

# 华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

## 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 12 日（基金合同生效日）起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
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	60

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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
8.3 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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
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 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
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 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
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 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强	
基金主代码	019923	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 12 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	213,082,992.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019923	019924
报告期末下属分级基金的份额总额	108,059,499.50 份	105,023,493.29 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	1、股票投资策略 本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。2、债券投资策略 本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。3、资产支持证券投资策略 资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。4、衍生品投资策略 为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。5、存托凭证投资策略 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。6、融资及转融通证券出借业务的投资策略 本基金在参与融资及转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资及转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混

合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95599
传真	021-38601799	010-68121816
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200135	100031
法定代表人	贾波	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## § 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	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）-2024 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	-19,799,825.90	-20,055,853.92
本期利润	-21,018,727.12	-21,931,973.42
加权平均基金份额本期利润	-0.1289	-0.1342
本期加权平均净值利润率	-13.65%	-14.23%
本期基金份额净值	-13.90%	-14.06%

值增长率		
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	-15,025,063.91	-14,769,928.95
期末可供分配基金份额利润	-0.1390	-0.1406
期末基金资产净值	93,034,435.59	90,253,564.34
期末基金份额净值	0.8610	0.8594
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	-13.90%	-14.06%

注：1、本基金成立于 2024 年 1 月 12 日。

2、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。

3、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。

4、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

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.83%	1.62%	-8.70%	1.76%	1.87%	-0.14%
过去三个月	-9.88%	1.38%	-13.06%	1.91%	3.18%	-0.53%
自基金合同生效起至今	-13.90%	1.11%	-19.56%	2.44%	5.66%	-1.33%

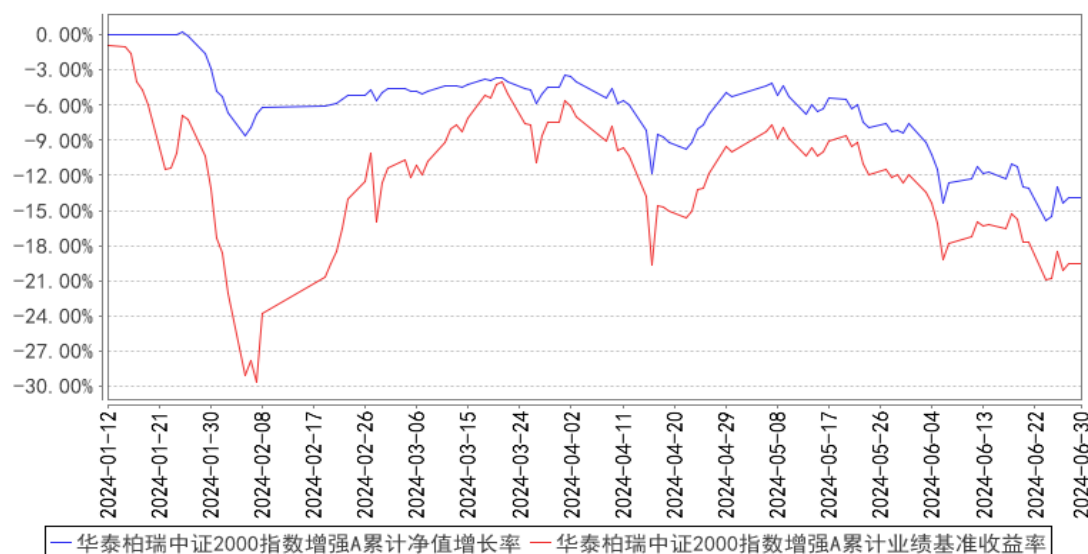
华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

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

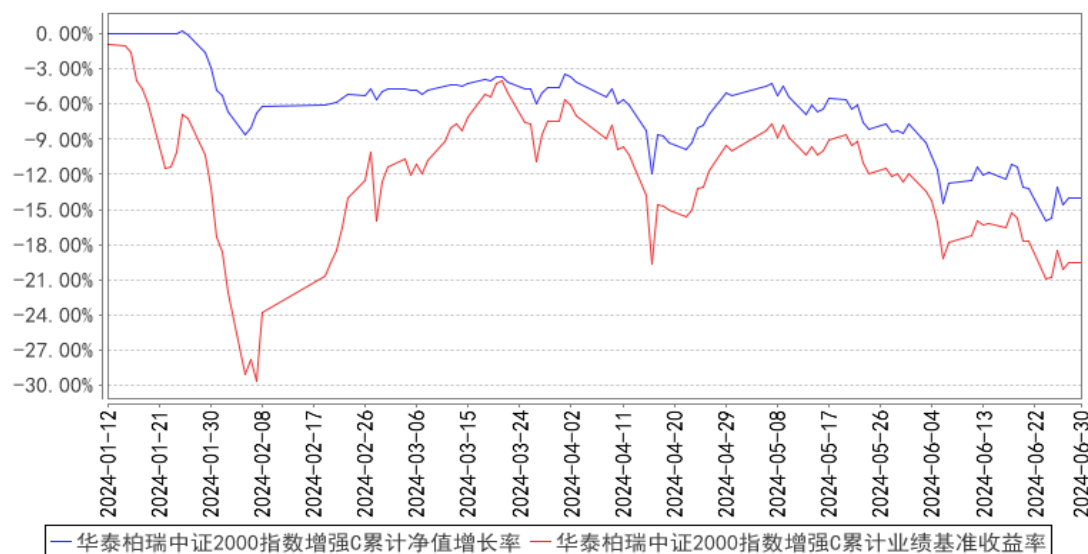
	率①	准差②		④		
过去一个月	-6.86%	1.62%	-8.70%	1.76%	1.84%	-0.14%
过去三个月	-9.97%	1.38%	-13.06%	1.91%	3.09%	-0.53%
自基金合同生效起 至今	-14.06%	1.11%	-19.56%	2.44%	5.50%	-1.33%

### 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

华泰柏瑞中证2000指数增强A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



华泰柏瑞中证2000指数增强C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、A类图示日期为2024年1月12日至2024年6月30日。C类图示日期为2024年1月12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		
雷文渊	本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	6 年	复旦大学数学学院本科、金融专业硕士。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2022 年 8 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
孔令焯	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	9 年	英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份公司高级分析师。2017 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
盛豪	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	16 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管

				<p>理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。现任量化与海外投资部总监。2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 11 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
----	------	---------	---------	------

盛豪	公募基金	8	2,191,930,873.11	2015 年 10 月 13 日
	私募资产管理计划	1	3,565,114.82	2022 年 12 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	2,195,495,987.93	-

#### 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，A 股整体呈震荡走势，风格上分化较大。春节过后，市场从前期由短期资金流造成的剧烈波动中恢复，转而更加关注公司基本面。一方面，随着美国 OpenAI 公司和苹果公司在 AI 软件和硬件上的推陈出新，AI 算力的成长性打开向上空间。同时，伴随着海外产能和基础设施建设，供应链转移等因素，上游大宗商品和设备出口迎来涨价和业绩兑现。而另一方面，大部分中下游和内需相关产业链经历了业绩预期下修的过程。上半年，A 股市场中银行、能源、公

用事业等高股息相关行业表现较强，同时以人工智能创新链、消费电子复苏链为代表的“科特估”主题先后成为市场热点。

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

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，构建选股策略。在四月国九条新规出来后，大小盘分化较大，以技术面为主的策略波动也较大。我们在严控风控的同时，也对模型进行了适应性调整，力求在当前高波动的市场，增强模型的稳定性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 0.8610 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.90%，同期业绩比较基准收益率为-19.56%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 0.8594 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.06%，同期业绩比较基准收益率为-19.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，我们观察到一些市场风险进一步释放清，国内地产政策力度的加大进一步落地，A 股市场对外海货币政策与地缘冲突的不稳定性短期敏感度下降。在经历了短期流动性冲击之后，市场可能还有一定的波动，但基本面的逐渐改善与市场情绪的修复均已显现端倪，部分短期经济数据的改善一定程度上超出市场预期。短周期来看，新一轮的财报期将在 7 月开始，政策面预期也有所加强，市场将可能调整定价逻辑、边际上增加对基本面的关注，交易风格可能由局部抱团转回更加均衡。

从投资分散化的角度上，在外部环境不确定性持续以及财富效应较弱的背景下，在当前的市场环境下增量资金大举入市的效应需要多种因素配合，资金可能较难形成极致抱团，分散化投资且覆盖度广的量化选股可能更有选股优势，完善的风控体系也许能更好的应对市场波动。短期流动性冲击已逐渐平缓，后续投资人配置调整对市场的影响可能将是一个缓释的过程。

量化策略方面，当前我们的组合配置依然较为均衡，一方面，模型的技术面因子通过捕捉资金流特征，能较好地为主题和事件中获取超额。另一方面，基本面因子挑选出绩优低估，且具有不错成长性的股票，增加模型的稳定性。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值偏低，经济基本面向好。我们在坚持控制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的超额收益。

#### 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

本报告期内，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华泰柏瑞基金管理有限公司 2024 年 1 月 12 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，华泰柏瑞基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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 2000 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	26,289,617.40
结算备付金		2,287,217.48
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	155,892,433.82
其中：股票投资		155,892,433.82
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		117,488.25
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		184,586,756.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		7,460.64
应付赎回款		1,007,609.59

应付管理人报酬		127,222.27
应付托管费		15,902.76
应付销售服务费		31,848.50
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	108,713.26
负债合计		1,298,757.02
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	213,082,992.79
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-29,794,992.86
净资产合计		183,287,999.93
负债和净资产总计		184,586,756.95

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 213,082,992.79 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8610 元，基金份额总额 108,059,499.50 份；下属 C 类基金份额净值 0.8594 元，基金份额总额 105,023,493.29 份。

2、本基金基金合同生效日为 2024 年 01 月 12 日，无上年度末数据。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-41,279,488.22
1. 利息收入		1,011,649.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	646,160.78
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		365,488.90
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-39,570,414.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-40,292,741.17
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
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	-149,277.76

股利收益	6.4.7.19	871,604.36
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	-3,095,020.72
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	374,297.39
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,671,212.32</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,151,849.05
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	143,981.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	288,048.32
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		-
8. 其他费用	6.4.7.23	87,333.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-42,950,700.54</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-42,950,700.54</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-42,950,700.54</b>

注：本基金成立于 2024 年 01 月 12 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 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	433,027,203.26	-	-	433,027,203.26



资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-219,944,210.47	-	-29,794,992.86	-249,739,203.33
(一)、综合收益总额	-	-	-42,950,700.54	-42,950,700.54
(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)	-219,944,210.47	-	13,155,707.68	-206,788,502.79
其中：1. 基金申购款	10,790,048.94	-	-898,089.22	9,891,959.72
2. 基金赎回款	-230,734,259.41	-	14,053,796.90	-216,680,462.51
(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	213,082,992.79	-	-29,794,992.86	183,287,999.93

注：本基金成立于 2024 年 01 月 12 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：

<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 2000 指数增强型证券投资基金(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]2362 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 指数增强型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 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 432,911,777.68 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(2024)第 0017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 433,027,203.26 份基金份额，其中认购资金利息折合 115,425.58 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)、货币市场工具(含同业存单)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的资产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、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率 $\times$ 95%+人民币活期存款税后利率 $\times$ 5%。

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 8 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 2000 指数增强型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 12 日(基金合同生效日)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 12 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 01 月 12 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以

发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 6.4.4.13 分部报告

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金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。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

#### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	26,289,617.40
等于：本金	26,287,052.75
加：应计利息	2,564.65
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	26,289,617.40

##### 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	158,987,454.54	-	155,892,433.82	-3,095,020.72
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	158,987,454.54	-	155,892,433.82	-3,095,020.72

### 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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 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。

#### 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。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	712.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,703.84
其他应付款	21,296.50
合计	108,713.26

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	218,645,473.34	218,645,473.34
本期申购	757,561.46	757,561.46
本期赎回（以“-”号填列）	-111,343,535.30	-111,343,535.30
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	108,059,499.50	108,059,499.50

##### 华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	214,381,729.92	214,381,729.92
本期申购	10,032,487.48	10,032,487.48
本期赎回（以“-”号填列）	-119,390,724.11	-119,390,724.11
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	105,023,493.29	105,023,493.29

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2023 年 12 月 20 日至 2024 年 1 月 10 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 432,911,777.68 元，折合为 432,911,777.68 份基金份额（其中 A 类基金份额 218,563,551.66 份，C 类基金份额 214,348,226.02 份）。根据《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 115,425.58 元在本基金成立后，折合为 115,425.58 份基金份额（其中 A 类基金份额 81,921.68 份，C 类基金份额 33,503.90 份），划入基金份额持有人账户。

3、根据《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》及《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回（转换、定期定额投资）业务公告》的相关规定，本基金于 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 3 月 24 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、转换和定期定额投资业务自 2024 年 3 月 25 日起开始办理。

#### 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

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-19,799,825.90	-1,218,901.22	-21,018,727.12
本期基金份额交易产生的变动数	5,096,649.30	897,013.91	5,993,663.21
其中：基金申购款	-49,116.44	-4,235.66	-53,352.10
基金赎回款	5,145,765.74	901,249.57	6,047,015.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,703,176.60	-321,887.31	-15,025,063.91

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-20,055,853.92	-1,876,119.50	-21,931,973.42
本期基金份额交易产生的变动数	5,599,398.75	1,562,645.72	7,162,044.47
其中：基金申购款	-697,303.06	-147,434.06	-844,737.12
基金赎回款	6,296,701.81	1,710,079.78	8,006,781.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,456,455.17	-313,473.78	-14,769,928.95

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月12日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
活期存款利息收入	209,665.54	
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	436,495.24	
其他	-	
合计	646,160.78	

#### 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12日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-40,292,741.17	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-40,292,741.17	

##### 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12日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	1,417,816,474.44	
减：卖出股票成本总额	1,456,467,401.90	
减：交易费用	1,641,813.71	

买卖股票差价收入

-40,292,741.17

#### 6.4.7.14.3 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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-149,277.76

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	871,604.36
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	871,604.36

#### 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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,095,020.72
股票投资	-3,095,020.72
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,095,020.72

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	365,219.19



基金转换费收入	9,078.20
合计	374,297.39

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	28,900.71
信息披露费	57,803.13
证券出借违约金	-
银行划款手续费	630.00
合计	87,333.84

#### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、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、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月12日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	3,032,950,487.49	100.00

注：本基金成立于2024年01月12日，无上年可比期间数据。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

2、本基金成立于2024年01月12日，无上年可比期间数据。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月12日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
华泰证券	3,406,000,000.00	100.00

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

2、本基金成立于2024年01月12日，无上年可比期间数据。

###### 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12日（基金合同生效日）至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	739,650.67	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）。

3、本基金成立于2024年01月12日，无上年可比期间数据。

## 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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,151,849.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	484,955.07
应支付基金管理人的净管理费	666,893.98

注：自 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80 % 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80 \% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	143,981.11

注：自 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）起，支付基金托管人农业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：

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	合计
农业银行股份有限公司	0.00	143,832.09	143,832.09
华泰证券股份有限公司	0.00	122,377.67	122,377.67
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	0.72	0.72
合计	0.00	266,210.48	266,210.48

注：自 2024 年 1 月 12 日起，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.4 \% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人按照与基金管理人约定的时间从基金资产中一次性支取。

#### 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：1、本基金本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。

2、本基金成立于 2024 年 01 月 12 日，无上年可比期间数据。

#### 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：1、本基金本报告期末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。

2、本基金成立于 2024 年 01 月 12 日，无上年可比期间数据。

##### 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：1、本基金本报告期末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。

2、本基金成立于 2024 年 01 月 12 日，无上年可比期间数据。

#### 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 2024 年 01 月 12 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，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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,831,103.90	157,650.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）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
华泰联合证券有限责任公司	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26705.80

注：本基金成立于 2024 年 01 月 12 日，无上年可比期间数据。

#### 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。本基金成立于 2024 年 01 月 12 日，无上年可比期间数据。

#### 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
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	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	55.82	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	11.88	18.98	485	5,761.80	9,205.30	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	44.95	65.93	125	5,618.75	8,241.25	-
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	-
603344	星德胜	2024 年 3 月	6 个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-

		13 日		期内						
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

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的流通受限股票。

#### 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

本基金是一只股票指数增强型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现超越标的指数的投资收益，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，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。

#### 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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	26,289,617.40	-	-	-	-	-	26,289,617.40
结算备付金	2,287,217.48	-	-	-	-	-	2,287,217.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	155,892,433.82	155,892,433.82
应收申购款	-	-	-	-	-	117,488.25	117,488.25
资产总计	28,576,834.88	-	-	-	-	156,009,922.07	184,586,756.95
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,007,609.59	1,007,609.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	127,222.27	127,222.27
应付托管费	-	-	-	-	-	15,902.76	15,902.76
应付清算款	-	-	-	-	-	7,460.64	7,460.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,848.50	31,848.50
其他负债	-	-	-	-	-	108,713.26	108,713.26
负债总计	-	-	-	-	-	1,298,757.02	1,298,757.02
利率敏感度缺口	28,576,834.88	-	-	-	-	-154,711,165.05	183,287,999.93

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	155,892,433.82	85.05
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	155,892,433.82	85.05

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 2000 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）

中证 2000 指数上升 5%	7,804,951.62
中证 2000 指数下降 5%	-7,804,951.62

#### 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
第一层次	155,832,183.63
第二层次	-
第三层次	60,250.19
合计	155,892,433.82

###### 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。

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	155,892,433.82	84.45
	其中：股票	155,892,433.82	84.45
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	28,576,834.88	15.48
8	其他各项资产	117,488.25	0.06
9	合计	184,586,756.95	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	246,309.00	0.13
B	采矿业	1,762,907.00	0.96
C	制造业	112,888,057.85	61.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,763,709.00	0.96
E	建筑业	1,708,164.00	0.93
F	批发和零售业	7,191,466.00	3.92
G	交通运输、仓储和邮政业	1,878,413.00	1.02
H	住宿和餐饮业	382,872.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,039,174.97	7.66

J	金融业	114,844.00	0.06
K	房地产业	1,117,772.00	0.61
L	租赁和商务服务业	1,977,908.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	1,707,260.00	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	4,050,269.00	2.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	510,342.00	0.28
Q	卫生和社会工作	45,929.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	4,507,037.00	2.46
S	综合	-	-
	合计	155,892,433.82	85.05

### 7.2.2 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

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	688510	航亚科技	59,400	1,093,554.00	0.60
2	603319	湘油泵	65,800	1,052,142.00	0.57
3	603626	科森科技	175,500	975,780.00	0.53
4	300153	科泰电源	162,800	968,660.00	0.53
5	002111	威海广泰	92,000	958,640.00	0.52
6	000788	北大医药	189,200	944,108.00	0.52
7	688179	阿拉丁	97,200	939,924.00	0.51
8	002662	京威股份	307,300	934,192.00	0.51
9	300105	龙源技术	143,100	924,426.00	0.50
10	300614	百川畅银	95,400	867,186.00	0.47
11	600262	北方股份	52,700	865,861.00	0.47
12	603313	梦百合	110,100	822,447.00	0.45
13	001212	中旗新材	40,500	822,150.00	0.45
14	601999	出版传媒	156,800	818,496.00	0.45
15	002362	汉王科技	48,900	814,185.00	0.44
16	002296	辉煌科技	78,700	811,397.00	0.44
17	603322	超讯通信	30,500	808,555.00	0.44
18	300445	康斯特	49,100	790,510.00	0.43
19	301117	佳缘科技	30,400	784,320.00	0.43
20	603096	新经典	45,300	765,570.00	0.42
21	300571	平治信息	36,400	762,216.00	0.42
22	300452	山河药辅	66,800	758,848.00	0.41
23	600551	时代出版	104,100	737,028.00	0.40
24	300016	北陆药业	164,300	724,563.00	0.40
25	002093	国脉科技	119,100	722,937.00	0.39

26	002866	传艺科技	56,100	722,007.00	0.39
27	603558	健盛集团	72,500	721,375.00	0.39
28	603999	读者传媒	148,200	700,986.00	0.38
29	600292	远达环保	147,600	692,244.00	0.38
30	603012	创力集团	150,300	670,338.00	0.37
31	605005	合兴股份	41,700	665,532.00	0.36
32	002174	游族网络	87,400	663,366.00	0.36
33	300710	万隆光电	43,600	661,412.00	0.36
34	002009	天奇股份	57,700	654,318.00	0.36
35	002877	智能自控	88,400	653,276.00	0.36
36	002896	中大力德	23,300	650,070.00	0.35
37	600880	博瑞传播	171,900	646,344.00	0.35
38	300978	东箭科技	69,300	639,639.00	0.35
39	002609	捷顺科技	83,600	633,688.00	0.35
40	002137	实益达	132,900	632,604.00	0.35
41	002392	北京利尔	200,600	631,890.00	0.34
42	300278	华昌达	217,600	624,512.00	0.34
43	603508	思维列控	33,300	624,375.00	0.34
44	002169	智光电气	141,500	624,015.00	0.34
45	603889	新澳股份	80,300	621,522.00	0.34
46	605056	咸亨国际	57,600	620,928.00	0.34
47	300709	精研科技	24,400	616,832.00	0.34
48	603806	福斯特	41,400	608,580.00	0.33
49	002029	七匹狼	119,400	601,776.00	0.33
50	603110	东方材料	54,000	601,020.00	0.33
51	301185	鸥玛软件	41,800	598,994.00	0.33
52	301305	朗坤环境	39,000	593,190.00	0.32
53	002615	哈尔斯	94,900	588,380.00	0.32
54	000501	武商集团	88,100	587,627.00	0.32
55	601500	通用股份	109,900	586,866.00	0.32
56	002687	乔治白	139,600	586,320.00	0.32
57	301202	朗威股份	21,800	583,368.00	0.32
58	300648	星云股份	34,100	579,018.00	0.32
59	002264	新华都	110,400	564,144.00	0.31
60	688551	科威尔	17,900	563,850.00	0.31
61	300608	思特奇	62,300	559,454.00	0.31
62	600327	大东方	174,600	558,720.00	0.30
63	603199	九华旅游	18,600	554,280.00	0.30
64	002897	意华股份	14,700	553,602.00	0.30
65	603258	电魂网络	34,100	550,715.00	0.30
66	603556	海兴电力	11,600	543,228.00	0.30
67	300375	鹏翎股份	140,000	541,800.00	0.30
68	002527	新时达	90,200	540,298.00	0.29

69	000715	中兴商业	112,600	535,976.00	0.29
70	300815	玉禾田	45,800	533,112.00	0.29
71	301075	多瑞医药	33,500	532,650.00	0.29
72	600831	广电网络	198,700	532,516.00	0.29
73	300349	金卡智能	43,300	516,136.00	0.28
74	600819	耀皮玻璃	121,900	514,418.00	0.28
75	002073	软控股份	69,100	510,649.00	0.28
76	601608	中信重工	134,000	510,540.00	0.28
77	300566	激智科技	36,200	506,438.00	0.28
78	603097	江苏华辰	18,900	501,228.00	0.27
79	002988	豪美新材	32,300	495,805.00	0.27
80	603661	恒林股份	11,700	493,857.00	0.27
81	603416	信捷电气	17,100	488,718.00	0.27
82	603949	雪龙集团	42,900	483,054.00	0.26
83	002469	三维化学	84,700	482,790.00	0.26
84	688533	上声电子	18,648	482,423.76	0.26
85	002613	北玻股份	138,400	481,632.00	0.26
86	002580	圣阳股份	77,100	474,165.00	0.26
87	600523	贵航股份	47,500	470,250.00	0.26
88	300842	帝科股份	12,100	469,480.00	0.26
89	301266	宇邦新材	15,300	468,792.00	0.26
90	601918	新集能源	47,900	467,025.00	0.25
91	002878	元隆雅图	37,100	466,347.00	0.25
92	605167	利柏特	59,700	466,257.00	0.25
93	601116	三江购物	61,000	464,210.00	0.25
94	300194	福安药业	123,800	463,012.00	0.25
95	603985	恒润股份	38,800	461,720.00	0.25
96	300453	三鑫医疗	72,100	460,719.00	0.25
97	300446	航天智造	38,700	460,530.00	0.25
98	600757	长江传媒	57,000	459,420.00	0.25
99	300439	美康生物	49,800	456,168.00	0.25
100	300327	中颖电子	22,819	449,077.92	0.25
101	300378	鼎捷软件	27,600	449,052.00	0.24
102	002204	大连重工	104,900	447,923.00	0.24
103	603367	辰欣药业	32,000	446,080.00	0.24
104	002153	石基信息	77,700	445,221.00	0.24
105	603186	华正新材	18,700	444,686.00	0.24
106	002722	物产金轮	39,100	441,830.00	0.24
107	600081	东风科技	50,400	441,000.00	0.24
108	600718	东软集团	53,300	440,791.00	0.24
109	600455	博通股份	29,800	438,656.00	0.24
110	003025	思进智能	35,600	438,236.00	0.24
111	300693	盛弘股份	20,900	437,646.00	0.24

112	301515	港通医疗	22,800	436,392.00	0.24
112	600103	青山纸业	255,200	436,392.00	0.24
113	002695	煌上煌	66,500	431,585.00	0.24
114	002833	弘亚数控	23,600	430,464.00	0.23
115	000790	华神科技	124,200	429,732.00	0.23
116	002448	中原内配	74,800	429,352.00	0.23
117	002838	道恩股份	47,200	427,632.00	0.23
118	002040	南京港	78,100	426,426.00	0.23
119	002023	海特高新	46,500	425,475.00	0.23
120	300450	先导智能	25,300	420,739.00	0.23
121	601038	一拖股份	26,600	420,546.00	0.23
122	300179	四方达	63,600	420,396.00	0.23
123	300258	精锻科技	51,600	419,508.00	0.23
124	688501	青达环保	30,600	418,608.00	0.23
125	300304	云意电气	64,300	418,593.00	0.23
126	002412	汉森制药	79,500	411,015.00	0.22
127	002849	威星智能	36,700	409,572.00	0.22
128	605218	伟时电子	25,300	408,595.00	0.22
129	002393	力生制药	25,820	408,214.20	0.22
130	002272	川润股份	90,700	406,336.00	0.22
131	300149	睿智医药	102,100	404,316.00	0.22
132	601700	风范股份	91,700	402,563.00	0.22
133	688270	臻镭科技	15,400	401,940.00	0.22
134	300943	春晖智控	37,200	401,388.00	0.22
135	600971	恒源煤电	33,600	401,184.00	0.22
136	002589	瑞康医药	181,200	398,640.00	0.22
137	002108	沧州明珠	130,100	398,106.00	0.22
138	300326	凯利泰	104,700	397,860.00	0.22
139	002749	国光股份	26,300	395,552.00	0.22
140	002277	友阿股份	183,000	395,280.00	0.22
141	603918	金桥信息	37,800	395,010.00	0.22
142	301168	通灵股份	14,100	391,698.00	0.21
143	002867	周大生	29,900	390,494.00	0.21
144	300569	天能重工	93,600	389,376.00	0.21
145	000920	沃顿科技	53,100	389,223.00	0.21
146	300995	奇德新材	25,200	388,584.00	0.21
147	300522	世名科技	35,100	387,855.00	0.21
148	002825	纳尔股份	62,200	387,506.00	0.21
149	300547	川环科技	23,700	387,495.00	0.21
150	600367	红星发展	39,100	387,481.00	0.21
151	000952	广济药业	77,500	386,725.00	0.21
152	688313	仕佳光子	40,600	386,512.00	0.21
153	001269	欧晶科技	13,900	386,420.00	0.21



154	001207	联科科技	26,600	386,232.00	0.21
155	001360	南矿集团	31,300	384,677.00	0.21
156	600580	卧龙电驱	31,600	383,940.00	0.21
157	601007	金陵饭店	60,200	382,872.00	0.21
158	688080	映翰通	12,600	382,158.00	0.21
159	003000	劲仔食品	31,500	379,575.00	0.21
160	300622	博士眼镜	31,100	378,487.00	0.21
161	000404	长虹华意	70,200	374,166.00	0.20
162	002852	道道全	51,900	373,680.00	0.20
163	002056	横店东磁	29,900	372,853.00	0.20
164	600872	中炬高新	16,400	372,116.00	0.20
165	300142	沃森生物	32,400	368,712.00	0.20
166	300966	共同药业	22,500	367,650.00	0.20
167	301060	兰卫医学	45,200	367,024.00	0.20
168	002912	中新赛克	20,600	365,032.00	0.20
169	002112	三变科技	41,000	364,080.00	0.20
170	300753	爱朋医疗	33,000	361,350.00	0.20
171	002553	南方精工	38,900	360,603.00	0.20
172	301063	海锅股份	25,000	358,500.00	0.20
173	603967	中创物流	38,500	358,050.00	0.20
174	603298	杭叉集团	18,200	357,448.00	0.20
175	601717	郑煤机	24,100	356,680.00	0.19
176	688348	昱能科技	6,000	354,000.00	0.19
177	605177	东亚药业	16,000	353,120.00	0.19
178	002664	信质集团	29,600	352,240.00	0.19
179	603666	亿嘉和	22,300	351,894.00	0.19
180	300062	中能电气	72,100	351,127.00	0.19
181	300424	航新科技	28,600	349,778.00	0.19
182	002565	顺灏股份	146,000	348,940.00	0.19
183	300490	华自科技	48,700	348,692.00	0.19
184	001367	海森药业	14,900	347,766.00	0.19
185	603610	麒盛科技	35,100	346,788.00	0.19
186	603165	荣晟环保	32,100	340,902.00	0.19
187	601008	连云港	98,900	340,216.00	0.19
188	603600	永艺股份	31,800	331,992.00	0.18
189	300047	天源迪科	50,600	330,924.00	0.18
190	603758	秦安股份	43,200	328,320.00	0.18
191	300562	乐心医疗	36,800	327,888.00	0.18
192	600563	法拉电子	4,300	327,574.00	0.18
193	603648	畅联股份	41,300	327,096.00	0.18
194	002876	三利谱	13,400	323,208.00	0.18
195	300049	福瑞股份	6,400	322,176.00	0.18
196	603283	赛腾股份	4,200	320,880.00	0.18

197	300238	冠昊生物	35,600	320,400.00	0.17
198	002587	奥拓电子	59,000	317,420.00	0.17
199	002598	山东章鼓	42,700	316,834.00	0.17
200	000973	佛塑科技	85,300	314,757.00	0.17
201	600379	宝光股份	37,600	311,704.00	0.17
202	002342	巨力索具	108,200	311,616.00	0.17
203	003020	立方制药	17,000	310,760.00	0.17
204	002955	鸿合科技	13,200	308,616.00	0.17
205	603158	腾龙股份	43,700	307,648.00	0.17
206	300731	科创新源	21,000	307,440.00	0.17
207	002725	跃岭股份	36,700	306,812.00	0.17
208	003005	竞业达	14,700	306,348.00	0.17
209	603768	常青股份	27,000	306,180.00	0.17
210	002376	新北洋	56,800	306,152.00	0.17
211	300872	天阳科技	23,100	306,075.00	0.17
212	600282	南钢股份	61,400	305,772.00	0.17
213	301102	兆讯传媒	25,900	305,361.00	0.17
214	000045	深纺织 A	38,000	304,760.00	0.17
215	603859	能科科技	14,400	302,688.00	0.17
216	601598	中国外运	53,500	301,205.00	0.16
217	002437	誉衡药业	176,100	299,370.00	0.16
218	603686	福龙马	39,100	297,942.00	0.16
219	603518	锦泓集团	33,800	297,440.00	0.16
220	301429	森泰股份	19,400	296,820.00	0.16
221	300687	赛意信息	21,300	296,496.00	0.16
222	002406	远东传动	60,000	295,800.00	0.16
223	300341	麦克奥迪	34,400	295,152.00	0.16
224	002035	华帝股份	47,300	294,679.00	0.16
225	300560	中富通	27,200	294,304.00	0.16
226	002933	新兴装备	12,800	293,248.00	0.16
227	688636	智明达	12,800	291,840.00	0.16
228	600503	华丽家族	162,700	291,233.00	0.16
229	300664	鹏鹞环保	64,700	287,915.00	0.16
230	000753	漳州发展	102,100	286,901.00	0.16
231	002167	东方锆业	50,100	285,069.00	0.16
232	000058	深赛格	53,000	284,610.00	0.16
233	002132	恒星科技	133,000	281,960.00	0.15
234	301013	利和兴	26,400	281,952.00	0.15
235	600135	乐凯胶片	57,200	279,136.00	0.15
236	002140	东华科技	35,900	278,225.00	0.15
237	300235	方直科技	34,500	276,690.00	0.15
238	301030	仕净科技	11,200	275,744.00	0.15
239	000655	金岭矿业	49,800	275,394.00	0.15

240	002768	国恩股份	14,700	274,890.00	0.15
241	600822	上海物贸	35,000	273,700.00	0.15
242	300610	晨化股份	30,800	270,116.00	0.15
243	300940	南极光	21,100	268,814.00	0.15
244	300707	威唐工业	21,700	268,646.00	0.15
245	300662	科锐国际	16,500	266,145.00	0.15
246	600613	神奇制药	49,500	264,825.00	0.14
247	600546	山煤国际	18,100	264,622.00	0.14
248	301160	翔楼新材	7,100	264,475.00	0.14
249	600814	杭州解百	44,800	264,320.00	0.14
250	600351	亚宝药业	47,000	263,670.00	0.14
251	688559	海目星	8,000	263,120.00	0.14
252	002062	宏润建设	74,200	258,216.00	0.14
253	300184	力源信息	55,600	257,428.00	0.14
254	300510	金冠股份	73,200	256,200.00	0.14
255	002563	森马服饰	44,000	255,640.00	0.14
256	002279	久其软件	59,200	255,152.00	0.14
257	002953	日丰股份	32,450	254,408.00	0.14
258	600566	济川药业	8,000	253,680.00	0.14
259	688499	利元亨	13,200	252,516.00	0.14
260	600479	千金药业	24,800	252,216.00	0.14
261	688365	光云科技	41,800	251,636.00	0.14
262	000737	北方铜业	27,000	250,560.00	0.14
263	300797	钢研纳克	27,000	250,020.00	0.14
264	600796	钱江生化	57,200	249,392.00	0.14
265	300213	佳讯飞鸿	43,700	249,090.00	0.14
266	000153	丰原药业	46,000	247,480.00	0.14
267	300296	利亚德	54,700	246,150.00	0.13
268	000698	沈阳化工	80,700	245,328.00	0.13
269	603977	国泰集团	24,100	245,097.00	0.13
270	600619	海立股份	47,300	244,541.00	0.13
271	300250	初灵信息	22,300	243,070.00	0.13
272	603028	赛福天	43,100	242,653.00	0.13
273	000020	深华发 A	24,500	242,550.00	0.13
274	688088	虹软科技	8,400	242,424.00	0.13
275	001270	铖昌科技	6,600	242,352.00	0.13
276	603681	永冠新材	19,000	242,250.00	0.13
277	603063	禾望电气	15,800	242,214.00	0.13
278	688663	新风光	10,400	242,008.00	0.13
279	600348	华阳股份	24,200	241,032.00	0.13
280	300145	中金环境	95,000	237,500.00	0.13
281	603095	越剑智能	18,000	235,980.00	0.13
282	603121	华培动力	33,100	235,672.00	0.13

283	603004	鼎龙科技	13,800	233,910.00	0.13
284	002870	香山股份	7,800	232,674.00	0.13
285	605128	上海沿浦	8,300	231,487.00	0.13
286	300409	道氏技术	26,800	229,408.00	0.13
287	600054	黄山旅游	20,000	224,400.00	0.12
288	002518	科士达	12,600	223,020.00	0.12
289	600846	同济科技	32,100	219,243.00	0.12
290	600251	冠农股份	30,200	218,648.00	0.12
291	300491	通合科技	15,200	218,272.00	0.12
292	688121	卓然股份	18,000	216,360.00	0.12
293	301011	华立科技	14,000	215,740.00	0.12
294	002660	茂硕电源	28,800	213,696.00	0.12
295	300299	富春股份	61,500	213,405.00	0.12
296	000544	中原环保	27,000	212,490.00	0.12
297	300272	开能健康	43,300	212,170.00	0.12
298	300625	三雄极光	19,900	208,751.00	0.11
299	300286	安科瑞	9,600	207,744.00	0.11
300	002759	天际股份	30,100	207,088.00	0.11
301	300532	今天国际	16,800	206,472.00	0.11
302	603212	赛伍技术	18,700	206,448.00	0.11
303	002761	浙江建投	26,400	206,184.00	0.11
304	600488	津药药业	59,900	205,457.00	0.11
305	002915	中欣氟材	20,600	204,970.00	0.11
306	600558	大西洋	56,900	204,840.00	0.11
307	002935	天奥电子	16,900	204,152.00	0.11
308	002125	湘潭电化	20,900	203,357.00	0.11
309	300435	中泰股份	17,200	202,444.00	0.11
310	605305	中际联合	7,800	201,162.00	0.11
311	605118	力鼎光电	13,500	201,015.00	0.11
312	603345	安井食品	2,700	200,637.00	0.11
313	300057	万顺新材	49,300	199,172.00	0.11
314	002995	天地在线	15,000	198,000.00	0.11
315	603706	东方环宇	13,500	197,775.00	0.11
316	002474	榕基软件	45,200	197,072.00	0.11
317	002189	中光学	14,100	196,554.00	0.11
318	001255	博菲电气	8,900	194,376.00	0.11
319	002104	恒宝股份	36,700	193,776.00	0.11
320	002606	大连电瓷	25,800	193,758.00	0.11
321	301149	隆华新材	20,900	193,116.00	0.11
322	600980	北矿科技	14,800	192,844.00	0.11
323	603711	香飘飘	13,900	192,515.00	0.11
324	600535	天士力	15,300	192,474.00	0.11
325	300539	横河精密	23,600	189,980.00	0.10

326	002909	集泰股份	45,900	188,190.00	0.10
327	600929	雪天盐业	35,500	188,150.00	0.10
328	300402	宝色股份	14,300	185,614.00	0.10
329	300481	濮阳惠成	13,400	184,920.00	0.10
330	000016	深康佳 A	86,500	184,245.00	0.10
331	603878	武进不锈	27,900	182,466.00	0.10
332	002066	瑞泰科技	22,900	182,055.00	0.10
333	603939	益丰药房	7,400	181,670.00	0.10
334	001215	千味央厨	6,400	180,928.00	0.10
335	003028	振邦智能	5,000	180,300.00	0.10
336	300328	宜安科技	41,900	179,332.00	0.10
337	600470	六国化工	46,700	178,394.00	0.10
338	300066	三川智慧	61,500	175,890.00	0.10
339	603173	福斯达	8,100	175,851.00	0.10
340	000598	兴蓉环境	23,300	175,216.00	0.10
341	600612	老凤祥	3,000	174,570.00	0.10
342	600185	格力地产	40,900	173,825.00	0.09
343	300752	隆利科技	12,800	173,824.00	0.09
344	000635	英力特	29,700	173,745.00	0.09
345	603788	宁波高发	14,100	173,148.00	0.09
346	603051	鹿山新材	7,900	172,457.00	0.09
347	600956	新天绿能	21,100	172,387.00	0.09
348	600987	航民股份	24,300	171,558.00	0.09
349	002885	京泉华	15,800	170,324.00	0.09
350	603917	合力科技	15,600	168,792.00	0.09
351	300252	金信诺	26,900	168,125.00	0.09
352	300824	北鼎股份	23,100	167,475.00	0.09
353	002441	众业达	21,900	166,002.00	0.09
354	301020	密封科技	10,300	162,946.00	0.09
355	600207	安彩高科	42,900	162,591.00	0.09
356	605366	宏柏新材	27,900	162,099.00	0.09
357	002449	国星光电	22,700	161,624.00	0.09
358	600590	泰豪科技	42,400	161,544.00	0.09
359	000631	顺发恒业	68,900	161,226.00	0.09
360	002067	景兴纸业	58,100	158,032.00	0.09
361	002886	沃特股份	11,600	157,992.00	0.09
362	002642	荣联科技	30,600	157,896.00	0.09
363	600169	太原重工	85,900	157,197.00	0.09
364	002803	吉宏股份	14,100	156,933.00	0.09
365	301362	民爆光电	4,600	156,676.00	0.09
366	688066	航天宏图	8,800	156,640.00	0.09
367	000812	陕西金叶	43,400	155,806.00	0.09
368	000892	欢瑞世纪	62,200	155,500.00	0.08

369	002536	飞龙股份	16,200	154,224.00	0.08
370	002491	通鼎互联	45,500	153,790.00	0.08
371	002514	宝馨科技	36,800	151,984.00	0.08
372	000417	合肥百货	36,300	150,645.00	0.08
373	300683	海特生物	7,100	150,236.00	0.08
374	688048	长光华芯	4,800	149,952.00	0.08
375	002481	双塔食品	38,500	148,995.00	0.08
376	605028	世茂能源	10,300	148,629.00	0.08
377	002404	嘉欣丝绸	28,000	148,120.00	0.08
378	300651	金陵体育	12,200	147,864.00	0.08
379	600897	厦门空港	11,700	147,537.00	0.08
380	300440	运达科技	28,000	147,000.00	0.08
381	300719	安达维尔	8,600	145,770.00	0.08
382	000931	中关村	41,100	145,083.00	0.08
383	603701	德宏股份	13,700	144,946.00	0.08
384	301021	英诺激光	9,200	144,256.00	0.08
385	000883	湖北能源	24,000	144,240.00	0.08
386	603439	贵州三力	11,300	144,188.00	0.08
387	600230	沧州大化	14,200	143,846.00	0.08
388	002246	北化股份	17,100	143,811.00	0.08
389	600990	四创电子	8,100	142,155.00	0.08
390	301391	卡莱特	3,200	140,096.00	0.08
391	002927	泰永长征	11,400	136,116.00	0.07
392	000919	金陵药业	21,300	133,338.00	0.07
393	603309	维力医疗	12,100	133,221.00	0.07
394	001282	三联锻造	4,800	133,008.00	0.07
395	300892	品渥食品	9,700	132,308.00	0.07
396	002538	司尔特	29,100	130,368.00	0.07
397	300879	大叶股份	9,700	129,786.00	0.07
398	002014	永新股份	13,500	127,980.00	0.07
399	300185	通裕重工	73,700	126,764.00	0.07
400	002298	中电兴发	28,600	126,412.00	0.07
401	300387	富邦股份	20,900	125,191.00	0.07
402	300291	百纳千成	29,300	124,818.00	0.07
403	300703	创源股份	15,400	124,432.00	0.07
404	002515	金字火腿	32,800	124,312.00	0.07
405	002208	合肥城建	28,600	123,266.00	0.07
406	688036	传音控股	1,600	122,464.00	0.07
407	600055	万东医疗	9,900	122,265.00	0.07
408	300310	宜通世纪	32,700	121,971.00	0.07
409	002519	银河电子	24,800	121,768.00	0.07
410	600513	联环药业	15,000	121,650.00	0.07
411	002218	拓日新能	42,600	121,410.00	0.07

412	300048	合康新能	26,200	121,306.00	0.07
413	601877	正泰电器	6,300	120,078.00	0.07
414	600248	陕建股份	32,900	119,427.00	0.07
415	002301	齐心集团	24,700	119,301.00	0.07
416	603135	中重科技	9,500	119,035.00	0.06
417	300615	欣天科技	12,400	118,668.00	0.06
418	000608	阳光股份	83,400	118,428.00	0.06
419	002795	永和智控	31,500	117,180.00	0.06
420	300997	欢乐家	9,900	117,018.00	0.06
421	002478	常宝股份	23,000	114,540.00	0.06
422	600188	兖矿能源	5,000	113,650.00	0.06
423	301257	普蕊斯	4,000	113,000.00	0.06
424	603373	安邦护卫	4,100	112,709.00	0.06
425	605228	神通科技	13,100	112,398.00	0.06
426	603032	德新科技	9,800	112,014.00	0.06
427	600125	铁龙物流	18,700	111,639.00	0.06
428	002148	北纬科技	23,700	110,205.00	0.06
429	688330	宏力达	5,400	110,106.00	0.06
430	002576	通达动力	9,700	110,095.00	0.06
431	603196	日播时尚	15,400	108,724.00	0.06
432	600622	光大嘉宝	58,700	108,595.00	0.06
433	600218	全柴动力	16,100	108,031.00	0.06
434	605369	拱东医疗	2,700	107,730.00	0.06
435	002462	嘉事堂	9,700	106,118.00	0.06
436	600829	人民同泰	18,800	105,468.00	0.06
437	003029	吉大正元	5,800	103,182.00	0.06
438	600354	敦煌种业	21,500	102,555.00	0.06
439	300584	海辰药业	6,700	102,041.00	0.06
440	000761	本钢板材	40,100	100,651.00	0.05
441	002584	西陇科学	17,700	99,474.00	0.05
442	605018	长华集团	10,600	96,036.00	0.05
443	002791	坚朗五金	3,700	95,719.00	0.05
444	601068	中铝国际	22,100	93,041.00	0.05
445	688095	福昕软件	2,000	91,620.00	0.05
446	603187	海容冷链	7,800	90,948.00	0.05
447	600756	浪潮软件	9,000	90,900.00	0.05
448	003039	顺控发展	7,200	90,216.00	0.05
449	688092	爱科科技	4,200	89,670.00	0.05
450	001380	华纬科技	4,600	89,424.00	0.05
451	000570	苏常柴 A	20,000	89,400.00	0.05
452	605368	蓝天燃气	6,400	87,296.00	0.05
453	002787	华源控股	12,900	87,204.00	0.05
454	301278	快可电子	2,600	84,552.00	0.05

455	300426	唐德影视	12,200	82,716.00	0.05
456	600195	中牧股份	11,000	82,390.00	0.04
457	600114	东睦股份	5,700	82,023.00	0.04
458	000663	永安林业	19,300	80,867.00	0.04
459	600748	上实发展	33,100	80,764.00	0.04
460	002250	联化科技	16,100	77,280.00	0.04
461	002297	博云新材	12,500	75,000.00	0.04
462	688556	高测股份	6,200	73,718.00	0.04
463	600062	华润双鹤	3,700	72,446.00	0.04
464	002972	科安达	7,900	72,364.00	0.04
465	600467	好当家	50,500	71,710.00	0.04
466	300192	科德教育	7,300	71,686.00	0.04
467	002182	宝武镁业	6,200	69,936.00	0.04
468	605158	华达新材	10,800	69,444.00	0.04
469	002860	星帅尔	8,400	68,796.00	0.04
470	300111	向日葵	36,100	67,507.00	0.04
471	300441	鲍斯股份	11,200	66,416.00	0.04
472	002644	佛慈制药	10,300	66,126.00	0.04
473	300853	申昊科技	4,400	63,976.00	0.03
474	000626	远大控股	15,200	63,080.00	0.03
475	605133	嵘泰股份	3,400	62,322.00	0.03
476	002865	钧达股份	1,600	61,408.00	0.03
477	002337	赛象科技	16,000	60,800.00	0.03
478	000042	中洲控股	15,300	60,435.00	0.03
479	000810	创维数字	6,900	59,202.00	0.03
480	002551	尚荣医疗	25,000	58,250.00	0.03
481	603048	浙江黎明	4,000	58,080.00	0.03
482	603630	拉芳家化	5,400	56,754.00	0.03
483	300494	盛天网络	5,600	56,280.00	0.03
484	603239	浙江仙通	4,100	56,211.00	0.03
485	600252	中恒集团	25,700	55,769.00	0.03
486	600577	精达股份	13,700	54,389.00	0.03
487	600636	国新文化	7,000	52,500.00	0.03
488	300631	久吾高科	2,700	51,705.00	0.03
489	300121	阳谷华泰	6,600	51,480.00	0.03
490	002458	益生股份	5,800	50,228.00	0.03
491	301386	未来电器	2,400	49,776.00	0.03
492	002971	和远气体	2,000	49,560.00	0.03
493	603070	万控智造	4,400	49,236.00	0.03
494	300259	新天科技	19,200	48,576.00	0.03
495	002891	中宠股份	2,300	48,001.00	0.03
496	601198	东兴证券	5,900	46,964.00	0.03
497	301239	普瑞眼科	1,300	45,929.00	0.03



498	300790	宇瞳光学	3,400	45,900.00	0.03
499	002907	华森制药	3,600	45,432.00	0.02
500	000936	华西股份	7,800	44,616.00	0.02
501	003007	直真科技	1,700	42,415.00	0.02
502	002372	伟星新材	2,700	41,634.00	0.02
503	603106	恒银科技	9,600	40,896.00	0.02
504	002454	松芝股份	7,300	40,807.00	0.02
505	603429	集友股份	9,800	40,670.00	0.02
506	002163	海南发展	7,400	40,552.00	0.02
507	600851	海欣股份	8,800	40,216.00	0.02
508	688147	微导纳米	1,600	39,840.00	0.02
509	301292	海科新源	3,100	38,347.00	0.02
510	688418	震有科技	2,200	37,686.00	0.02
511	002945	华林证券	3,700	36,926.00	0.02
512	603728	鸣志电器	900	36,207.00	0.02
513	605066	天正电气	6,475	36,065.75	0.02
514	002522	浙江众成	11,400	36,024.00	0.02
515	000505	京粮控股	6,600	35,904.00	0.02
516	000510	新金路	12,900	35,733.00	0.02
517	688226	威腾电气	2,000	34,960.00	0.02
518	603053	成都燃气	3,500	33,810.00	0.02
519	600126	杭钢股份	8,200	33,702.00	0.02
520	601177	杭齿前进	4,700	32,524.00	0.02
521	002566	益盛药业	5,300	32,436.00	0.02
522	601988	中国银行	6,700	30,954.00	0.02
523	300122	智飞生物	1,100	30,833.00	0.02
524	600794	保税科技	9,700	30,749.00	0.02
525	002084	海鸥住工	12,200	29,890.00	0.02
526	300233	金城医药	2,000	29,840.00	0.02
527	000407	胜利股份	11,400	29,754.00	0.02
528	600499	科达制造	3,400	28,662.00	0.02
529	300582	英飞特	3,100	26,536.00	0.01
530	600526	菲达环保	6,300	23,373.00	0.01
531	300660	江苏雷利	900	22,968.00	0.01
532	301370	国科恒泰	2,100	22,827.00	0.01
533	603098	森特股份	2,900	22,794.00	0.01
534	301062	上海艾录	2,200	22,462.00	0.01
535	603912	佳力图	3,700	22,200.00	0.01
536	002101	广东鸿图	2,100	22,113.00	0.01
537	002041	登海种业	2,700	21,816.00	0.01
538	001299	美能能源	1,700	20,060.00	0.01
539	001300	三柏硕	1,700	19,329.00	0.01
540	002107	沃华医药	4,700	18,471.00	0.01

541	300864	南大环境	900	17,640.00	0.01
542	600775	南京熊猫	2,200	17,600.00	0.01
543	601900	南方传媒	1,300	16,159.00	0.01
544	002705	新宝股份	1,100	15,477.00	0.01
545	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
546	300485	赛升药业	2,200	13,508.00	0.01
547	603633	徕木股份	1,700	13,447.00	0.01
548	603011	合锻智能	2,200	13,046.00	0.01
549	300513	恒实科技	1,600	13,040.00	0.01
550	002284	亚太股份	1,900	12,844.00	0.01
551	600609	金杯汽车	3,700	12,839.00	0.01
552	002419	天虹股份	2,900	12,122.00	0.01
553	603180	金牌厨柜	600	11,466.00	0.01
554	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.01
555	002438	江苏神通	900	9,729.00	0.01
556	300160	秀强股份	2,000	9,360.00	0.01
557	600545	卓郎智能	6,900	9,246.00	0.01
558	301565	中仑新材	485	9,205.30	0.01
559	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
560	688071	华依科技	400	8,668.00	0.00
561	301580	爱迪特	125	8,241.25	0.00
562	003015	日久光电	900	8,172.00	0.00
563	002931	锋龙股份	800	8,152.00	0.00
564	002646	天佑德酒	700	7,161.00	0.00
565	600336	澳柯玛	1,500	6,420.00	0.00
566	002043	兔宝宝	600	6,222.00	0.00
567	600380	健康元	500	5,585.00	0.00
568	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
569	002136	安纳达	600	5,436.00	0.00
570	002236	大华股份	300	4,638.00	0.00
571	300798	锦鸡股份	700	4,347.00	0.00
572	002129	TCL 中环	500	4,325.00	0.00
573	002375	亚厦股份	1,300	4,225.00	0.00
574	002334	英威腾	700	4,186.00	0.00
575	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
576	600713	南京医药	900	3,798.00	0.00
577	600570	恒生电子	200	3,532.00	0.00
578	300442	润泽科技	100	2,395.00	0.00
579	000534	万泽股份	200	1,986.00	0.00
580	300942	易瑞生物	300	1,797.00	0.00
581	301028	东亚机械	100	877.00	0.00

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002192	融捷股份	3,210,283.98	1.75
2	601058	赛轮轮胎	3,195,051.00	1.74
3	002712	思美传媒	3,092,309.00	1.69
4	002437	誉衡药业	3,080,606.00	1.68
5	002529	海源复材	3,061,298.00	1.67
6	300608	思特奇	2,940,471.00	1.60
7	000762	西藏矿业	2,624,619.00	1.43
8	605228	神通科技	2,605,828.00	1.42
9	600517	国网英大	2,602,694.00	1.42
10	002174	游族网络	2,593,173.00	1.41
11	300426	唐德影视	2,591,491.00	1.41
12	603392	万泰生物	2,539,026.88	1.39
13	300475	香农芯创	2,534,041.79	1.38
14	300556	丝路视觉	2,496,694.00	1.36
15	600050	中国联通	2,439,237.00	1.33
16	301236	软通动力	2,427,106.00	1.32
17	603918	金桥信息	2,422,663.00	1.32
18	002408	齐翔腾达	2,387,011.80	1.30
19	301013	利和兴	2,357,005.00	1.29
20	600497	驰宏锌锗	2,317,390.00	1.26

注：不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601058	赛轮轮胎	3,403,080.67	1.86
2	002192	融捷股份	3,318,846.00	1.81
3	002712	思美传媒	3,233,092.00	1.76
4	600517	国网英大	2,830,935.00	1.54
5	603392	万泰生物	2,793,559.82	1.52
6	002529	海源复材	2,764,552.00	1.51
7	000762	西藏矿业	2,637,847.64	1.44
8	002437	誉衡药业	2,628,475.00	1.43
9	300475	香农芯创	2,601,120.20	1.42
10	002408	齐翔腾达	2,595,821.00	1.42
11	301236	软通动力	2,537,029.55	1.38
12	605228	神通科技	2,453,847.00	1.34

13	600050	中国联通	2,432,581.00	1.33
14	600497	驰宏锌锗	2,420,846.00	1.32
15	002131	利欧股份	2,335,707.44	1.27
16	600019	宝钢股份	2,335,517.00	1.27
17	300926	博俊科技	2,332,999.23	1.27
18	300556	丝路视觉	2,331,279.00	1.27
19	300608	思特奇	2,292,413.80	1.25
20	600398	海澜之家	2,268,228.00	1.24

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	1,615,454,856.44
卖出股票收入（成交）总额	1,417,816,474.44

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，威海广泰（002111）在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的处罚。

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其他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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	117,488.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,488.25

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
华泰柏瑞 中证 2000 指数增强 A	1,967	54,936.20	889,456.31	0.82	107,170,043.19	99.18
华泰柏瑞 中证 2000 指数增强 C	2,244	46,801.91	3,395,687.41	3.23	101,627,805.88	96.77
合计	4,171	51,086.79	4,285,143.72	2.01	208,797,849.07	97.99

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	10.88	0.0000
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	10,010.45	0.0095
	合计	10,021.33	0.0047

### 8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2024 年 1 月 12 日) 基金份额总额	218,645,473.34	214,381,729.92
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	757,561.46	10,032,487.48
减:基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	111,343,535.30	119,390,724.11
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	108,059,499.50	105,023,493.29

## § 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, 陆桢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 (%)	
华泰证券	2	3,032,950,487.49	100.00	739,650.67	100.00	-

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、本基金新增华泰证券交易单元。

#### 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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券		回购成交总		证



		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
华泰证 券	-	-	3,406,000,00 0.00	100.00	-	-

### 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	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 21 日
5	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
6	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
7	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 13 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

## 12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日