270.00	0.13
181	601137	博威合金	10,500	160,020.00	0.13
182	002036	联创电子	23,700	159,975.00	0.13
183	688333	铂力特	3,283	159,061.35	0.13
184	600602	云赛智联	14,400	158,976.00	0.13
185	600596	新安股份	20,857	158,513.20	0.13
186	600552	凯盛科技	16,800	158,424.00	0.13
187	600456	宝钛股份	6,200	158,286.00	0.13
188	000917	电广传媒	31,300	158,065.00	0.13
189	600971	恒源煤电	13,200	157,608.00	0.13
190	603871	嘉友国际	8,900	157,441.00	0.13
191	000758	中色股份	30,900	156,972.00	0.13
192	601678	滨化股份	45,100	156,948.00	0.13
193	688596	正帆科技	4,750	156,750.00	0.13
194	300068	南都电源	18,900	156,492.00	0.13
195	601187	厦门银行	29,300	156,169.00	0.13
196	002541	鸿路钢构	9,200	156,124.00	0.13
197	688498	源杰科技	1,190	155,878.10	0.13
198	300457	赢合科技	8,700	155,121.00	0.13
199	603766	隆鑫通用	22,800	154,584.00	0.13
200	600595	中孚实业	61,800	153,882.00	0.13
201	000012	南玻 A	30,500	153,720.00	0.13
202	002839	张家港行	38,200	153,564.00	0.13
203	300036	超图软件	11,000	153,560.00	0.13
204	600273	嘉化能源	21,500	153,510.00	0.13
205	603323	苏农银行	31,800	152,958.00	0.13
206	601777	力帆科技	39,800	152,832.00	0.13
207	600179	安通控股	65,300	152,149.00	0.13

208	603027	千禾味业	11,420	151,886.00	0.13
209	600562	国睿科技	11,100	151,626.00	0.13
210	300482	万孚生物	6,200	151,280.00	0.13
211	002335	科华数据	7,100	150,023.00	0.13
212	600120	浙江东方	44,900	149,966.00	0.13
213	600320	振华重工	43,800	149,796.00	0.13
214	300415	伊之密	7,200	149,616.00	0.12
215	300910	瑞丰新材	3,420	149,522.40	0.12
216	300236	上海新阳	4,800	149,472.00	0.12
217	600633	浙数文化	16,900	148,889.00	0.12
218	603678	火炬电子	6,000	148,140.00	0.12
219	600246	万通发展	22,000	147,840.00	0.12
220	300101	振芯科技	10,000	147,700.00	0.12
221	002737	葵花药业	6,300	147,294.00	0.12
222	002597	金禾实业	7,400	147,186.00	0.12
223	002416	爱施德	16,600	146,910.00	0.12
224	300130	新国都	8,800	146,432.00	0.12
225	002091	江苏国泰	21,500	146,415.00	0.12
226	000650	仁和药业	24,800	146,320.00	0.12
227	603599	广信股份	12,060	146,287.80	0.12
228	600116	三峡水利	21,200	146,280.00	0.12
229	002237	恒邦股份	12,700	146,177.00	0.12
230	600577	精达股份	36,800	146,096.00	0.12
231	600446	金证股份	14,700	145,971.00	0.12
232	000737	北方铜业	15,700	145,696.00	0.12
233	600428	中远海特	23,800	145,656.00	0.12
234	300327	中颖电子	7,400	145,632.00	0.12
235	002075	沙钢股份	38,600	145,522.00	0.12
236	603997	继峰股份	14,200	145,266.00	0.12
237	300303	聚飞光电	29,800	144,828.00	0.12
238	688139	海尔生物	3,863	143,703.60	0.12
239	000829	天音控股	15,800	143,464.00	0.12
240	600621	华鑫股份	11,700	143,442.00	0.12
241	688408	中信博	1,556	143,276.48	0.12
242	300319	麦捷科技	15,300	142,749.00	0.12
243	601778	晶科科技	62,600	142,728.00	0.12
244	688062	迈威生物	4,930	142,674.20	0.12
245	600210	紫江企业	26,700	142,044.00	0.12
246	000685	中山公用	19,700	142,037.00	0.12
247	600395	盘江股份	23,600	141,836.00	0.12
248	688789	宏华数科	1,314	141,649.20	0.12
249	603358	华达科技	4,900	141,365.00	0.12
250	603220	中贝通信	5,200	141,232.00	0.12

251	002048	宁波华翔	10,900	141,046.00	0.12
252	000657	中钨高新	15,410	140,847.40	0.12
253	603108	润达医疗	9,300	140,802.00	0.12
254	300026	红日药业	46,000	140,300.00	0.12
255	002396	星网锐捷	10,600	140,026.00	0.12
256	000028	国药一致	4,340	139,878.20	0.12
257	002011	盾安环境	14,200	139,586.00	0.12
258	600986	浙文互联	33,200	139,440.00	0.12
259	301039	中集车辆	16,200	139,320.00	0.12
260	002020	京新药业	13,300	139,251.00	0.12
261	600782	新钢股份	41,800	138,776.00	0.12
262	002698	博实股份	11,300	138,651.00	0.12
263	002192	融捷股份	4,600	138,092.00	0.12
264	688639	华恒生物	1,804	137,807.56	0.12
265	000676	智度股份	22,700	137,789.00	0.12
266	688575	亚辉龙	5,895	137,471.40	0.11
267	300674	宇信科技	12,400	137,392.00	0.11
268	002706	良信股份	20,000	137,200.00	0.11
269	600645	中源协和	8,500	136,850.00	0.11
270	000420	吉林化纤	43,300	136,828.00	0.11
271	603690	至纯科技	5,940	136,679.40	0.11
272	600409	三友化工	27,200	136,544.00	0.11
273	600459	贵研铂业	10,100	136,451.00	0.11
274	600717	天津港	31,900	136,213.00	0.11
275	300035	中科电气	15,900	135,309.00	0.11
276	600072	中船科技	10,000	135,200.00	0.11
277	002171	楚江新材	20,500	135,095.00	0.11
278	000801	四川九洲	13,500	135,000.00	0.11
279	300284	苏交科	16,700	134,936.00	0.11
280	600328	中盐化工	19,660	134,867.60	0.11
281	688208	道通科技	5,570	134,459.80	0.11
282	001301	尚太科技	3,100	133,982.00	0.11
283	002539	云图控股	18,700	133,331.00	0.11
284	300773	拉卡拉	10,700	133,001.00	0.11
285	300170	汉得信息	21,600	132,624.00	0.11
286	600575	淮河能源	34,000	132,260.00	0.11
287	300244	迪安诊断	11,000	132,000.00	0.11
288	600252	中恒集团	60,700	131,719.00	0.11
289	002004	华邦健康	34,600	131,480.00	0.11
290	600267	海正药业	18,700	131,274.00	0.11
291	601028	玉龙股份	10,500	131,250.00	0.11
292	601963	重庆银行	16,900	130,975.00	0.11
293	300747	锐科激光	7,350	130,462.50	0.11

294	002948	青岛银行	38,700	130,419.00	0.11
295	603308	应流股份	10,500	130,410.00	0.11
296	600864	哈投股份	27,400	130,150.00	0.11
297	000969	安泰科技	16,400	130,052.00	0.11
298	688116	天奈科技	5,620	129,709.60	0.11
299	001309	德明利	1,500	129,600.00	0.11
300	600295	鄂尔多斯	13,060	129,555.20	0.11
301	600888	新疆众和	18,300	129,381.00	0.11
302	002099	海翔药业	25,300	129,283.00	0.11
303	600158	中体产业	16,800	129,192.00	0.11
304	002351	漫步者	9,800	128,870.00	0.11
305	688289	圣湘生物	7,318	128,650.44	0.11
306	300470	中密控股	3,800	128,478.00	0.11
307	002324	普利特	15,000	128,250.00	0.11
308	600037	歌华有线	21,400	127,972.00	0.11
309	300079	数码视讯	31,500	127,890.00	0.11
310	300576	容大感光	3,500	127,855.00	0.11
311	688018	乐鑫科技	1,295	127,790.60	0.11
312	600933	爱柯迪	8,600	127,194.00	0.11
313	002212	天融信	26,100	127,107.00	0.11
314	600586	金晶科技	21,900	127,020.00	0.11
315	300618	寒锐钴业	4,800	126,960.00	0.11
316	000915	华特达因	4,200	126,672.00	0.11
317	600688	上海石化	48,500	126,585.00	0.11
318	600976	健民集团	2,500	126,250.00	0.11
319	002906	华阳集团	4,700	125,772.00	0.11
320	000821	京山轻机	11,100	125,763.00	0.11
321	300109	新开源	10,850	125,643.00	0.10
322	300188	国投智能	11,300	125,543.00	0.10
323	000681	视觉中国	10,900	125,350.00	0.10
324	603026	石大胜华	3,700	125,060.00	0.10
325	300166	东方国信	20,400	124,848.00	0.10
326	002061	浙江交科	34,120	124,538.00	0.10
327	601311	骆驼股份	15,500	124,310.00	0.10
328	002428	云南锗业	11,400	123,804.00	0.10
329	600138	中青旅	12,800	123,648.00	0.10
330	300685	艾德生物	7,000	123,480.00	0.10
331	000727	冠捷科技	59,900	123,394.00	0.10
332	600259	广晟有色	4,500	123,030.00	0.10
333	002643	万润股份	12,300	123,000.00	0.10
334	600480	凌云股份	12,500	122,875.00	0.10
335	603267	鸿远电子	3,600	122,760.00	0.10
336	002079	苏州固锝	14,400	122,688.00	0.10

337	688016	心脉医疗	1,249	122,464.45	0.10
338	002123	梦网科技	17,400	122,322.00	0.10
339	002174	游族网络	16,100	122,199.00	0.10
340	688110	东芯股份	6,403	122,105.21	0.10
341	300678	中科信息	4,600	121,992.00	0.10
342	601369	陕鼓动力	15,200	121,904.00	0.10
343	002154	报喜鸟	22,400	121,856.00	0.10
344	000552	甘肃能化	35,000	121,450.00	0.10
345	600211	西藏药业	3,720	121,197.60	0.10
346	600720	祁连山	13,600	121,040.00	0.10
347	300570	太辰光	3,700	120,842.00	0.10
348	600125	铁龙物流	20,200	120,594.00	0.10
349	601702	华峰铝业	6,600	120,516.00	0.10
350	301050	雷电微力	2,500	120,400.00	0.10
351	600248	陕建股份	33,100	120,153.00	0.10
352	601718	际华集团	48,400	120,032.00	0.10
353	600557	康缘药业	7,600	119,320.00	0.10
354	002023	海特高新	13,000	118,950.00	0.10
355	600597	光明乳业	15,300	118,881.00	0.10
356	000429	粤高速 A	11,400	118,674.00	0.10
357	002010	传化智联	30,900	118,656.00	0.10
358	002214	大立科技	10,500	118,440.00	0.10
359	000555	神州信息	12,700	118,364.00	0.10
360	300655	晶瑞电材	16,420	118,224.00	0.10
361	603063	禾望电气	7,700	118,041.00	0.10
362	002292	奥飞娱乐	19,700	117,806.00	0.10
363	002254	泰和新材	13,300	117,705.00	0.10
364	300185	通裕重工	68,300	117,476.00	0.10
365	688518	联赢激光	7,030	117,401.00	0.10
366	300855	图南股份	4,440	117,393.60	0.10
367	600509	天富能源	21,300	117,363.00	0.10
368	600055	万东医疗	9,500	117,325.00	0.10
369	601101	昊华能源	12,700	116,713.00	0.10
370	600063	皖维高新	33,100	116,512.00	0.10
371	002038	双鹭药业	15,800	116,446.00	0.10
372	688556	高测股份	9,785	116,343.65	0.10
373	002233	塔牌集团	15,900	116,229.00	0.10
374	002215	诺普信	15,600	116,220.00	0.10
375	002727	一心堂	7,700	116,193.00	0.10
376	600507	方大特钢	31,000	115,940.00	0.10
377	688100	威胜信息	3,039	115,937.85	0.10
378	002315	焦点科技	4,300	115,928.00	0.10
379	600206	有研新材	13,000	115,700.00	0.10

380	300398	飞凯材料	9,400	115,620.00	0.10
381	002276	万马股份	16,100	115,437.00	0.10
382	000065	北方国际	11,100	115,107.00	0.10
383	000090	天健集团	28,600	114,972.00	0.10
384	002239	奥特佳	49,900	114,770.00	0.10
385	603699	纽威股份	6,700	114,704.00	0.10
386	002446	盛路通信	20,300	114,695.00	0.10
387	600635	大众公用	42,700	114,436.00	0.10
388	688409	富创精密	3,096	114,366.24	0.10
389	300077	国民技术	13,100	114,363.00	0.10
390	300343	联创股份	24,000	114,240.00	0.10
391	002043	兔宝宝	11,000	114,070.00	0.10
392	600502	安徽建工	26,500	113,950.00	0.10
393	000811	冰轮环境	11,800	113,870.00	0.10
394	000582	北部湾港	15,300	113,832.00	0.10
395	300783	三只松鼠	5,200	113,724.00	0.09
396	600059	古越龙山	14,300	113,542.00	0.09
397	002468	申通快递	13,500	113,400.00	0.09
398	002761	浙江建投	14,500	113,245.00	0.09
399	300693	盛弘股份	5,400	113,076.00	0.09
400	002183	怡亚通	39,800	113,032.00	0.09
401	002840	华统股份	6,800	112,812.00	0.09
402	603920	世运电路	5,700	112,518.00	0.09
403	000049	德赛电池	4,790	112,325.50	0.09
404	002815	崇达技术	11,900	111,622.00	0.09
405	600006	东风汽车	17,400	111,186.00	0.09
406	300348	长亮科技	16,300	111,166.00	0.09
407	000848	承德露露	14,100	110,826.00	0.09
408	300151	昌红科技	7,000	110,740.00	0.09
409	600961	株冶集团	11,700	110,448.00	0.09
410	300598	诚迈科技	3,930	110,354.40	0.09
411	300620	光库科技	3,000	110,340.00	0.09
412	603197	保隆科技	3,500	110,250.00	0.09
413	688123	聚辰股份	1,812	110,223.96	0.09
414	300770	新媒股份	3,300	110,154.00	0.09
415	300180	华峰超纤	31,200	110,136.00	0.09
416	601952	苏垦农发	12,200	110,044.00	0.09
417	603281	江瀚新材	4,900	110,005.00	0.09
418	600740	山西焦化	28,000	109,760.00	0.09
419	603612	索通发展	8,600	109,736.00	0.09
420	002635	安洁科技	7,100	109,624.00	0.09
421	600729	重庆百货	4,900	109,564.00	0.09
422	002354	天娱数科	36,600	109,434.00	0.09

423	600478	科力远	29,007	109,356.39	0.09
424	002960	青鸟消防	8,630	109,083.20	0.09
425	688403	汇成股份	12,861	109,061.28	0.09
426	000603	盛达资源	9,200	108,836.00	0.09
426	600531	豫光金铅	16,900	108,836.00	0.09
427	000913	钱江摩托	6,900	108,744.00	0.09
428	603033	三维股份	9,293	108,728.10	0.09
429	600197	伊力特	6,100	108,641.00	0.09
430	300113	顺网科技	10,600	108,544.00	0.09
431	600305	恒顺醋业	15,000	108,450.00	0.09
432	600773	西藏城投	10,500	108,360.00	0.09
433	002726	龙大美食	16,500	108,240.00	0.09
434	300463	迈克生物	9,500	108,110.00	0.09
435	002895	川恒股份	5,900	108,029.00	0.09
436	002421	达实智能	46,300	107,879.00	0.09
437	600017	日照港	40,300	107,601.00	0.09
438	600185	格力地产	25,300	107,525.00	0.09
439	600757	长江传媒	13,300	107,198.00	0.09
440	688007	光峰科技	6,653	107,113.30	0.09
441	600266	城建发展	28,500	106,590.00	0.09
442	601163	三角轮胎	7,000	106,540.00	0.09
443	300827	上能电气	4,759	106,411.24	0.09
444	000810	创维数字	12,400	106,392.00	0.09
445	600550	保变电气	20,400	106,284.00	0.09
446	600012	皖通高速	7,600	106,172.00	0.09
447	002006	精工科技	7,900	106,018.00	0.09
448	000901	航天科技	12,100	105,996.00	0.09
449	000488	晨鸣纸业	30,500	105,530.00	0.09
450	002081	金螳螂	34,800	105,444.00	0.09
451	000966	长源电力	23,900	105,399.00	0.09
452	300065	海兰信	15,900	105,099.00	0.09
453	601890	亚星锚链	14,900	105,045.00	0.09
454	603368	柳药集团	6,000	105,000.00	0.09
455	688106	金宏气体	5,990	104,944.80	0.09
456	601200	上海环境	12,300	104,550.00	0.09
457	601208	东材科技	14,400	104,544.00	0.09
458	688366	昊海生科	1,693	104,424.24	0.09
459	600797	浙大网新	22,500	104,175.00	0.09
460	688739	成大生物	4,289	103,965.36	0.09
461	002458	益生股份	12,000	103,920.00	0.09
462	300432	富临精工	16,100	103,684.00	0.09
463	002226	江南化工	23,100	103,488.00	0.09
464	002649	博彦科技	13,000	103,480.00	0.09

465	300123	亚光科技	22,300	103,472.00	0.09
466	300031	宝通科技	7,200	103,464.00	0.09
467	603100	川仪股份	4,400	103,444.00	0.09
468	000928	中钢国际	18,600	103,230.00	0.09
469	600776	东方通信	10,500	103,215.00	0.09
470	002467	二六三	30,900	103,206.00	0.09
471	002511	中顺洁柔	14,900	103,108.00	0.09
472	603306	华懋科技	5,700	102,999.00	0.09
473	688321	微芯生物	5,824	102,502.40	0.09
474	301035	润丰股份	2,300	102,442.00	0.09
475	300856	科思股份	3,200	102,432.00	0.09
476	300171	东富龙	8,600	102,254.00	0.09
477	603008	喜临门	5,900	102,247.00	0.09
478	300428	立中集团	5,500	102,245.00	0.09
479	600996	贵广网络	13,300	102,144.00	0.09
480	601528	瑞丰银行	21,570	101,810.40	0.09
481	603919	金徽酒	5,600	101,752.00	0.08
482	603713	密尔克卫	1,900	101,688.00	0.08
483	000503	国新健康	15,200	101,384.00	0.08
484	300027	华谊兄弟	61,000	101,260.00	0.08
485	600869	远东股份	29,000	101,210.00	0.08
486	600033	福建高速	30,200	101,170.00	0.08
487	002681	奋达科技	27,700	101,105.00	0.08
488	300379	东方通	12,500	101,000.00	0.08
489	688083	中望软件	1,389	100,869.18	0.08
490	300596	利安隆	3,700	100,381.00	0.08
491	688798	艾为电子	1,772	100,330.64	0.08
492	301071	力量钻石	3,620	100,310.20	0.08
493	300232	洲明科技	19,200	100,224.00	0.08
494	000600	建投能源	15,900	100,170.00	0.08
495	002097	山河智能	16,600	100,098.00	0.08
496	300224	正海磁材	10,800	100,008.00	0.08
497	000550	江铃汽车	4,600	99,866.00	0.08
498	601326	秦港股份	31,500	99,855.00	0.08
499	000990	诚志股份	13,400	99,696.00	0.08
500	300129	泰胜风能	14,600	99,572.00	0.08
501	600151	航天机电	22,000	99,440.00	0.08
502	300634	彩讯股份	5,900	99,297.00	0.08
503	603128	华贸物流	17,200	99,244.00	0.08
504	300725	药石科技	3,700	99,049.00	0.08
505	688183	生益电子	5,110	99,031.80	0.08
506	300416	苏试试验	7,700	99,022.00	0.08
507	603888	新华网	4,600	98,946.00	0.08

508	600007	中国国贸	4,500	98,820.00	0.08
509	002127	南极电商	38,000	98,800.00	0.08
509	600675	中华企业	40,000	98,800.00	0.08
510	300352	北信源	25,700	98,688.00	0.08
511	002705	新宝股份	7,000	98,490.00	0.08
512	300233	金城医药	6,600	98,472.00	0.08
513	603039	泛微网络	3,100	98,456.00	0.08
514	300406	九强生物	6,400	98,432.00	0.08
515	000837	秦川机床	13,300	97,888.00	0.08
516	601519	大智慧	17,600	97,856.00	0.08
517	601619	嘉泽新能	32,200	97,566.00	0.08
518	603881	数据港	7,672	97,511.12	0.08
519	688503	聚和材料	3,470	97,507.00	0.08
520	300366	创意信息	13,400	97,016.00	0.08
521	300393	中来股份	16,800	96,936.00	0.08
522	002626	金达威	6,700	96,815.00	0.08
523	600997	开滦股份	14,100	96,726.00	0.08
524	300602	飞荣达	6,400	96,704.00	0.08
525	002583	海能达	23,700	96,459.00	0.08
526	300455	航天智装	7,800	96,408.00	0.08
527	002929	润建股份	3,300	96,063.00	0.08
528	002498	汉缆股份	29,000	95,410.00	0.08
529	600623	华谊集团	16,500	95,370.00	0.08
530	300593	新雷能	9,580	95,225.20	0.08
531	001914	招商积余	9,500	95,190.00	0.08
532	688559	海目星	2,893	95,150.77	0.08
533	600313	农发种业	16,900	94,471.00	0.08
534	002859	洁美科技	4,700	94,376.00	0.08
535	600110	诺德股份	30,900	94,245.00	0.08
536	300260	新莱应材	4,500	94,230.00	0.08
537	000767	晋控电力	40,400	94,132.00	0.08
538	300451	创业慧康	27,200	94,112.00	0.08
539	603936	博敏电子	11,200	94,080.00	0.08
540	002605	姚记科技	4,600	93,932.00	0.08
541	600389	江山股份	6,650	93,831.50	0.08
542	688630	芯碁微装	1,497	93,667.29	0.08
543	688192	迪哲医药	2,538	93,499.92	0.08
544	002545	东方铁塔	13,700	93,297.00	0.08
545	002777	久远银海	6,200	92,938.00	0.08
546	600458	时代新材	9,200	92,920.00	0.08
547	600710	苏美达	11,400	92,910.00	0.08
548	002847	盐津铺子	2,170	92,810.90	0.08
549	000756	新华制药	6,400	92,672.00	0.08

550	003006	百亚股份	3,900	92,430.00	0.08
551	301219	腾远钴业	2,410	92,206.60	0.08
552	002537	海联金汇	17,800	92,026.00	0.08
553	000719	中原传媒	9,100	92,001.00	0.08
554	600649	城投控股	27,700	91,964.00	0.08
555	002274	华昌化工	12,300	91,266.00	0.08
556	603876	鼎胜新材	9,840	91,216.80	0.08
557	300841	康华生物	1,800	91,152.00	0.08
558	300087	荃银高科	14,740	91,093.20	0.08
559	002550	千红制药	16,900	91,091.00	0.08
560	002928	华夏航空	14,300	90,662.00	0.08
561	002077	大港股份	7,600	90,592.00	0.08
562	000950	重药控股	18,600	90,582.00	0.08
563	600787	中储股份	18,800	90,428.00	0.08
564	300257	开山股份	8,900	89,890.00	0.08
565	600496	精工钢构	35,100	89,856.00	0.08
566	688279	峰昭科技	810	89,829.00	0.08
567	301171	易点天下	6,100	89,670.00	0.07
568	603533	掌阅科技	4,800	89,616.00	0.07
569	603567	珍宝岛	8,500	89,505.00	0.07
570	002108	沧州明珠	29,200	89,352.00	0.07
571	300772	运达股份	9,300	89,280.00	0.07
572	300263	隆华科技	15,900	89,040.00	0.07
573	300671	富满微	3,500	88,970.00	0.07
574	600366	宁波韵升	17,000	88,740.00	0.07
575	601801	皖新传媒	12,800	88,704.00	0.07
576	603348	文灿股份	3,200	88,608.00	0.07
577	688141	杰华特	5,480	88,556.80	0.07
578	000059	华锦股份	21,100	88,409.00	0.07
579	000735	罗牛山	20,400	88,332.00	0.07
580	603866	桃李面包	17,400	88,218.00	0.07
581	600490	鹏欣资源	33,900	88,140.00	0.07
582	688318	财富趋势	1,112	87,747.92	0.07
583	600508	上海能源	6,200	87,730.00	0.07
584	300687	赛意信息	6,300	87,696.00	0.07
585	600751	海航科技	39,500	87,690.00	0.07
586	003021	兆威机电	1,900	87,685.00	0.07
587	603583	捷昌驱动	4,300	87,634.00	0.07
588	300409	道氏技术	10,200	87,312.00	0.07
589	688262	国芯科技	4,793	87,280.53	0.07
590	300726	宏达电子	3,800	86,640.00	0.07
591	688322	奥比中光	3,242	86,593.82	0.07
592	605599	菜百股份	6,800	86,564.00	0.07

593	300226	上海钢联	5,100	86,394.00	0.07
594	605333	沪光股份	3,100	86,335.00	0.07
595	600963	岳阳林纸	23,500	86,245.00	0.07
596	002925	盈趣科技	6,800	86,156.00	0.07
597	002390	信邦制药	26,000	86,060.00	0.07
598	002985	北摩高科	3,900	85,917.00	0.07
599	600556	天下秀	23,600	85,904.00	0.07
600	603328	依顿电子	10,900	85,674.00	0.07
601	600477	杭萧钢构	36,700	85,511.00	0.07
602	002060	广东建工	24,900	85,158.00	0.07
603	300363	博腾股份	7,100	84,845.00	0.07
604	301015	百洋医药	3,600	84,708.00	0.07
605	002125	湘潭电化	8,700	84,651.00	0.07
606	002434	万里扬	17,200	84,280.00	0.07
607	002258	利尔化学	10,500	84,210.00	0.07
608	600195	中牧股份	11,200	83,888.00	0.07
609	002219	新里程	45,100	83,886.00	0.07
610	000088	盐田港	18,500	83,805.00	0.07
611	605376	博迁新材	3,700	83,509.00	0.07
612	002216	三全食品	7,600	83,448.00	0.07
613	600966	博汇纸业	17,400	83,172.00	0.07
614	688658	悦康药业	4,660	83,134.40	0.07
615	000795	英洛华	15,000	83,100.00	0.07
616	300119	瑞普生物	6,100	83,082.00	0.07
617	601969	海南矿业	13,100	83,054.00	0.07
618	000828	东莞控股	9,200	82,892.00	0.07
619	001287	中电港	5,000	82,650.00	0.07
620	603733	仙鹤股份	4,700	82,626.00	0.07
621	601882	海天精工	3,600	82,476.00	0.07
622	600775	南京熊猫	10,300	82,400.00	0.07
623	300332	天壕能源	15,500	82,305.00	0.07
624	301095	广立微	2,000	82,240.00	0.07
625	002697	红旗连锁	17,700	81,951.00	0.07
626	688362	甬矽电子	4,200	81,732.00	0.07
627	600861	北京人力	5,000	81,600.00	0.07
628	605507	国邦医药	4,900	81,585.00	0.07
629	300723	一品红	4,150	81,547.50	0.07
630	601595	上海电影	4,100	81,098.00	0.07
631	002191	劲嘉股份	22,400	80,864.00	0.07
632	000048	京基智农	5,900	80,771.00	0.07
633	688439	振华风光	1,215	80,736.75	0.07
634	601908	京运通	31,900	80,707.00	0.07
635	002349	精华制药	12,300	80,688.00	0.07

636	600835	上海机电	7,000	80,570.00	0.07
637	600163	中闽能源	16,700	80,494.00	0.07
638	000935	四川双马	6,700	80,467.00	0.07
639	600073	上海梅林	14,600	80,446.00	0.07
640	600169	太原重工	43,900	80,337.00	0.07
641	688700	东威科技	3,050	79,940.50	0.07
642	688270	臻镭科技	3,060	79,866.00	0.07
643	603043	广州酒家	5,000	79,850.00	0.07
644	688598	金博股份	2,821	79,834.30	0.07
645	603896	寿仙谷	3,400	79,798.00	0.07
646	603383	顶点软件	2,480	79,533.60	0.07
647	300261	雅本化学	14,900	78,970.00	0.07
647	600929	雪天盐业	14,900	78,970.00	0.07
648	300663	科蓝软件	8,000	78,960.00	0.07
649	300203	聚光科技	7,800	78,702.00	0.07
650	002158	汉钟精机	4,700	78,584.00	0.07
651	603638	艾迪精密	5,600	78,568.00	0.07
652	600223	鲁商发展	11,100	78,477.00	0.07
653	001213	中铁特货	19,800	78,210.00	0.07
654	002993	奥海科技	2,100	78,120.00	0.07
655	300613	富瀚微	2,370	77,996.70	0.07
656	301047	义翘神州	1,300	77,935.00	0.07
657	002250	联化科技	16,200	77,760.00	0.06
658	601038	一拖股份	4,900	77,469.00	0.06
659	600075	新疆天业	22,400	77,280.00	0.06
660	001270	铖昌科技	2,102	77,185.44	0.06
661	300323	华灿光电	17,700	76,995.00	0.06
662	002320	海峡股份	14,900	76,884.00	0.06
663	300443	金雷股份	5,000	76,650.00	0.06
664	688066	航天宏图	4,303	76,593.40	0.06
665	300660	江苏雷利	3,000	76,560.00	0.06
666	688127	蓝特光学	4,150	76,318.50	0.06
667	600391	航发科技	5,000	76,250.00	0.06
668	600812	华北制药	18,500	76,220.00	0.06
669	688158	优刻得	7,449	76,203.27	0.06
670	000627	天茂集团	43,500	76,125.00	0.06
670	601107	四川成渝	14,500	76,125.00	0.06
671	688696	极米科技	984	76,004.16	0.06
672	300039	上海凯宝	14,200	75,970.00	0.06
673	300085	银之杰	9,400	75,952.00	0.06
674	002101	广东鸿图	7,200	75,816.00	0.06
675	601606	长城军工	7,900	75,524.00	0.06
676	002585	双星新材	15,200	75,392.00	0.06

677	002051	中工国际	10,800	75,168.00	0.06
678	603801	志邦家居	5,740	75,079.20	0.06
679	603398	沐邦高科	4,800	74,928.00	0.06
680	601921	浙版传媒	9,800	74,872.00	0.06
681	601515	东峰集团	20,380	74,387.00	0.06
682	600682	南京新百	14,900	74,351.00	0.06
683	600780	通宝能源	12,600	74,340.00	0.06
684	000712	锦龙股份	9,900	74,250.00	0.06
684	688167	炬光科技	1,350	74,250.00	0.06
685	002283	天润工业	17,300	74,217.00	0.06
686	002267	陕天然气	9,800	74,088.00	0.06
687	600335	国机汽车	12,800	73,856.00	0.06
688	600639	浦东金桥	7,200	73,512.00	0.06
689	603566	普莱柯	5,400	73,332.00	0.06
690	002194	武汉凡谷	9,100	73,255.00	0.06
691	600874	创业环保	13,100	73,229.00	0.06
692	002967	广电计量	6,200	73,160.00	0.06
693	000061	农产品	15,000	72,900.00	0.06
694	600449	宁夏建材	6,200	72,850.00	0.06
695	002461	珠江啤酒	9,800	72,716.00	0.06
696	601949	中国出版	12,300	72,693.00	0.06
697	000557	西部创业	19,300	72,568.00	0.06
698	002053	云南能投	6,000	72,540.00	0.06
699	300587	天铁股份	17,951	72,522.04	0.06
700	301363	美好医疗	2,500	72,500.00	0.06
701	301155	海力风电	1,800	72,414.00	0.06
702	002204	大连重工	16,900	72,163.00	0.06
703	002243	力合科创	13,000	71,890.00	0.06
704	601609	金田股份	12,700	71,882.00	0.06
705	301238	瑞泰新材	4,800	71,856.00	0.06
706	300821	东岳硅材	10,500	71,820.00	0.06
707	600648	外高桥	8,100	71,766.00	0.06
708	688389	普门科技	4,408	71,674.08	0.06
709	000498	山东路桥	13,700	71,651.00	0.06
710	601096	宏盛华源	17,500	71,575.00	0.06
711	688690	纳微科技	4,110	71,390.70	0.06
712	603730	岱美股份	7,161	71,180.34	0.06
713	002891	中宠股份	3,400	70,958.00	0.06
714	002987	京北方	6,732	70,887.96	0.06
715	301175	中科环保	16,100	70,679.00	0.06
716	000567	海德股份	12,581	70,579.41	0.06
717	000869	张裕 A	3,300	70,455.00	0.06
718	002291	遥望科技	16,300	70,090.00	0.06

719	002941	新疆交建	7,000	69,860.00	0.06
720	600882	妙可蓝多	5,600	69,832.00	0.06
721	601069	西部黄金	6,000	69,780.00	0.06
722	603327	福蓉科技	5,410	69,734.90	0.06
723	603118	共进股份	10,400	69,680.00	0.06
724	001337	四川黄金	3,000	69,630.00	0.06
725	002163	海南发展	12,700	69,596.00	0.06
726	002068	黑猫股份	9,800	69,580.00	0.06
727	300358	楚天科技	9,300	69,192.00	0.06
728	002242	九阳股份	6,600	69,168.00	0.06
729	002612	朗姿股份	5,000	69,100.00	0.06
730	605020	永和股份	3,600	69,048.00	0.06
731	688388	嘉元科技	7,066	68,893.50	0.06
732	603187	海容冷链	5,900	68,794.00	0.06
733	688239	航宇科技	1,972	68,625.60	0.06
734	002488	金固股份	15,600	68,484.00	0.06
735	000885	城发环境	5,600	68,152.00	0.06
736	603595	东尼电子	3,300	67,947.00	0.06
737	300527	中船应急	10,500	67,935.00	0.06
738	301087	可孚医疗	2,000	67,800.00	0.06
739	600217	中再资环	18,000	67,680.00	0.06
740	603171	税友股份	2,500	67,600.00	0.06
741	000688	国城矿业	7,100	67,592.00	0.06
742	002581	未名医药	7,000	67,550.00	0.06
743	000736	中交地产	7,600	67,488.00	0.06
744	000968	蓝焰控股	10,600	67,416.00	0.06
744	605123	派克新材	1,200	67,416.00	0.06
745	600643	爱建集团	17,800	67,106.00	0.06
746	000881	中广核技	10,400	66,976.00	0.06
747	300820	英杰电气	1,700	66,878.00	0.06
748	603301	振德医疗	3,200	66,752.00	0.06
749	603025	大豪科技	4,820	66,612.40	0.06
750	603466	风语筑	7,750	66,185.00	0.06
751	603169	兰石重装	14,700	66,150.00	0.06
752	301316	慧博云通	4,500	66,060.00	0.06
753	601033	永兴股份	4,075	65,934.00	0.06
754	300737	科顺股份	15,300	65,790.00	0.05
755	301031	中熔电气	800	65,760.00	0.05
756	600225	卓朗科技	37,600	65,424.00	0.05
757	000672	上峰水泥	10,600	64,872.00	0.05
758	000791	甘肃能源	10,500	64,785.00	0.05
759	300143	盈康生命	8,600	64,758.00	0.05
760	002746	仙坛股份	11,300	64,749.00	0.05

761	688508	芯朋微	1,773	64,484.01	0.05
762	002646	天佑德酒	6,300	64,449.00	0.05
763	002096	易普力	5,400	64,260.00	0.05
764	688351	微电生理	2,907	64,070.28	0.05
765	688339	亿华通	2,136	64,037.28	0.05
766	603212	赛伍技术	5,800	64,032.00	0.05
767	688190	云路股份	856	63,951.76	0.05
768	603229	奥翔药业	6,360	63,918.00	0.05
769	600491	龙元建设	23,300	63,842.00	0.05
770	301216	万凯新材	5,700	63,783.00	0.05
771	603299	苏盐井神	6,700	63,650.00	0.05
772	003012	东鹏控股	10,300	62,933.00	0.05
773	688343	云天励飞	2,200	62,810.00	0.05
774	688400	凌云光	3,763	62,766.84	0.05
775	600058	五矿发展	9,500	62,700.00	0.05
776	688298	东方生物	2,309	62,689.35	0.05
777	300579	数字认证	3,200	62,400.00	0.05
778	300369	绿盟科技	12,100	61,831.00	0.05
779	000029	深深房 A	5,800	61,654.00	0.05
780	300850	新强联	4,100	61,582.00	0.05
781	003040	楚天龙	5,000	61,500.00	0.05
782	002034	旺能环境	4,700	61,147.00	0.05
783	688707	振华新材	6,253	60,904.22	0.05
784	601869	长飞光纤	2,500	60,825.00	0.05
785	000597	东北制药	15,700	60,759.00	0.05
786	600651	飞乐音响	22,000	60,720.00	0.05
787	688586	江航装备	6,528	60,710.40	0.05
788	600301	华锡有色	3,000	60,660.00	0.05
789	600662	外服控股	15,100	60,551.00	0.05
790	002378	章源钨业	10,510	60,327.40	0.05
791	002135	东南网架	15,200	60,192.00	0.05
792	002041	登海种业	7,400	59,792.00	0.05
793	600783	鲁信创投	6,400	59,712.00	0.05
794	301078	孩子王	11,800	59,708.00	0.05
795	603915	国茂股份	5,800	59,682.00	0.05
796	000062	深圳华强	6,700	59,630.00	0.05
797	688033	天宜上佳	9,919	59,514.00	0.05
798	301153	中科江南	2,100	59,346.00	0.05
799	300134	大富科技	8,700	59,334.00	0.05
800	000025	特力 A	4,400	59,136.00	0.05
801	300183	东软载波	5,100	59,058.00	0.05
802	603055	台华新材	5,800	58,754.00	0.05
803	002265	建设工业	6,800	58,684.00	0.05

804	002516	旷达科技	16,100	58,604.00	0.05
805	603985	恒润股份	4,900	58,310.00	0.05
806	002190	成飞集成	4,100	57,892.00	0.05
807	300702	天宇股份	3,240	57,769.20	0.05
808	688091	上海谊众	2,557	57,762.63	0.05
809	002302	西部建设	11,100	57,720.00	0.05
810	600810	神马股份	9,300	57,660.00	0.05
811	301268	铭利达	3,700	57,535.00	0.05
812	688097	博众精工	2,703	57,519.84	0.05
813	603636	南威软件	7,400	56,980.00	0.05
814	002088	鲁阳节能	4,700	56,823.00	0.05
815	300267	尔康制药	27,200	56,576.00	0.05
816	688261	东微半导	1,100	56,518.00	0.05
817	600657	信达地产	18,500	56,425.00	0.05
818	002489	浙江永强	23,800	56,406.00	0.05
819	603105	芯能科技	6,400	56,320.00	0.05
820	000517	荣安地产	21,000	56,280.00	0.05
821	000718	苏宁环球	33,300	55,944.00	0.05
822	688711	宏微科技	3,452	55,439.12	0.05
823	603906	龙蟠科技	7,100	55,309.00	0.05
824	603162	海通发展	5,920	55,056.00	0.05
825	001338	永顺泰	5,600	54,880.00	0.05
826	688031	星环科技	1,492	54,771.32	0.05
827	600340	华夏幸福	51,500	54,590.00	0.05
828	000030	富奥股份	11,100	54,501.00	0.05
829	603297	永新光学	900	54,441.00	0.05
830	301291	明阳电气	1,811	54,420.55	0.05
831	300953	震裕科技	1,000	54,200.00	0.05
832	300206	理邦仪器	6,300	54,117.00	0.05
833	688177	百奥泰	2,560	54,067.20	0.05
834	688326	经纬恒润	943	54,062.19	0.05
835	688232	新点软件	2,736	53,953.92	0.05
836	600604	市北高新	15,500	53,630.00	0.04
837	605168	三人行	2,023	53,265.59	0.04
838	600475	华光环能	6,100	53,131.00	0.04
839	688048	长光华芯	1,698	53,045.52	0.04
840	603123	翠微股份	8,900	52,866.00	0.04
841	603113	金能科技	9,600	52,512.00	0.04
842	300768	迪普科技	4,400	52,140.00	0.04
843	603989	艾华集团	3,700	52,022.00	0.04
844	002453	华软科技	12,100	51,909.00	0.04
845	301217	铜冠铜箔	5,400	51,840.00	0.04
846	000016	深康佳 A	24,200	51,546.00	0.04

847	300382	斯莱克	8,700	51,417.00	0.04
848	002913	奥士康	1,900	50,939.00	0.04
849	603609	禾丰股份	7,700	50,358.00	0.04
850	301205	联特科技	800	50,200.00	0.04
851	688336	三生国健	2,460	50,061.00	0.04
852	301246	宏源药业	3,700	49,802.00	0.04
853	301339	通行宝	2,500	49,725.00	0.04
854	300869	康泰医学	3,800	49,666.00	0.04
855	002275	桂林三金	4,000	49,640.00	0.04
856	601015	陕西黑猫	17,700	49,560.00	0.04
857	688432	有研硅	5,110	49,515.90	0.04
858	301239	普瑞眼科	1,400	49,462.00	0.04
859	688105	诺唯赞	2,470	49,424.70	0.04
860	002534	西子洁能	4,900	49,049.00	0.04
861	301293	三博脑科	1,300	48,997.00	0.04
862	688131	皓元医药	2,559	48,953.67	0.04
863	603071	物产环能	3,900	48,867.00	0.04
864	688268	华特气体	946	48,823.06	0.04
865	601886	江河集团	10,000	48,800.00	0.04
866	002782	可立克	4,400	48,752.00	0.04
867	300894	火星人	3,800	48,716.00	0.04
868	002314	南山控股	23,500	48,645.00	0.04
869	603013	亚普股份	3,600	48,492.00	0.04
870	603439	贵州三力	3,800	48,488.00	0.04
871	301498	乖宝宠物	900	48,420.00	0.04
872	688381	帝奥微	2,479	48,290.92	0.04
873	000813	德展健康	23,100	48,048.00	0.04
874	300080	易成新能	16,600	47,808.00	0.04
875	605009	豪悦护理	1,200	47,328.00	0.04
876	301080	百普赛斯	1,350	47,250.00	0.04
877	688023	安恒信息	1,179	47,171.79	0.04
878	601011	宝泰隆	29,200	46,720.00	0.04
879	603693	江苏新能	4,020	46,712.40	0.04
880	300446	航天智造	3,900	46,410.00	0.04
881	001323	慕思股份	1,600	46,032.00	0.04
882	605222	起帆电缆	3,000	46,020.00	0.04
883	688776	国光电气	827	45,815.80	0.04
884	688147	微导纳米	1,830	45,567.00	0.04
885	603877	太平鸟	3,300	45,309.00	0.04
886	603530	神马电力	1,700	45,033.00	0.04
887	600903	贵州燃气	7,200	44,928.00	0.04
888	600691	阳煤化工	26,200	44,802.00	0.04
889	600400	红豆股份	20,400	44,268.00	0.04

890	688484	南芯科技	1,190	44,149.00	0.04
891	603170	宝立食品	3,700	43,956.00	0.04
892	002959	小熊电器	900	43,299.00	0.04
893	688202	美迪西	1,662	43,295.10	0.04
894	603718	海利生物	7,000	43,190.00	0.04
895	603719	良品铺子	3,700	43,179.00	0.04
896	688686	奥普特	672	43,028.16	0.04
897	600618	氯碱化工	4,900	43,022.00	0.04
898	688209	英集芯	3,443	42,727.63	0.04
899	688368	晶丰明源	769	42,602.60	0.04
900	600610	中毅达	10,700	42,586.00	0.04
901	003009	中天火箭	1,100	42,548.00	0.04
902	002991	甘源食品	700	42,455.00	0.04
903	001258	立新能源	6,100	42,273.00	0.04
904	688526	科前生物	2,870	42,160.30	0.04
905	601083	锦江航运	4,400	42,064.00	0.04
906	002978	安宁股份	1,500	41,790.00	0.03
907	688372	伟测科技	1,059	41,650.47	0.03
908	301526	国际复材	12,485	41,575.05	0.03
909	603938	三孚股份	3,520	41,360.00	0.03
910	002901	大博医疗	1,600	41,328.00	0.03
911	603983	丸美股份	1,500	41,295.00	0.03
912	000761	本钢板材	16,300	40,913.00	0.03
913	688146	中船特气	1,370	40,894.50	0.03
914	301069	凯盛新材	3,100	40,641.00	0.03
914	301207	华兰疫苗	2,300	40,641.00	0.03
915	688001	华兴源创	1,791	40,440.78	0.03
916	000019	深粮控股	7,000	40,180.00	0.03
917	301327	华宝新能	700	40,110.00	0.03
918	688206	概伦电子	2,684	39,857.40	0.03
919	688383	新益昌	763	39,759.93	0.03
920	688352	颀中科技	3,380	38,565.80	0.03
921	603995	甬金股份	2,200	38,544.00	0.03
922	688380	中微半导	2,293	38,338.96	0.03
923	603666	亿嘉和	2,400	37,872.00	0.03
924	688337	普源精电	1,500	37,830.00	0.03
925	002911	佛燃能源	4,080	37,291.20	0.03
926	688392	骄成超声	876	37,177.44	0.03
927	300140	节能环境	6,200	37,014.00	0.03
928	603098	森特股份	4,700	36,942.00	0.03
929	002549	凯美特气	7,200	36,792.00	0.03
930	001308	康冠科技	1,630	36,675.00	0.03
931	300741	华宝股份	2,400	36,576.00	0.03

932	688173	希荻微	3,316	36,575.48	0.03
933	688515	裕太微	630	36,540.00	0.03
934	300973	立高食品	1,300	36,517.00	0.03
935	301348	蓝箭电子	1,200	36,468.00	0.03
936	002651	利君股份	6,600	36,234.00	0.03
937	688185	康希诺	876	35,994.84	0.03
938	301325	曼恩斯特	840	35,632.80	0.03
939	301089	拓新药业	1,200	35,604.00	0.03
940	300887	谱尼测试	4,800	35,520.00	0.03
941	603093	南华期货	4,100	35,506.00	0.03
942	002961	瑞达期货	3,200	35,040.00	0.03
943	301367	怡和嘉业	560	34,832.00	0.03
944	001311	多利科技	1,430	34,577.40	0.03
945	002946	新乳业	3,900	34,164.00	0.03
946	688046	药康生物	3,323	33,961.06	0.03
947	000058	深赛格	6,300	33,831.00	0.03
948	601811	新华文轩	2,400	33,624.00	0.03
949	688502	茂莱光学	360	33,483.60	0.03
950	688680	海优新材	1,162	33,395.88	0.03
951	300755	华致酒行	2,400	32,784.00	0.03
952	002990	盛视科技	1,600	32,208.00	0.03
953	001322	箭牌家居	4,400	32,164.00	0.03
954	001269	欧晶科技	1,140	31,692.00	0.03
955	301487	盟固利	1,200	31,032.00	0.03
956	301558	三态股份	3,600	30,204.00	0.03
957	003039	顺控发展	2,400	30,072.00	0.03
958	601022	宁波远洋	3,400	29,988.00	0.03
959	603132	金徽股份	2,100	28,896.00	0.02
960	688128	中国电研	1,639	28,207.19	0.02
961	301371	敷尔佳	900	27,954.00	0.02
962	601068	中铝国际	6,600	27,786.00	0.02
963	688315	诺禾致源	2,530	27,627.60	0.02
964	603489	八方股份	1,020	27,519.60	0.02
965	600403	大有能源	10,500	27,090.00	0.02
966	301511	德福科技	1,800	26,568.00	0.02
967	301559	中集环科	1,800	26,226.00	0.02
968	301090	华润材料	3,900	25,662.00	0.02
969	001236	弘业期货	3,600	25,596.00	0.02
970	002287	奇正藏药	1,300	25,454.00	0.02
971	603057	紫燕食品	1,600	24,512.00	0.02
972	300860	锋尚文化	1,120	23,564.80	0.02
973	301510	固高科技	800	22,200.00	0.02
974	605011	杭州热电	900	21,897.00	0.02

975	688161	威高骨科	992	19,661.44	0.02
976	603103	横店影视	1,400	19,376.00	0.02
977	605365	立达信	1,200	19,044.00	0.02
978	301180	万祥科技	1,200	18,768.00	0.02
979	688152	麒麟信安	478	18,508.16	0.02
980	301262	海看股份	800	18,040.00	0.02
981	601279	英利汽车	4,500	16,785.00	0.01
982	301177	迪阿股份	900	16,740.00	0.01
983	688531	日联科技	360	16,617.60	0.01
984	603075	热威股份	900	15,885.00	0.01
985	001376	百通能源	800	14,896.00	0.01
986	301376	致欧科技	693	14,670.81	0.01
987	301381	赛维时代	600	13,638.00	0.01
988	688433	华曙高科	630	13,141.80	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300630	普利制药	6,600	81,510.00	0.07
2	301589	诺瓦星云	248	46,626.48	0.04
3	301538	骏鼎达	101	9,215.24	0.01
4	301536	星辰科技	222	7,163.94	0.01
5	301566	达利凯普	369	6,261.93	0.01
6	688691	灿芯股份	143	6,078.93	0.01
7	301539	宏鑫科技	301	5,965.82	0.00
8	301591	肯特股份	147	5,436.06	0.00
9	301588	美新科技	206	4,377.50	0.00
10	301587	中瑞股份	156	3,940.56	0.00
11	688695	中创股份	121	3,817.55	0.00
12	001389	广合科技	103	3,559.68	0.00
13	301502	华阳智能	91	3,442.53	0.00
14	603344	星德胜	81	1,835.46	0.00
15	001359	平安电工	89	1,833.40	0.00
16	001387	雪祺电气	113	1,723.25	0.00
17	603082	北自科技	52	1,533.48	0.00
18	603325	博隆技术	22	1,497.32	0.00
19	001379	腾达科技	98	1,321.04	0.00
20	603375	盛景微	33	1,283.70	0.00
21	603312	西典新能	48	1,217.28	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002456	欧菲光	751,133.00	0.54
2	300002	神州泰岳	661,113.00	0.47
3	002436	兴森科技	638,617.00	0.46
4	002176	江特电机	594,027.00	0.43
5	002318	久立特材	593,955.00	0.43
6	300339	润和软件	558,707.00	0.40
7	002405	四维图新	539,492.00	0.39
8	300567	精测电子	535,589.00	0.38
9	300672	国科微	524,487.00	0.38
10	002151	北斗星通	508,309.00	0.36
11	000403	派林生物	493,521.00	0.35
12	300054	鼎龙股份	482,403.00	0.35
13	300775	三角防务	482,345.00	0.35
14	000921	海信家电	474,308.00	0.34
15	002837	英维克	458,591.00	0.33
16	300910	瑞丰新材	457,905.00	0.33
17	000034	神州数码	454,177.00	0.33
18	002126	银轮股份	451,721.00	0.32
19	300315	掌趣科技	436,520.00	0.31
20	300666	江丰电子	432,897.00	0.31

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002436	兴森科技	1,141,508.94	0.82
2	300002	神州泰岳	1,089,774.00	0.78
3	300054	鼎龙股份	881,943.00	0.63
4	000921	海信家电	871,241.00	0.62
5	300567	精测电子	825,020.00	0.59
6	000818	航锦科技	758,986.00	0.54
7	002261	拓维信息	730,815.00	0.52
8	688617	惠泰医疗	726,857.22	0.52
9	002456	欧菲光	715,251.00	0.51
10	300765	新诺威	650,817.52	0.47
11	002176	江特电机	641,933.00	0.46
12	300803	指南针	613,288.00	0.44

13	300339	润和软件	610,369.00	0.44
14	002318	久立特材	602,820.00	0.43
15	002405	四维图新	584,215.00	0.42
16	300672	国科微	542,415.00	0.39
17	002837	英维克	535,137.00	0.38
18	002151	北斗星通	532,185.00	0.38
19	000034	神州数码	518,368.00	0.37
20	002984	森麒麟	515,644.60	0.37

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	133,219,110.98
卖出股票收入（成交）总额	135,082,729.19

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，万丰奥威（002085）在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所和浙江证监局的处罚。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,052,314.99
2	应收清算款	1,044,216.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	2,171,940.60

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1	300630	普利制药	81,510.00	0.07	重大事项停牌
2	301589	诺瓦星云	46,626.48	0.04	新股锁定期内
3	301538	骏鼎达	9,215.24	0.01	新股锁定期内
4	301536	星宸科技	7,163.94	0.01	新股锁定期内
5	301566	达利凯普	6,261.93	0.01	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,502	58,594.00	53,256,670.00	36.33	93,345,512.00	63.67

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	BARCLAYS BANK PLC	21,104,400.00	14.40
2	中国国际金融股份有限公司	10,753,800.00	7.34
3	张岳旋	4,100,600.00	2.80
4	中信证券股份有限公司	3,920,688.00	2.67
5	黄永耀	3,850,000.00	2.63
6	华泰证券股份有限公司	3,029,500.00	2.07
7	申万宏源证券有限公司	2,430,000.00	1.66
8	恒安标准养老保险有限责任公司—信天翁启航专属商业养老保险进取	2,353,000.00	1.61
9	付小华	2,205,900.00	1.50
10	张郭堃	2,174,600.00	1.48

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	220,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	217,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	146,602,182.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	6	267,827,223.78	100.00	228,109.24	100.00	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

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

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

3、本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	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 (%)				的比例 (%)
招商证券	107,060.87	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024年06月25日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024年03月29日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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
4	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
5	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
6	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
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024年01月05日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
个人	1	20240207-20240208;	0.00	227,184,500.00	227,184,500.00	0.00	0.00

产品特有风险

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注: 无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日