

华泰柏瑞中证 A 股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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61

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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A 股 ETF
场内简称	A 股 ETF (扩位证券简称: A 股 ETF)
基金主代码	563330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 10 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	131,421,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 11 月 7 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。
投资策略	<p>1、股票（含存托凭证）的投资策略</p> <p>本基金主要采用抽样复制法跟踪标的指数。抽样复制依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，以“跟踪误差最小化”为优化目标创建组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争做到日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金将根据投资目标，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务。</p>
业绩比较基准	中证 A 股指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用抽样复制策略，跟踪中证 A 股指数，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。</p>

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	张姗
		021-38601777
		400-61-95555

电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-0001	400-61-95555
传真	021-38601799	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	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	-12,627,999.75
本期利润	-13,459,260.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0673
本期加权平均净值利润率	-7.19%
本期基金份额净值增长率	-6.21%
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	-11,589,161.51
期末可供分配基金份额利润	-0.0882
期末基金资产净值	119,831,838.49
期末基金份额净值	0.9118
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	-8.82%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰

低数。

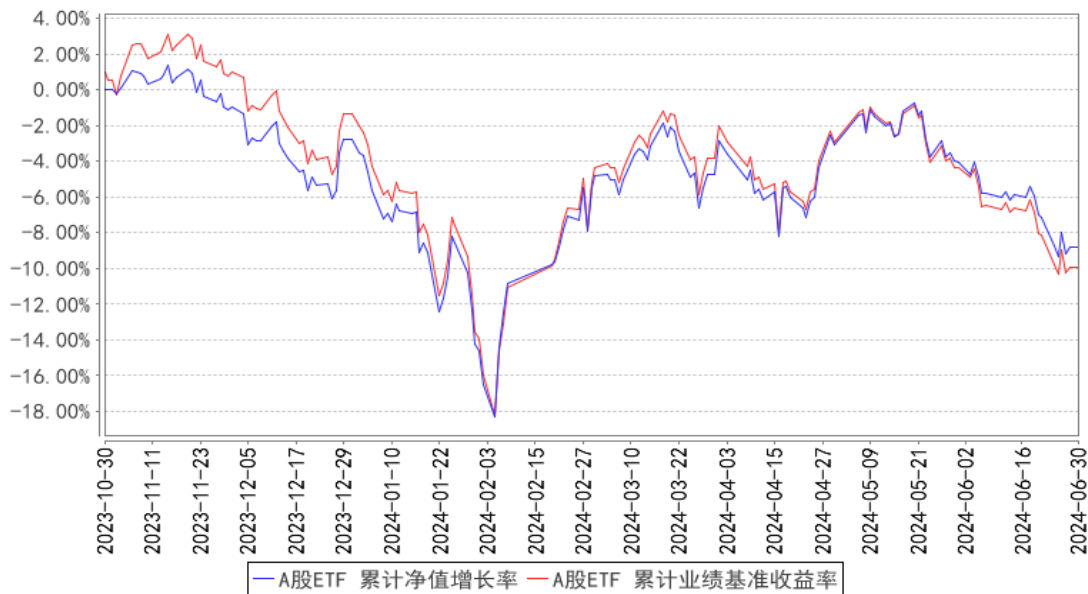
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.94%	0.77%	-5.78%	0.80%	0.84%	-0.03%
过去三个月	-4.28%	1.02%	-6.29%	1.03%	2.01%	-0.01%
过去六个月	-6.21%	1.27%	-8.66%	1.30%	2.45%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-8.82%	1.14%	-9.91%	1.17%	1.09%	-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

A股ETF 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：1、图示日期为2023年10月30日至2024年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	-	6 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 10 月 30 日	-	23 年	复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 3 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年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 年一季度指数先抑后扬，二季度区间振荡，上半年总体来看大盘蓝筹相关指数普遍实现了正收益。随着积极政策的陆续出台，比如 517 房地产“组合拳”、超长期国债的发行等，投资者情绪有望逐步修复。5 月下旬开始，A 股有所调整但调整节奏相较年初明显放缓，市场已逐渐从过度悲观的预期中走出。基本面方面，4-5 月的经济增长数据显示修复过程仍面临诸多挑战，包括有效需求不足、企业经营压力较大等，但外需和设备更新等对经济数据有所支撑，工业生产稳定增长，制造业增速维持韧性。

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 0.088%，期间日跟踪误差为 0.127%，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 0.9118 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.21%，业绩比较基准收益率为-8.66%。

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，宏观范式转变下中外金融周期分化，结合积极的稳增长政策及中长期改革，经济动能有望继续温和改善，大盘风格或将持续具有相对收益，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，A 股市场的估值比较具吸引力，性价比突出，配置机会或大于风险。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职

责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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 A 股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	8,873,335.48	5,061,688.17
结算备付金		1,830,231.63	7,328,773.67
存出保证金		1,249,521.53	1,286,862.18
交易性金融资产	6.4.7.2	108,264,493.61	279,606,837.33
其中：股票投资		108,264,493.61	279,566,735.64
基金投资		-	-
债券投资		-	40,101.69
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		1,711.96	507,384.91
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		120,294,703.33	293,791,546.26
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		-	-12.70
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		145,929.40	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,500.66	93,499.60
应付托管费		10,700.15	18,699.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	14.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	252,734.63	2,597,021.73
负债合计		462,864.84	2,709,222.92
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	131,421,000.00	299,421,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-11,589,161.51	-8,338,676.66
净资产合计		119,831,838.49	291,082,323.34
负债和净资产总计		120,294,703.33	293,791,546.26

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9118 元，基金份额总额 131,421,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股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
一、营业总收入		-12,742,851.08
1. 利息收入		35,722.34

其中：存款利息收入	6.4.7.13	35,722.34
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）		-12,177,388.18
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-13,303,898.31
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	8,716.32
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-369,625.72
股利收益	6.4.7.19	1,487,419.53
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	-831,260.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	230,075.56
减：二、营业总支出		716,409.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	466,152.10
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	93,230.50
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		188.88
8. 其他费用	6.4.7.23	156,837.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,459,260.55
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,459,260.55
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-13,459,260.55

注：本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股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	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-168,000,000.00	-	-3,250,484.85	-171,250,484.85
（一）、综合收益总额	-	-	-13,459,260.55	-13,459,260.55
（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）	-168,000,000.00	-	10,208,775.70	-157,791,224.30
其中：1. 基金申购款	56,000,000.00	-	-5,660,732.76	50,339,267.24
2. 基金赎回款	-224,000,000.00	-	15,869,508.46	-208,130,491.54
（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	131,421,000.00	-	-11,589,161.51	119,831,838.49

注：本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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：

韩勇

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

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 A 股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[2023]2267 号《关于准予华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A 股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 635,421,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0531 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 10 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 635,421,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]244 号核准,本基金 635,421,000.00 份基金份额于 2023 年 11 月 7 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 A 股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(含存托凭证)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)。本基金投资标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 A 股指数收益率。

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 A 股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	8,873,335.48

等于：本金	8,872,493.49
加：应计利息	841.99
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	8,873,335.48

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	113,058,363.61	-	108,264,493.61	-4,793,870.00
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	113,058,363.61	-	108,264,493.61	-4,793,870.00

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	10,133,220.00	-	-	

工具				
其中：股指期货投资	10,133,220.00			
其他衍生工具				
合计	10,133,220.00			

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	中证 500 股指期货 2409	2.00	1,950,080.00	-68,160.00
IF2409	深 300 股指期货 2409	4.00	4,108,320.00	-57,780.00
IM2409	中证 1000 股指期货 2409	4.00	3,824,160.00	-124,720.00
合计				-250,660.00
减：可抵销期货暂收款				-250,660.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的其他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	5,199.46
其中：交易所市场	5,199.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,965.96
应退退补款	150,569.21
合计	252,734.63

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	299,421,000.00	299,421,000.00
本期申购	56,000,000.00	56,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-224,000,000.00	-224,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	131,421,000.00	131,421,000.00

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,402,554.09	-12,741,230.75	-8,338,676.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,402,554.09	-12,741,230.75	-8,338,676.66
本期利润	-12,627,999.75	-831,260.80	-13,459,260.55
本期基金份额交易产生的变动数	3,792,283.94	6,416,491.76	10,208,775.70
其中：基金申购款	-572,375.12	-5,088,357.64	-5,660,732.76
基金赎回款	4,364,659.06	11,504,849.40	15,869,508.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,433,161.72	-7,155,999.79	-11,589,161.51

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	13,974.01
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	19,952.73
其他	1,795.60
合计	35,722.34

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	-10,321,894.18
股票投资收益——赎回差价收入	-2,982,004.13
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	-13,303,898.31

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	148,853,528.53
减：卖出股票成本总额	158,969,924.45
减：交易费用	205,498.26
买卖股票差价收入	-10,321,894.18

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	208,130,491.54
减：现金支付赎回款总额	98,326,835.54
减：赎回股票成本总额	112,785,660.13
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,982,004.13

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	4.94

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,711.38
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	8,716.32

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	57,820.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,100.00
减：应计利息总额	6.63
减：交易费用	2.31
买卖债券差价收入	8,711.38

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：本基金本报告期内无衍生工具收益——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	-369,625.72

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	1,487,419.53
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	1,487,419.53

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	-631,916.80
股票投资	-631,916.80
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	-198,660.00
权证投资	-
期货投资	-198,660.00
3. 其他	-684.00
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	-831,260.80

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

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	230,075.56
合计	230,075.56

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	27,349.14
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	-7,041.82
银行划款手续费	2,267.45
合计	156,837.99

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元支付关联方佣金。本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，

无上年度可比期间数据。

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
当期发生的基金应支付的管理费	466,152.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,691.64
应支付基金管理人的净管理费	456,460.46

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：

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

本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	93,230.50

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

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

本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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。本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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。本基金成立于 2023 年 10 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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。本基金成立于2023年10月30日，无上年度可比期间数据。

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自有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。本基金成立于2023年10月30日，无上年可比期间数据。

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

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	8,873,335.48	13,974.01

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。本基金成立于2023年10月30日，无上年度可比期间数据。

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	622	18,050.44
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	4,318	67,749.42
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	1,173	30,498.00
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	2,506	54,455.38
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

注：本基金成立于2023年10月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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	137	2,382.43	2,822.20	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.98	13.48	124	2,105.52	1,671.52	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	15.38	15.25	145	1,722.56	2,211.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期内	17.43	34.56	166	2,893.38	5,736.96	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定期内	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定期内	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期内	16.16	32.27	360	5,817.60	11,617.20	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	55.82	91.24	141	5,637.82	12,864.84	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定期内	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定期内	11.88	18.98	303	3,599.64	5,750.94	-

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	458	4,076.20	7,772.26	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定期内	44.95	65.93	80	3,596.00	5,274.40	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定期内	21.73	25.26	251	5,454.23	6,340.26	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	126.89	188.01	497	35,021.64	93,440.97	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定期内	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.20	15.96	225	3,645.00	3,591.00	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定期内	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	611	11,395.15	11,395.15	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	29.02	25.36	63	1,828.26	1,597.68	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定期内	72.46	68.06	27	1,956.42	1,837.62	-
603341	龙	2024	6个月	新股	26.00	37.49	118	3,068.00	4,423.82	-

	旗科技	2024年2月23日		锁定期内						
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	19.18	22.66	118	2,263.24	2,673.88	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	664	13,651.84	13,651.84	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定期内	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定期内	23.35	25.13	56	1,307.60	1,407.28	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定期内	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	22.66	15.89	351	7,953.66	5,577.39	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期内	19.86	42.51	222	4,408.92	9,437.22	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期内	86.96	174.93	46	4,000.16	8,046.78	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期内	15.69	18.79	432	6,778.08	8,117.28	-

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

之间不能自由转让。

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2023 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,873,335.48	-	-	-	-	-	8,873,335.48
结算备付金	1,830,231.63	-	-	-	-	-	1,830,231.63
存出保证金	1,249,521.53	-	-	-	-	-	1,249,521.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	108,264,493.61	108,264,493.61
应收清算款	-	-	-	-	-	1,711.96	1,711.96
其他资产	-	-	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	11,953,088.64	-	-	-	-	108,341,614.69	120,294,703.33
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,500.66	53,500.66
应付托管费	-	-	-	-	-	10,700.15	10,700.15
应付清算款	-	-	-	-	-	145,929.40	145,929.40
其他负债	-	-	-	-	-	252,734.63	252,734.63
负债总计	-	-	-	-	-	462,864.84	462,864.84
利率敏感度缺口	11,953,088.64	-	-	-	-	-107,878,749.85	119,831,838.49
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	5,061,688.17	-	-	-	-	-	5,061,688.17
结算备付金	7,328,773.67	-	-	-	-	-	7,328,773.67
存出保证金	212,982.18	-	-	-	-	1,073,880.00	1,286,862.18
交易性金融资产	-	-	-	-	40,101.69	279,566,735.64	279,606,837.33
应收清算款	-	-	-	-	-	507,384.91	507,384.91
资产总计	12,603,444.02	-	-	-	40,101.69	281,148,000.55	293,791,546.26
负债							
交易性金融负	-	-	-	-	-	-12.70	-12.70

债							
应付管理人报酬		-	-	-	-	93,499.60	93,499.60
应付托管费		-	-	-	-	18,699.93	18,699.93
应交税费		-	-	-	-	14.36	14.36
其他负债		-	-	-	-	2,597,021.73	2,597,021.73
负债总计		-	-	-	-	2,709,222.92	2,709,222.92
利率敏感度缺口	12,603,444.02	-	-	-40,101.69	278,438,777.63	291,082,323.34	

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	108,264,493.61	90.35	279,566,735.64	96.04
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	-	-	12.70	-
合计	108,264,493.61	90.35	279,566,748.34	96.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A 股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 A 股指数上升 5%	5,790,876.97	14,369,880.37
	中证 A 股指数下降 5%	-5,790,876.97	-14,369,880.37

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	107,984,811.97	279,511,466.39
第二层次	25,046.99	40,101.69
第三层次	254,634.65	55,269.25

合计	108,264,493.61	279,606,837.33
----	----------------	----------------

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	108,264,493.61	90.00
	其中：股票	108,264,493.61	90.00
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	10,703,567.11	8.90
8	其他各项资产	1,326,642.61	1.10
9	合计	120,294,703.33	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	1,068,871.00	0.89
B	采矿业	5,705,189.00	4.76
C	制造业	64,322,590.14	53.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,107,770.00	3.43
E	建筑业	1,618,708.00	1.35
F	批发和零售业	1,301,399.80	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	3,415,128.00	2.85
H	住宿和餐饮业	140,742.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,120,670.33	5.11
J	金融业	14,891,354.60	12.43
K	房地产业	1,558,325.00	1.30
L	租赁和商务服务业	878,385.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	1,478,958.10	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	121,880.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	47,736.00	0.04
Q	卫生和社会工作	470,910.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	650,581.00	0.54
S	综合	83,776.00	0.07
	合计	107,982,973.97	90.11

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	254,576.34	0.21
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	23,352.30	0.02
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	3,591.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	281,519.64	0.23

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	600519	贵州茅台	2,900	4,255,431.00	3.55
2	300750	宁德时代	9,056	1,630,351.68	1.36
3	601318	中国平安	31,200	1,290,432.00	1.08
4	000333	美的集团	14,999	967,435.50	0.81
5	601899	紫金矿业	52,900	929,453.00	0.78
6	300760	迈瑞医疗	2,900	843,639.00	0.70
7	600900	长江电力	27,900	806,868.00	0.67
8	601166	兴业银行	44,100	777,042.00	0.65
9	000858	五粮液	6,000	768,240.00	0.64
10	002594	比亚迪	3,000	750,750.00	0.63
11	601328	交通银行	83,800	625,986.00	0.52
12	002475	立讯精密	15,000	589,650.00	0.49

13	000651	格力电器	15,000	588,300.00	0.49
14	600276	恒瑞医药	15,000	576,900.00	0.48
15	300308	中际旭创	4,180	576,338.40	0.48
16	601398	工商银行	93,600	533,520.00	0.45
17	688047	龙芯中科	5,939	522,216.27	0.44
18	600309	万华化学	6,000	485,160.00	0.40
19	600887	伊利股份	18,100	467,704.00	0.39
20	600030	中信证券	24,600	448,458.00	0.37
21	000568	泸州老窖	2,900	416,121.00	0.35
22	000725	京东方 A	100,200	409,818.00	0.34
23	601138	工业富联	14,800	405,520.00	0.34
24	601088	中国神华	9,000	399,330.00	0.33
25	300059	东方财富	37,800	399,168.00	0.33
26	002714	牧原股份	9,000	392,400.00	0.33
27	601288	农业银行	87,100	379,756.00	0.32
28	600919	江苏银行	50,200	372,986.00	0.31
29	002415	海康威视	12,000	370,920.00	0.31
30	300394	天孚通信	4,180	369,595.60	0.31
31	300498	温氏股份	18,100	358,742.00	0.30
32	601857	中国石油	34,500	356,040.00	0.30
33	601816	京沪高铁	65,300	350,661.00	0.29
34	688099	晶晨股份	5,882	348,920.24	0.29
35	600690	海尔智家	12,000	340,560.00	0.28
36	600028	中国石化	53,700	339,384.00	0.28
37	601985	中国核电	31,200	332,592.00	0.28
38	002352	顺丰控股	9,000	321,210.00	0.27
39	600941	中国移动	2,900	311,750.00	0.26
40	605117	德业股份	4,180	310,741.20	0.26
41	601225	陕西煤业	12,000	309,240.00	0.26
42	300124	汇川技术	6,000	307,800.00	0.26
43	300502	新易盛	2,900	306,095.00	0.26
44	601988	中国银行	64,800	299,376.00	0.25
45	600031	三一重工	18,100	298,650.00	0.25
46	601012	隆基绿能	21,300	298,626.00	0.25
47	601728	中国电信	47,600	292,740.00	0.24
48	603501	韦尔股份	2,900	288,173.00	0.24
49	688114	华大智造	5,939	281,567.99	0.23
50	600050	中国联通	59,700	280,590.00	0.23
51	688101	三达膜	24,623	280,209.74	0.23
52	603986	兆易创新	2,900	277,298.00	0.23
53	688981	中芯国际	5,920	272,912.00	0.23
54	600016	民生银行	71,300	270,227.00	0.23
55	002142	宁波银行	12,200	269,132.00	0.22

56	300274	阳光电源	4,280	265,488.40	0.22
57	601127	赛力斯	2,900	264,248.00	0.22
58	601601	中国太保	9,200	256,312.00	0.21
59	000100	TCL科技	59,200	255,744.00	0.21
60	002230	科大讯飞	5,900	253,405.00	0.21
61	600150	中国船舶	6,200	252,402.00	0.21
62	000063	中兴通讯	9,000	251,730.00	0.21
63	300067	安诺其	62,100	250,884.00	0.21
64	000001	平安银行	24,600	249,690.00	0.21
65	000338	潍柴动力	15,100	245,224.00	0.20
66	603019	中科曙光	5,900	244,850.00	0.20
67	300661	圣邦股份	2,900	240,062.00	0.20
68	300014	亿纬锂能	6,000	239,520.00	0.20
69	603259	药明康德	6,000	235,140.00	0.20
70	600406	国电南瑞	9,000	224,640.00	0.19
71	688777	中控技术	5,860	220,922.00	0.18
72	688611	杭州柯林	8,255	219,995.75	0.18
73	002340	格林美	34,500	219,765.00	0.18
74	002463	沪电股份	6,000	219,000.00	0.18
75	601668	中国建筑	40,900	217,179.00	0.18
76	688230	芯导科技	5,935	215,203.10	0.18
77	000977	浪潮信息	5,900	214,583.00	0.18
78	000792	盐湖股份	12,000	209,400.00	0.17
79	002966	苏州银行	27,900	209,250.00	0.17
80	300717	华信新材	12,100	207,999.00	0.17
81	601918	新集能源	21,300	207,675.00	0.17
82	603288	海天味业	6,000	206,820.00	0.17
83	301115	建科股份	14,900	206,812.00	0.17
84	000400	许继电气	6,000	206,460.00	0.17
85	603160	汇顶科技	3,000	206,250.00	0.17
86	300241	瑞丰光电	50,200	205,820.00	0.17
87	002273	水晶光电	12,000	203,760.00	0.17
88	300078	思创医惠	90,300	203,175.00	0.17
89	000625	长安汽车	15,100	202,793.00	0.17
90	601169	北京银行	34,500	201,480.00	0.17
91	000938	紫光股份	9,000	201,150.00	0.17
92	300284	苏交科	24,600	198,768.00	0.17
92	600733	北汽蓝谷	24,600	198,768.00	0.17
93	600938	中国海油	6,000	198,000.00	0.17
94	603392	万泰生物	3,000	197,640.00	0.16
95	002028	思源电气	2,900	194,010.00	0.16
96	600584	长电科技	6,000	190,260.00	0.16
97	600522	中天科技	12,000	190,200.00	0.16

98	002027	分众传媒	31,200	189,072.00	0.16
99	600795	国电电力	31,200	186,888.00	0.16
100	601628	中国人寿	6,000	186,300.00	0.16
101	601766	中国中车	24,600	184,746.00	0.15
102	000875	吉电股份	34,500	183,885.00	0.15
103	300775	三角防务	6,000	183,600.00	0.15
104	300474	景嘉微	2,900	183,367.00	0.15
105	000009	中国宝安	21,300	183,180.00	0.15
106	600711	盛屯矿业	49,700	182,399.00	0.15
107	002384	东山精密	8,800	182,160.00	0.15
108	601390	中国中铁	27,900	181,908.00	0.15
109	000423	东阿阿胶	2,900	181,540.00	0.15
110	601919	中远海控	11,700	181,233.00	0.15
111	601888	中国中免	2,900	181,221.00	0.15
112	600580	卧龙电驱	14,900	181,035.00	0.15
113	002422	科伦药业	5,900	178,947.00	0.15
114	601128	常熟银行	23,530	178,122.10	0.15
115	600161	天坛生物	7,280	177,632.00	0.15
116	600489	中金黄金	12,000	177,600.00	0.15
117	300327	中颖电子	9,000	177,120.00	0.15
118	000988	华工科技	5,900	176,587.00	0.15
119	300024	机器人	18,100	176,294.00	0.15
120	600461	洪城环境	15,200	176,016.00	0.15
121	000425	徐工机械	24,600	175,890.00	0.15
122	002241	歌尔股份	9,000	175,590.00	0.15
123	300408	三环集团	6,000	175,140.00	0.15
124	600115	中国东航	43,600	174,836.00	0.15
125	600089	特变电工	12,600	174,762.00	0.15
126	002936	郑州银行	100,200	173,346.00	0.14
127	601077	渝农商行	34,500	173,190.00	0.14
128	600312	平高电气	8,900	173,105.00	0.14
129	300237	美晨生态	162,700	172,462.00	0.14
130	002074	国轩高科	9,000	172,350.00	0.14
131	600438	通威股份	9,000	171,990.00	0.14
132	300346	南大光电	6,000	171,540.00	0.14
133	688180	君实生物	5,864	170,349.20	0.14
134	002050	三花智控	8,900	169,812.00	0.14
135	002332	仙琚制药	14,800	168,868.00	0.14
136	688113	联测科技	5,939	168,489.43	0.14
137	300352	北信源	43,800	168,192.00	0.14
138	002958	青农商行	62,700	168,036.00	0.14
139	600886	国投电力	9,200	167,808.00	0.14
140	600642	申能股份	19,000	167,770.00	0.14

141	300303	聚飞光电	34,500	167,670.00	0.14
142	600125	铁龙物流	27,900	166,563.00	0.14
143	601187	厦门银行	31,200	166,296.00	0.14
144	600885	宏发股份	6,000	166,080.00	0.14
145	601168	西部矿业	9,200	165,140.00	0.14
146	002138	顺络电子	6,000	164,760.00	0.14
147	688002	睿创微纳	5,882	164,519.54	0.14
148	601997	贵阳银行	31,200	164,424.00	0.14
149	600702	舍得酒业	2,900	164,343.00	0.14
150	600486	扬农化工	2,900	163,705.00	0.14
151	600559	老白干酒	9,000	163,620.00	0.14
152	601021	春秋航空	2,900	163,357.00	0.14
153	000999	华润三九	3,830	163,081.40	0.14
154	002155	湖南黄金	9,000	162,900.00	0.14
155	603596	伯特利	4,180	162,602.00	0.14
156	601600	中国铝业	21,300	162,519.00	0.14
157	300724	捷佳伟创	3,000	162,030.00	0.14
158	600547	山东黄金	5,900	161,542.00	0.13
159	002294	信立泰	6,000	159,780.00	0.13
160	002402	和而泰	14,900	159,579.00	0.13
161	600048	保利发展	18,200	159,432.00	0.13
162	301077	星华新材	8,900	158,954.00	0.13
163	002085	万丰奥威	12,000	158,880.00	0.13
164	002180	纳思达	6,000	158,520.00	0.13
165	002139	拓邦股份	14,900	158,238.00	0.13
166	000551	创元科技	18,100	158,013.00	0.13
167	601956	东贝集团	34,500	158,010.00	0.13
168	002049	紫光国微	3,000	157,800.00	0.13
169	688655	迅捷兴	15,019	157,699.50	0.13
170	601111	中国国航	21,300	157,194.00	0.13
171	600763	通策医疗	2,900	156,745.00	0.13
172	000636	风华高科	12,000	156,720.00	0.13
173	300618	寒锐钴业	5,900	156,055.00	0.13
174	600392	盛和资源	18,100	156,022.00	0.13
175	601689	拓普集团	2,900	155,469.00	0.13
176	300296	利亚德	34,500	155,250.00	0.13
177	002126	银轮股份	8,900	154,949.00	0.13
178	002807	江阴银行	41,100	154,947.00	0.13
179	300015	爱尔眼科	15,000	154,800.00	0.13
179	600066	宇通客车	6,000	154,800.00	0.13
180	300009	安科生物	18,100	154,574.00	0.13
181	002625	光启技术	8,900	154,415.00	0.13
182	002465	海格通信	14,900	154,364.00	0.13

183	001227	兰州银行	64,800	154,224.00	0.13
184	603993	洛阳钼业	18,100	153,850.00	0.13
185	601989	中国重工	31,200	153,816.00	0.13
186	601665	齐鲁银行	31,200	153,192.00	0.13
187	002405	四维图新	24,600	153,012.00	0.13
188	300876	蒙泰高新	8,900	152,902.00	0.13
189	600529	山东药玻	6,000	152,040.00	0.13
190	002839	张家港行	37,800	151,956.00	0.13
191	300012	华测检测	15,000	150,900.00	0.13
192	600521	华海药业	8,800	150,040.00	0.13
193	600000	浦发银行	18,200	149,786.00	0.12
194	000735	罗牛山	34,500	149,385.00	0.12
195	603308	应流股份	12,000	149,040.00	0.12
196	002948	青岛银行	44,200	148,954.00	0.12
197	601577	长沙银行	18,200	148,876.00	0.12
198	600060	海信视像	6,000	148,440.00	0.12
199	600908	无锡银行	27,900	148,428.00	0.12
200	601218	吉鑫科技	53,100	148,149.00	0.12
201	600011	华能国际	15,400	148,148.00	0.12
202	000887	中鼎股份	12,000	146,880.00	0.12
203	002407	多氟多	12,000	146,760.00	0.12
204	300088	长信科技	31,200	146,640.00	0.12
204	601000	唐山港	31,200	146,640.00	0.12
205	000975	山金国际	9,000	146,610.00	0.12
206	300454	深信服	2,900	146,537.00	0.12
206	603979	金诚信	2,900	146,537.00	0.12
207	601611	中国核建	18,100	146,429.00	0.12
208	300886	华业香料	8,900	146,138.00	0.12
209	300347	泰格医药	3,000	145,800.00	0.12
210	300987	川网传媒	12,000	145,680.00	0.12
211	600988	赤峰黄金	8,900	145,426.00	0.12
212	600285	羚锐制药	6,000	145,260.00	0.12
213	600029	南方航空	24,600	144,894.00	0.12
214	600160	巨化股份	6,000	144,780.00	0.12
215	002067	景兴纸业	53,100	144,432.00	0.12
216	002479	富春环保	41,000	144,320.00	0.12
217	600269	赣粤高速	27,900	144,243.00	0.12
218	000768	中航西飞	6,000	144,180.00	0.12
219	601198	东兴证券	18,100	144,076.00	0.12
220	002312	川发龙蟒	21,300	143,349.00	0.12
221	600094	大名城	37,000	143,190.00	0.12
222	300034	钢研高纳	9,000	143,010.00	0.12
223	600418	江淮汽车	9,000	142,560.00	0.12

224	002262	恩华药业	6,000	142,440.00	0.12
225	002797	第一创业	27,900	142,011.00	0.12
226	600487	亨通光电	9,000	141,930.00	0.12
227	601860	紫金银行	56,700	141,750.00	0.12
228	601963	重庆银行	18,278	141,654.50	0.12
229	603606	东方电缆	2,900	141,549.00	0.12
230	002252	上海莱士	18,100	141,542.00	0.12
231	301020	密封科技	8,900	140,798.00	0.12
232	600703	三安光电	12,000	140,640.00	0.12
233	688280	精进电动	34,524	140,512.68	0.12
234	601233	桐昆股份	8,800	140,448.00	0.12
235	601375	中原证券	41,100	140,151.00	0.12
236	000598	兴蓉环境	18,600	139,872.00	0.12
237	601838	成都银行	9,200	139,748.00	0.12
238	002025	航天电器	3,000	139,140.00	0.12
239	600820	隧道股份	21,300	139,089.00	0.12
240	600660	福耀玻璃	2,900	138,910.00	0.12
241	000543	皖能电力	15,600	138,060.00	0.12
242	600338	西藏珠峰	14,900	137,676.00	0.11
243	002318	久立特材	5,900	137,647.00	0.11
244	600596	新安股份	18,100	137,560.00	0.11
245	000750	国海证券	47,200	137,352.00	0.11
246	600033	福建高速	41,000	137,350.00	0.11
247	002372	伟星新材	8,900	137,238.00	0.11
248	301189	奥尼电子	5,900	137,175.00	0.11
249	300950	德固特	9,000	137,160.00	0.11
249	301237	和顺科技	6,000	137,160.00	0.11
250	300496	中科创达	3,000	136,770.00	0.11
251	300207	欣旺达	9,000	136,530.00	0.11
252	605358	立昂微	5,900	136,526.00	0.11
253	002311	海大集团	2,900	136,445.00	0.11
254	600188	兖矿能源	6,000	136,380.00	0.11
255	600750	江中药业	5,900	136,349.00	0.11
256	600872	中炬高新	6,000	136,140.00	0.11
257	300054	鼎龙股份	6,000	136,080.00	0.11
258	601162	天风证券	62,200	135,596.00	0.11
259	601100	恒立液压	2,900	135,082.00	0.11
260	000021	深科技	8,900	134,568.00	0.11
261	002156	通富微电	6,000	134,340.00	0.11
262	603087	甘李药业	2,900	134,328.00	0.11
263	000528	柳工	12,000	134,280.00	0.11
264	603323	苏农银行	27,900	134,199.00	0.11
265	603369	今世缘	2,900	133,980.00	0.11

266	601939	建设银行	18,100	133,940.00	0.11
267	300003	乐普医疗	9,000	133,560.00	0.11
268	600206	有研新材	15,000	133,500.00	0.11
269	603799	华友钴业	6,000	132,780.00	0.11
270	002472	双环传动	6,000	132,120.00	0.11
271	002673	西部证券	21,300	131,847.00	0.11
272	600837	海通证券	15,400	131,824.00	0.11
273	000799	酒鬼酒	3,000	131,610.00	0.11
274	300824	北鼎股份	18,100	131,225.00	0.11
275	600118	中国卫星	5,900	131,157.00	0.11
276	300091	金通灵	111,600	130,572.00	0.11
277	000519	中兵红箭	8,900	130,563.00	0.11
278	600201	生物股份	18,100	130,501.00	0.11
279	002628	成都路桥	67,300	129,889.00	0.11
280	002129	TCL 中环	15,000	129,750.00	0.11
281	300919	中伟股份	4,180	129,538.20	0.11
282	600863	内蒙华电	27,900	129,456.00	0.11
283	688511	天微电子	5,939	129,292.03	0.11
284	600797	浙大网新	27,900	129,177.00	0.11
285	600012	皖通高速	9,200	128,524.00	0.11
286	002539	云图控股	18,000	128,340.00	0.11
287	002600	领益智造	18,000	128,160.00	0.11
288	603279	景津装备	5,900	127,971.00	0.11
289	003008	开普检测	7,850	127,719.50	0.11
290	688067	爱威科技	8,898	127,686.30	0.11
291	600300	维维股份	53,100	127,440.00	0.11
292	300829	金丹科技	8,800	127,424.00	0.11
293	300943	春晖智控	11,800	127,322.00	0.11
294	300777	中简科技	5,900	126,850.00	0.11
295	600183	生益科技	6,000	126,360.00	0.11
296	600027	华电国际	18,200	126,308.00	0.11
297	002506	协鑫集成	65,000	126,100.00	0.11
298	601058	赛轮轮胎	9,000	126,000.00	0.11
299	600867	通化东宝	15,000	125,550.00	0.10
300	000683	远兴能源	18,100	125,071.00	0.10
301	300763	锦浪科技	3,000	124,920.00	0.10
302	002008	大族激光	6,000	124,800.00	0.10
303	000402	金融街	53,100	124,785.00	0.10
304	600572	康恩贝	27,900	124,713.00	0.10
305	000733	振华科技	3,000	124,590.00	0.10
306	002152	广电运通	11,900	124,474.00	0.10
307	300036	超图软件	8,900	124,244.00	0.10
308	002436	兴森科技	12,000	123,840.00	0.10

309	600928	西安银行	37,800	123,606.00	0.10
310	002706	良信股份	18,000	123,480.00	0.10
311	603806	福斯特	8,380	123,186.00	0.10
312	000429	粤高速 A	11,800	122,838.00	0.10
313	002488	金固股份	27,900	122,481.00	0.10
314	600765	中航重机	6,000	122,400.00	0.10
315	603005	晶方科技	6,000	122,280.00	0.10
316	002185	华天科技	15,000	122,250.00	0.10
317	300339	润和软件	5,900	121,953.00	0.10
318	300355	蒙草生态	55,400	121,880.00	0.10
319	002202	金风科技	18,100	121,632.00	0.10
320	000933	神火股份	6,000	121,380.00	0.10
321	300487	蓝晓科技	2,900	121,104.00	0.10
322	688303	大全能源	5,939	121,096.21	0.10
323	600193	创兴资源	34,500	120,750.00	0.10
324	300001	特锐德	6,000	120,720.00	0.10
325	300834	星辉环材	6,000	120,000.00	0.10
326	605589	圣泉集团	5,900	119,711.00	0.10
327	688237	超卓航科	5,969	119,678.45	0.10
328	601108	财通证券	18,100	119,641.00	0.10
329	002926	华西证券	18,100	119,279.00	0.10
330	002396	星网锐捷	9,000	118,890.00	0.10
331	000783	长江证券	24,600	118,818.00	0.10
332	600021	上海电力	12,000	118,680.00	0.10
333	000060	中金岭南	27,900	118,296.00	0.10
334	603179	新泉股份	3,011	118,151.64	0.10
335	002432	九安医疗	2,900	117,566.00	0.10
336	300136	信维通信	6,000	117,480.00	0.10
337	600926	杭州银行	9,000	117,450.00	0.10
338	002286	保龄宝	21,300	117,363.00	0.10
339	000723	美锦能源	24,600	117,096.00	0.10
340	600096	云天化	6,000	116,520.00	0.10
341	600865	百大集团	18,000	116,460.00	0.10
342	002456	欧菲光	14,900	116,369.00	0.10
343	688267	中触媒	5,857	116,320.02	0.10
344	600760	中航沈飞	2,900	116,290.00	0.10
345	601901	方正证券	15,000	115,950.00	0.10
346	002500	山西证券	24,600	115,620.00	0.10
347	601099	太平洋	37,800	115,290.00	0.10
348	000157	中联重科	15,000	115,200.00	0.10
348	601990	南京证券	15,000	115,200.00	0.10
349	600482	中国动力	5,900	114,932.00	0.10
350	600340	华夏幸福	108,400	114,904.00	0.10

351	600141	兴发集团	6,000	114,480.00	0.10
352	601360	三六零	14,900	114,432.00	0.10
353	002179	中航光电	3,000	114,150.00	0.10
354	003816	中国广核	24,600	113,898.00	0.10
355	603589	口子窖	2,900	113,651.00	0.09
356	301033	迈普医学	2,900	113,419.00	0.09
357	601615	明阳智能	12,000	113,280.00	0.09
358	000401	冀东水泥	27,900	113,274.00	0.09
359	600535	天士力	9,000	113,220.00	0.09
360	600771	广誉远	6,000	112,980.00	0.09
361	300373	扬杰科技	2,900	112,810.00	0.09
362	600862	中航高科	6,000	112,680.00	0.09
363	600023	浙能电力	15,800	112,338.00	0.09
364	301019	宁波色母	6,000	112,200.00	0.09
365	000036	华联控股	34,500	111,780.00	0.09
366	600369	西南证券	31,200	111,696.00	0.09
367	300759	康龙化成	6,000	111,480.00	0.09
368	002661	克明食品	14,900	111,303.00	0.09
369	002065	东华软件	24,600	111,192.00	0.09
370	002271	东方雨虹	9,000	111,060.00	0.09
371	000878	云南铜业	8,900	110,894.00	0.09
372	600895	张江高科	6,000	110,880.00	0.09
373	600085	同仁堂	2,900	110,809.00	0.09
374	601366	利群股份	24,600	110,700.00	0.09
375	688314	康拓医疗	5,882	110,699.24	0.09
376	002595	豪迈科技	2,900	110,693.00	0.09
377	601016	节能风电	37,000	110,630.00	0.09
378	600674	川投能源	5,900	110,625.00	0.09
379	601658	邮储银行	21,800	110,526.00	0.09
380	002675	东诚药业	9,000	110,340.00	0.09
381	002984	森麒麟	4,580	110,332.20	0.09
382	300628	亿联网络	3,000	110,310.00	0.09
383	002507	涪陵榨菜	9,000	110,250.00	0.09
384	000690	宝新能源	21,600	110,160.00	0.09
385	600179	安通控股	47,200	109,976.00	0.09
386	600528	中铁工业	15,000	109,800.00	0.09
387	688558	国盛智科	5,939	109,752.72	0.09
388	000876	新希望	12,000	109,680.00	0.09
389	002601	龙佰集团	5,900	109,563.00	0.09
390	300433	蓝思科技	6,000	109,500.00	0.09
391	301097	天益医疗	2,900	109,156.00	0.09
392	002223	鱼跃医疗	2,900	109,040.00	0.09
393	601229	上海银行	15,000	108,900.00	0.09

394	002739	万达电影	9,000	108,810.00	0.09
395	600970	中材国际	9,000	108,540.00	0.09
396	603031	安孚科技	4,790	108,158.20	0.09
397	000513	丽珠集团	2,900	107,909.00	0.09
398	002648	卫星化学	6,000	107,880.00	0.09
399	002360	同德化工	21,300	107,778.00	0.09
400	000917	电广传媒	21,300	107,565.00	0.09
401	600971	恒源煤电	9,000	107,460.00	0.09
402	002756	永兴材料	3,000	107,340.00	0.09
403	300512	中亚股份	18,100	107,152.00	0.09
404	300285	国瓷材料	6,000	107,100.00	0.09
405	002373	千方科技	11,800	107,026.00	0.09
406	600221	海航控股	104,800	106,896.00	0.09
407	601555	东吴证券	18,100	106,790.00	0.09
408	001965	招商公路	9,000	106,740.00	0.09
409	000002	万科 A	15,400	106,722.00	0.09
410	301059	金三江	11,900	106,029.00	0.09
411	600893	航发动力	2,900	105,995.00	0.09
412	600502	安徽建工	24,600	105,780.00	0.09
413	688015	交控科技	5,882	105,699.54	0.09
414	000703	恒逸石化	14,900	105,641.00	0.09
415	001979	招商蛇口	12,000	105,480.00	0.09
416	002709	天赐材料	6,000	105,360.00	0.09
417	002353	杰瑞股份	3,000	105,240.00	0.09
418	300026	红日药业	34,500	105,225.00	0.09
418	600110	诺德股份	34,500	105,225.00	0.09
419	600643	爱建集团	27,900	105,183.00	0.09
420	000729	燕京啤酒	11,900	105,077.00	0.09
421	600460	士兰微	6,000	105,060.00	0.09
422	000066	中国长城	12,000	105,000.00	0.09
423	000830	鲁西化工	9,000	104,310.00	0.09
424	600570	恒生电子	5,900	104,194.00	0.09
425	600373	中文传媒	7,000	103,880.00	0.09
426	601916	浙商银行	37,600	103,776.00	0.09
427	002082	万邦德	24,600	103,566.00	0.09
427	600909	华安证券	24,600	103,566.00	0.09
428	300182	捷成股份	27,900	103,509.00	0.09
428	600728	佳都科技	27,900	103,509.00	0.09
429	600422	昆药集团	5,800	103,414.00	0.09
430	601872	招商轮船	12,200	103,090.00	0.09
431	002263	大东南	49,800	103,086.00	0.09
432	600352	浙江龙盛	12,000	103,080.00	0.09
433	600079	人福医药	6,000	103,020.00	0.09

434	300073	当升科技	3,000	102,930.00	0.09
435	002429	兆驰股份	21,300	102,453.00	0.09
436	300142	沃森生物	9,000	102,420.00	0.09
437	603311	金海高科	12,000	102,240.00	0.09
438	301236	软通动力	2,900	102,109.00	0.09
439	002439	启明星辰	5,900	101,834.00	0.08
440	600549	厦门钨业	5,900	101,775.00	0.08
441	000686	东北证券	18,200	101,556.00	0.08
442	300676	华大基因	2,900	101,529.00	0.08
443	601567	三星医疗	2,900	101,500.00	0.08
444	600111	北方稀土	5,900	101,480.00	0.08
445	300470	中密控股	3,000	101,430.00	0.08
446	300383	光环新网	12,000	101,400.00	0.08
447	300251	光线传媒	12,000	100,920.00	0.08
448	601825	沪农商行	15,000	100,800.00	0.08
449	600170	上海建工	46,800	100,620.00	0.08
450	600256	广汇能源	15,000	100,500.00	0.08
451	601975	招商南油	27,900	100,161.00	0.08
452	601010	文峰股份	58,700	99,790.00	0.08
453	300450	先导智能	6,000	99,780.00	0.08
454	688132	邦彦技术	5,739	99,571.65	0.08
455	688599	天合光能	5,882	99,523.44	0.08
456	002532	天山铝业	12,200	98,942.00	0.08
457	603885	吉祥航空	9,000	98,910.00	0.08
458	601818	光大银行	31,200	98,904.00	0.08
459	300674	宇信科技	8,900	98,612.00	0.08
460	600143	金发科技	14,900	98,489.00	0.08
461	688360	德马科技	8,175	98,427.00	0.08
462	600176	中国巨石	8,900	98,345.00	0.08
463	600917	重庆燃气	18,100	98,102.00	0.08
464	300017	网宿科技	12,400	97,960.00	0.08
465	601001	晋控煤业	5,900	97,468.00	0.08
466	600500	中化国际	27,900	97,371.00	0.08
467	601636	旗滨集团	15,000	96,750.00	0.08
468	300418	昆仑万维	3,000	96,720.00	0.08
469	300144	宋城演艺	12,000	96,360.00	0.08
470	002203	海亮股份	12,000	95,760.00	0.08
471	001333	光华股份	5,800	95,700.00	0.08
472	002602	世纪华通	27,900	95,697.00	0.08
473	600839	四川长虹	21,300	95,637.00	0.08
474	600998	九州通	19,485	95,086.80	0.08
475	002812	恩捷股份	3,000	94,950.00	0.08
476	600383	金地集团	27,900	94,860.00	0.08

477	000983	山西焦煤	9,200	94,852.00	0.08
478	002007	华兰生物	6,000	94,740.00	0.08
479	002385	大北农	24,600	94,710.00	0.08
480	000415	渤海租赁	37,000	94,350.00	0.08
481	605006	山东玻纤	21,300	93,933.00	0.08
482	000766	通化金马	5,800	93,902.00	0.08
483	301065	本立科技	5,900	93,810.00	0.08
484	300601	康泰生物	6,000	93,660.00	0.08
484	600026	中远海能	6,000	93,660.00	0.08
485	603816	顾家家居	2,900	93,641.00	0.08
486	600009	上海机场	2,900	93,525.00	0.08
487	000921	海信家电	2,900	93,496.00	0.08
488	301317	鑫磊股份	6,000	93,240.00	0.08
489	002236	大华股份	6,000	92,760.00	0.08
490	601009	南京银行	8,900	92,471.00	0.08
491	600831	广电网络	34,500	92,460.00	0.08
492	000627	天茂集团	52,800	92,400.00	0.08
493	600511	国药股份	3,000	92,370.00	0.08
494	600233	圆通速递	5,900	92,335.00	0.08
495	300395	菲利华	3,000	92,250.00	0.08
496	301256	华融化学	15,000	92,100.00	0.08
497	600566	济川药业	2,900	91,959.00	0.08
498	600512	腾达建设	48,600	91,854.00	0.08
499	600516	方大炭素	21,300	91,803.00	0.08
500	000960	锡业股份	5,900	91,391.00	0.08
501	603197	保隆科技	2,900	91,350.00	0.08
502	600958	东方证券	12,000	91,200.00	0.08
503	600536	中国软件	3,000	89,760.00	0.07
504	002466	天齐锂业	3,000	89,730.00	0.07
505	002327	富安娜	8,900	89,445.00	0.07
506	603968	醋化股份	9,000	89,280.00	0.07
507	688098	申联生物	21,354	89,046.18	0.07
508	600415	小商品城	12,000	89,040.00	0.07
509	600588	用友网络	8,900	89,000.00	0.07
510	600699	均胜电子	6,000	88,920.00	0.07
511	002556	辉隆股份	21,300	88,821.00	0.07
512	600398	海澜之家	9,600	88,704.00	0.07
513	600155	华创云信	14,900	88,059.00	0.07
514	600546	山煤国际	6,000	87,720.00	0.07
515	600515	海南机场	27,900	87,606.00	0.07
516	601717	郑煤机	5,900	87,320.00	0.07
517	600933	爱柯迪	5,900	87,261.00	0.07
518	601336	新华保险	2,900	87,087.00	0.07

519	603939	益丰药房	3,540	86,907.00	0.07
520	601528	瑞丰银行	18,400	86,848.00	0.07
521	600129	太极集团	3,000	86,760.00	0.07
521	601456	国联证券	9,000	86,760.00	0.07
522	002195	岩山科技	34,500	86,595.00	0.07
523	000998	隆平高科	8,800	86,504.00	0.07
524	688388	嘉元科技	8,851	86,297.25	0.07
525	601788	光大证券	5,900	86,258.00	0.07
526	300316	晶盛机电	3,000	86,190.00	0.07
527	000786	北新建材	2,900	86,014.00	0.07
528	002493	荣盛石化	8,900	85,974.00	0.07
529	002460	赣锋锂业	3,000	85,950.00	0.07
529	002517	恺英网络	9,000	85,950.00	0.07
530	600123	兰花科创	9,600	85,920.00	0.07
530	601006	大秦铁路	12,000	85,920.00	0.07
531	601995	中金公司	2,900	85,869.00	0.07
532	002841	视源股份	2,900	85,637.00	0.07
532	301196	唯科科技	2,900	85,637.00	0.07
533	300132	青松股份	24,600	85,608.00	0.07
534	600906	财达证券	14,900	85,377.00	0.07
535	000591	太阳能	18,100	85,251.00	0.07
536	688013	天臣医疗	5,739	85,166.76	0.07
537	601669	中国电建	15,200	84,968.00	0.07
538	002558	巨人网络	9,000	84,960.00	0.07
539	600166	福田汽车	37,700	84,825.00	0.07
540	603659	璞泰来	6,000	84,780.00	0.07
541	600004	白云机场	8,900	84,372.00	0.07
542	601933	永辉超市	34,000	84,320.00	0.07
543	301190	善水科技	6,000	84,180.00	0.07
544	300122	智飞生物	3,000	84,090.00	0.07
545	002268	电科网安	5,900	83,957.00	0.07
546	600673	东阳光	11,900	83,776.00	0.07
547	000807	云铝股份	6,200	83,762.00	0.07
548	002078	太阳纸业	6,000	83,700.00	0.07
549	000997	新大陆	6,000	83,460.00	0.07
550	000963	华东医药	3,000	83,430.00	0.07
551	300037	新宙邦	2,900	82,824.00	0.07
552	000617	中油资本	15,000	82,800.00	0.07
553	600801	华新水泥	6,000	82,500.00	0.07
554	603456	九洲药业	6,000	82,320.00	0.07
555	600120	浙江东方	24,600	82,164.00	0.07
556	600116	三峡水利	11,900	82,110.00	0.07
557	600848	上海临港	9,000	81,990.00	0.07

558	600745	闻泰科技	2,900	81,925.00	0.07
559	002299	圣农发展	6,000	81,840.00	0.07
560	002557	洽洽食品	2,900	81,751.00	0.07
561	601696	中银证券	9,000	81,720.00	0.07
562	300058	蓝色光标	15,000	81,600.00	0.07
563	000039	中集集团	8,800	81,488.00	0.07
564	688126	沪硅产业	5,893	81,382.33	0.07
565	300146	汤臣倍健	6,000	81,300.00	0.07
566	600298	安琪酵母	2,900	80,997.00	0.07
567	603300	华铁应急	14,800	80,808.00	0.07
568	002136	安纳达	8,900	80,634.00	0.07
569	600582	天地科技	11,700	80,613.00	0.07
570	002044	美年健康	21,300	80,514.00	0.07
571	002738	中矿资源	3,000	80,400.00	0.07
572	002497	雅化集团	9,000	80,280.00	0.07
573	600497	驰宏锌锗	15,000	80,100.00	0.07
574	600325	华发股份	12,200	79,300.00	0.07
575	603882	金域医学	2,900	78,851.00	0.07
576	601186	中国铁建	9,200	78,844.00	0.07
577	002555	三七互娱	6,000	78,300.00	0.07
578	603927	中科软	4,320	78,148.80	0.07
579	300002	神州泰岳	9,600	77,952.00	0.07
580	000403	派林生物	2,900	77,314.00	0.06
581	600426	华鲁恒升	2,900	77,256.00	0.06
582	600821	金开新能	15,000	77,100.00	0.06
583	000563	陕国投 A	27,900	76,725.00	0.06
584	300748	金力永磁	5,900	76,464.00	0.06
585	600100	同方股份	15,000	76,350.00	0.06
586	600015	华夏银行	11,900	76,160.00	0.06
587	000831	中国稀土	3,000	76,050.00	0.06
588	601633	长城汽车	3,000	75,900.00	0.06
589	600499	科达制造	9,000	75,870.00	0.06
590	600157	永泰能源	64,000	75,520.00	0.06
591	000069	华侨城 A	37,000	75,480.00	0.06
592	300315	掌趣科技	18,100	75,477.00	0.06
593	002670	国盛金控	8,900	75,383.00	0.06
594	002701	奥瑞金	18,100	75,296.00	0.06
595	000589	贵州轮胎	14,800	75,036.00	0.06
596	600901	江苏金租	14,800	74,740.00	0.06
597	601098	中南传媒	6,000	74,520.00	0.06
598	002831	裕同科技	2,900	74,211.00	0.06
599	601117	中国化学	9,000	74,160.00	0.06
600	600258	首旅酒店	6,000	74,100.00	0.06

601	600868	梅雁吉祥	45,700	74,034.00	0.06
602	300568	星源材质	9,000	73,800.00	0.06
603	600282	南钢股份	14,800	73,704.00	0.06
604	600884	杉杉股份	9,000	73,080.00	0.06
605	002003	伟星股份	5,800	72,790.00	0.06
606	000728	国元证券	12,000	72,720.00	0.06
607	002176	江特电机	8,900	72,535.00	0.06
608	002832	比音勒芬	3,000	72,510.00	0.06
609	301105	鸿铭股份	2,900	72,471.00	0.06
610	300459	汤姆猫	21,300	72,207.00	0.06
611	002212	天融信	14,800	72,076.00	0.06
612	300699	光威复材	2,900	72,007.00	0.06
613	688728	格科微	5,939	71,921.29	0.06
614	601666	平煤股份	6,400	71,680.00	0.06
615	002444	巨星科技	2,900	71,630.00	0.06
616	300118	东方日升	5,900	71,390.00	0.06
616	603578	三星新材	5,900	71,390.00	0.06
617	603922	金鸿顺	2,900	71,340.00	0.06
618	000301	东方盛虹	8,900	70,933.00	0.06
619	600583	海油工程	12,000	70,920.00	0.06
620	600859	王府井	6,000	70,440.00	0.06
621	300168	万达信息	14,800	70,300.00	0.06
622	688367	工大高科	5,739	70,015.80	0.06
623	000408	藏格矿业	2,900	69,803.00	0.06
624	600481	双良节能	14,900	69,583.00	0.06
625	688227	品高股份	5,739	69,499.29	0.06
626	002459	晶澳科技	6,200	69,440.00	0.06
627	600705	中航产融	31,200	69,264.00	0.06
628	000034	神州数码	3,000	68,670.00	0.06
629	600585	海螺水泥	2,900	68,411.00	0.06
630	002624	完美世界	9,000	68,400.00	0.06
631	600109	国金证券	9,000	67,950.00	0.06
632	002346	柘中股份	8,900	67,818.00	0.06
633	601881	中国银河	6,200	67,332.00	0.06
634	600754	锦江酒店	2,900	66,642.00	0.06
635	600019	宝钢股份	10,000	66,500.00	0.06
636	600963	岳阳林纸	18,100	66,427.00	0.06
637	600196	复星医药	3,000	66,420.00	0.06
638	002508	老板电器	3,000	66,300.00	0.06
639	301373	凌玮科技	2,900	66,120.00	0.06
640	301088	戎美股份	5,900	66,080.00	0.06
641	002261	拓维信息	5,900	65,313.00	0.05
642	688223	晶科能源	9,195	65,284.50	0.05

643	002154	报喜鸟	12,000	65,280.00	0.05
644	688669	聚石化学	5,739	64,965.48	0.05
645	600827	百联股份	8,800	64,944.00	0.05
646	600729	重庆百货	2,900	64,844.00	0.05
647	600271	航天信息	8,800	64,768.00	0.05
648	002244	滨江集团	8,900	64,614.00	0.05
649	002430	杭氧股份	2,900	64,525.00	0.05
650	000818	航锦科技	2,900	64,032.00	0.05
651	002131	利欧股份	44,600	63,778.00	0.05
652	301365	矩阵股份	5,800	63,742.00	0.05
653	300332	天壕能源	11,900	63,189.00	0.05
654	300983	尤安设计	4,020	63,033.60	0.05
655	600761	安徽合力	2,900	62,756.00	0.05
656	300413	芒果超媒	3,000	62,700.00	0.05
657	300364	中文在线	2,900	62,582.00	0.05
658	601878	浙商证券	5,800	62,176.00	0.05
659	603182	嘉华股份	5,900	62,068.00	0.05
660	603156	养元饮品	2,900	61,683.00	0.05
661	601998	中信银行	9,200	61,640.00	0.05
662	000629	钒钛股份	24,600	61,500.00	0.05
663	002128	电投能源	2,900	61,190.00	0.05
664	301276	嘉曼服饰	2,900	60,784.00	0.05
665	600803	新奥股份	2,900	60,320.00	0.05
666	600873	梅花生物	6,000	60,120.00	0.05
667	600390	五矿资本	14,800	59,940.00	0.05
668	301212	联盛化学	2,900	59,392.00	0.05
669	601699	潞安环能	3,200	58,016.00	0.05
670	603000	人民网	2,900	57,971.00	0.05
671	600348	华阳股份	5,800	57,768.00	0.05
672	002001	新和成	3,000	57,600.00	0.05
673	000630	铜陵有色	15,800	57,038.00	0.05
674	603077	和邦生物	34,500	56,925.00	0.05
675	600916	中国黄金	5,900	56,758.00	0.05
676	002410	广联达	5,900	56,522.00	0.05
677	600637	东方明珠	8,900	54,112.00	0.05
678	600732	爱旭股份	5,900	53,395.00	0.04
679	601966	玲珑轮胎	2,900	53,273.00	0.04
680	601155	新城控股	6,000	53,220.00	0.04
681	603712	七一二	2,900	52,751.00	0.04
682	000785	居然之家	21,400	52,002.00	0.04
683	300390	天华新能	3,000	51,540.00	0.04
684	002568	百润股份	3,000	50,490.00	0.04
685	600989	宝丰能源	2,900	50,257.00	0.04

686	688718	唯赛勃	5,739	49,068.45	0.04
687	600985	淮北矿业	2,900	48,546.00	0.04
688	002607	中公教育	31,200	47,736.00	0.04
689	000581	威孚高科	2,900	47,212.00	0.04
690	000893	亚钾国际	2,900	46,864.00	0.04
691	002603	以岭药业	3,000	45,990.00	0.04
692	601377	兴业证券	9,000	45,540.00	0.04
693	600208	新湖中宝	27,900	44,082.00	0.04
694	000932	华菱钢铁	9,800	43,414.00	0.04
695	001218	丽臣实业	2,900	43,413.00	0.04
696	301223	中荣股份	2,928	43,070.88	0.04
697	600905	三峡能源	9,600	41,856.00	0.03
698	002240	盛新锂能	3,000	40,260.00	0.03
699	002511	中顺洁柔	5,800	40,136.00	0.03
700	600346	恒力石化	2,800	39,060.00	0.03
701	000623	吉林敖东	2,900	38,860.00	0.03
701	000937	冀中能源	5,800	38,860.00	0.03
702	002867	周大生	2,900	37,874.00	0.03
703	601898	中煤能源	2,900	36,192.00	0.03
704	600039	四川路桥	3,400	26,826.00	0.02
705	600153	建发股份	2,800	25,004.00	0.02
706	600755	厦门国贸	3,000	21,510.00	0.02
707	600655	豫园股份	2,700	13,905.00	0.01
708	601868	中国能建	5,600	11,872.00	0.01
709	600010	宝钢股份	5,600	7,840.00	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

2024年7月25日起，证券代码为000975的证券简称由“银泰黄金”变更为“山金国际”。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301589	诺瓦星云	497	93,440.97	0.08
2	603350	安乃达	664	13,651.84	0.01
3	301538	骏鼎达	141	12,864.84	0.01
4	301536	星辰科技	360	11,617.20	0.01
5	603285	键邦股份	611	11,395.15	0.01
6	688691	灿芯股份	222	9,437.22	0.01
7	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
8	688709	成都华微	432	8,117.28	0.01
9	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.01
10	688692	达梦数据	46	8,046.78	0.01
11	301566	达利凯普	458	7,772.26	0.01
12	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.01

13	301587	中瑞股份	251	6,340.26	0.01
14	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
15	301565	中仑新材	303	5,750.94	0.00
16	001389	广合科技	166	5,736.96	0.00
17	688584	上海合晶	351	5,577.39	0.00
18	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
19	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
20	301580	爱迪特	80	5,274.40	0.00
21	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
22	603341	龙旗科技	118	4,423.82	0.00
23	601033	永兴股份	225	3,591.00	0.00
24	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
25	001359	平安电工	137	2,822.20	0.00
26	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
27	603344	星德胜	118	2,673.88	0.00
28	001387	雪祺电气	145	2,211.25	0.00
29	835185	贝特瑞	100	1,838.00	0.00
30	603325	博隆技术	27	1,837.62	0.00
31	001379	腾达科技	124	1,671.52	0.00
32	603312	西典新能	63	1,597.68	0.00
33	603381	永臻股份	56	1,407.28	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	688047	龙芯中科	934,260.53	0.32
2	688114	华大智造	776,252.07	0.27
3	300750	宁德时代	705,885.00	0.24
4	688101	三达膜	455,065.64	0.16
5	000333	美的集团	432,316.00	0.15
6	600702	舍得酒业	426,386.00	0.15
7	301115	建科股份	424,688.00	0.15
8	000651	格力电器	422,139.00	0.15
9	300078	思创医惠	411,656.00	0.14
10	000858	五粮液	410,007.00	0.14
11	300067	安诺其	406,547.00	0.14
12	300760	迈瑞医疗	404,046.00	0.14
13	300237	美晨生态	400,140.00	0.14
14	688113	联测科技	330,832.63	0.11
15	002352	顺丰控股	327,729.00	0.11

16	300454	深信服	323,855.00	0.11
17	000402	金融街	322,058.00	0.11
18	300009	安科生物	318,092.00	0.11
19	000793	华闻集团	316,500.00	0.11
20	300474	景嘉微	310,199.00	0.11

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	300750	宁德时代	2,903,616.60	1.00
2	000333	美的集团	1,738,308.00	0.60
3	300760	迈瑞医疗	1,647,392.00	0.57
4	000858	五粮液	1,589,024.00	0.55
5	688012	中微公司	1,259,915.15	0.43
6	600809	山西汾酒	1,215,777.00	0.42
7	002594	比亚迪	1,119,653.00	0.38
8	002475	立讯精密	1,090,108.00	0.37
9	002415	海康威视	1,017,873.00	0.35
10	000725	京东方 A	977,425.00	0.34
11	000568	泸州老窖	954,957.00	0.33
12	300059	东方财富	943,977.00	0.32
13	000651	格力电器	935,838.00	0.32
14	300308	中际旭创	778,860.00	0.27
15	002714	牧原股份	689,407.00	0.24
16	300124	汇川技术	680,250.00	0.23
17	300394	天孚通信	673,512.00	0.23
18	002142	宁波银行	665,687.00	0.23
19	300498	温氏股份	661,050.00	0.23
20	000063	中兴通讯	640,097.00	0.22

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	75,945,568.39
卖出股票收入（成交）总额	148,853,528.53

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,249,521.53
2	应收清算款	1,711.96
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	1,326,642.61
---	----	--------------

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	301589	诺瓦星云	93,440.97	0.08	新股锁定期内
2	603350	安乃达	13,651.84	0.01	新股未上市
3	301538	骏鼎达	12,864.84	0.01	新股锁定期内
4	301536	星宸科技	11,617.20	0.01	新股锁定期内
5	603285	键邦股份	11,395.15	0.01	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,358	96,775.41	90,074,852.00	68.54	41,346,148.00	31.46

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	22,566,300.00	17.17
2	中信建投证券有限责任公司	13,532,200.00	10.30
3	中国国际金融股份有限公司	10,000,000.00	7.61
4	华泰柏瑞基金—农业银行—华泰柏瑞稳利1号集合资产管理计划	9,400,000.00	7.15

5	招商证券股份有限公司	8,796,150.00	6.69
6	国联证券股份有限公司	8,220,000.00	6.25
7	中国银河证券股份有限公司	5,435,200.00	4.14
8	华金证券股份有限公司	3,978,700.00	3.03
9	广发证券股份有限公司	2,550,600.00	1.94
10	中信证券股份有限公司	2,284,702.00	1.74

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（2023年10月30日） 基金份额总额	635,421,000.00
本报告期期初基金份额总额	299,421,000.00
本报告期基金总申购份额	56,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	224,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	131,421,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	4	119,790,649.24	53.55	18,951.90	16.24	-
广发证券	2	51,892,869.76	23.20	48,567.27	41.61	-
中信建投	2	51,179,841.52	22.88	48,411.88	41.48	-
银河证券	2	831,414.65	0.37	778.14	0.67	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期内：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，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，并能为基金提供全面的信息服；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人，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，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

3、本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	12,598.50	21.79	-	-	-	-
中信建投	45,221.82	78.21	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
招商证	-	-	-	-	-	-

券						
中信证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
3	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
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 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 02 月 24 日
6	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
7	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
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
9	关于同意海通证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 29 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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 (%)
机构	1	20240520-20240521;20240528-20240528; 20240613-20240619;	25,088,400.00	67,980,700.00	70,502,800.00	22,566,300.00	17.17
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>							

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