

# 华泰柏瑞中证 1000 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：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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</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	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	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12	投资组合报告附注	56
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>57</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>58</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>58</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	60
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>60</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	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>61</b>
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强	
基金主代码	019240	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 19 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	238,187,437.49 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 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019240	019241
报告期末下属分级基金的份额总额	165,626,890.16 份	72,560,547.33 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 3、资产支持证券投资策略 4、衍生品投资策略 5、存托凭证投资策略 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略
业绩比较基准	中证 1000 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	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	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.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	深圳市深南大道 7088 号招商银

	大五道口广场 1 号 17 层	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	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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	
本期已实现收益	-29,356,700.96	-12,888,125.29	
本期利润	-31,272,824.65	-13,440,133.00	
加权平均基金份额本期利润	-0.1727	-0.1714	
本期加权平均净值利润率	-19.33%	-19.23%	
本期基金份额净值增长率	-16.61%	-16.77%	
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	-28,703,070.32	-12,762,291.54
	期末可供分配基金份额利润	-0.1733	-0.1759
	期末基金资产净值	136,923,819.84	59,798,255.79
	期末基金份额净值	0.8267	0.8241

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-17.33%	-17.59%

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

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

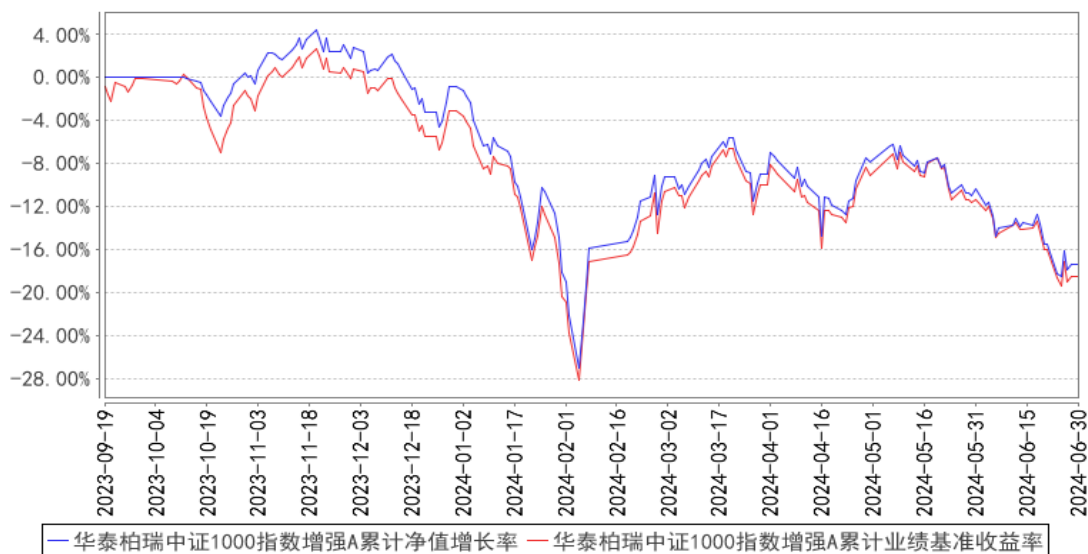
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.75%	1.44%	-8.15%	1.36%	0.40%	0.08%
过去三个月	-9.18%	1.45%	-9.51%	1.42%	0.33%	0.03%
过去六个月	-16.61%	1.88%	-15.97%	1.87%	-0.64%	0.01%
自基金合同生效起至今	-17.33%	1.57%	-18.53%	1.60%	1.20%	-0.03%

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

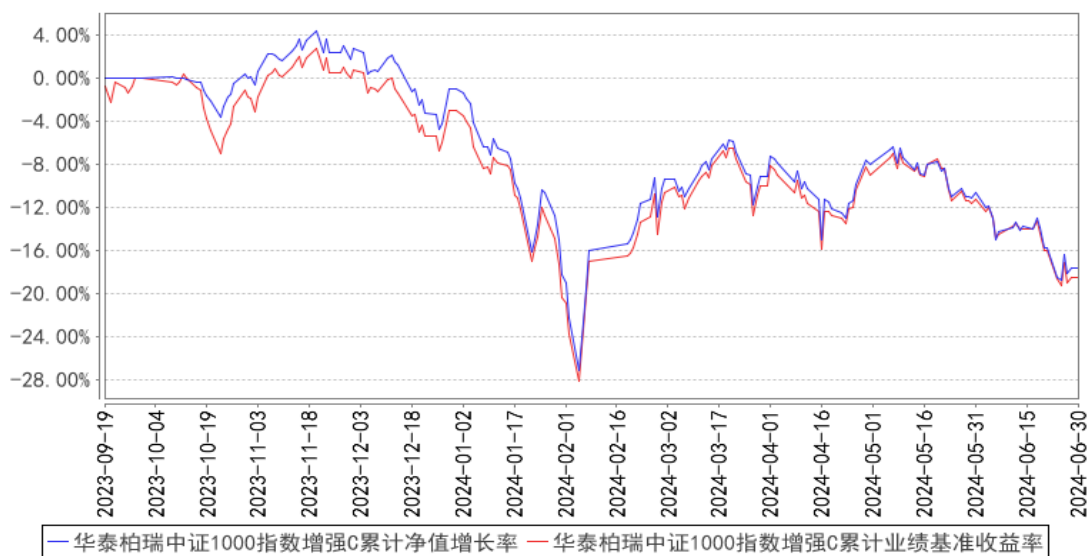
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.79%	1.44%	-8.15%	1.36%	0.36%	0.08%
过去三个月	-9.28%	1.45%	-9.51%	1.42%	0.23%	0.03%
过去六个月	-16.77%	1.88%	-15.97%	1.87%	-0.80%	0.01%
自基金合同生效起至今	-17.59%	1.57%	-18.53%	1.60%	0.94%	-0.03%

### 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

华泰柏瑞中证1000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1000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2023年9月19日至2024年06月30日。C类图示日期为2023年9月19日至2024年06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		
管箴	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 19 日	-	10 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，A 股整体呈震荡走势，风格上分化较大。春节过后，市场从前期由短期资金流造成的剧烈波动中恢复，转而更加关注公司基本面。一方面，随着美国 OpenAI 公司和苹果公司在 AI 软件和硬件上的推陈出新，AI 算力的成长性打开向上空间。同时，伴随着海外产能和基础设施建设，供应链转移等因素，上游大宗商品和设备出口迎来涨价和业绩兑现。而另一方面，大部分中下游和内需相关产业链经历了业绩预期下修的过程。上半年，A 股市场中银行、能源、公用事业等高股息相关行业表现较强，同时以人工智能创新链、消费电子复苏链为代表的“科特估”主题先后成为市场热点。

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

本报告期内，我们坚持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 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 0.8267 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.61%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 0.8241 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.77%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

#### 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出清，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

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遵规守信、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 1000 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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	16,021,978.11	15,664,360.49
结算备付金		402,501.16	71,767.95
存出保证金		699,552.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	179,882,236.41	268,494,208.10
其中：股票投资		179,882,236.41	268,494,208.10
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		63,639.90	1,194,220.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		197,069,907.58	285,424,557.25
<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>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		49,553.83	969,775.10
应付管理人报酬		134,894.85	210,483.91
应付托管费		33,723.74	52,620.99
应付销售服务费		20,262.56	32,320.89
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	109,396.97	82,210.73
负债合计		347,831.95	1,347,411.62
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	238,187,437.49	286,646,006.76
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-41,465,361.86	-2,568,861.13
净资产合计		196,722,075.63	284,077,145.63
负债和净资产总计		197,069,907.58	285,424,557.25

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 238,187,437.49 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8267 元，基金份额总额 165,626,890.16 份；下属 C 类基金份额净值 0.8241 元，基金份额

总额 72,560,547.33 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-43,333,758.79
1. 利息收入		27,295.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	27,295.83
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）		-41,047,722.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-42,693,896.65
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	79,360.36
股利收益	6.4.7.19	1,566,813.71
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	-2,468,131.40
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	154,799.36
<b>减：二、营业总支出</b>		1,379,198.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	921,068.20
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	230,267.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	138,919.18
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		1,408.40
8. 其他费用	6.4.7.23	87,536.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号</b>		-44,712,957.65

填列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,712,957.65
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-44,712,957.65

注：本基金成立于 2023 年 09 月 19 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 1000 指数增强型证券投资基金

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	286,646,006.76	-	-2,568,861.13	284,077,145.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	286,646,006.76	-	-2,568,861.13	284,077,145.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,458,569.27	-	-38,896,500.73	-87,355,070.00
（一）、综合收益总额	-	-	-44,712,957.65	-44,712,957.65
（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）	-48,458,569.27	-	5,816,456.92	-42,642,112.35
其中：1. 基金申购款	27,771,515.74	-	-2,770,168.05	25,001,347.69
2. 基金赎回款	-76,230,085.01	-	8,586,624.97	-67,643,460.04
（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	238,187,437.49	-	-41,465,361.86	196,722,075.63

注：本基金成立于 2023 年 09 月 19 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 1000 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]1780 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 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 1000 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 347,748,610.52 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 0486 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 347,898,709.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 150,099.06 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 1000 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、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 1000 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、可转换债券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：股票及存托凭证资产的投资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)的资产比例不低于非现金资产基金资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 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 1000 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 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基金净值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[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	16,021,978.11
等于：本金	16,021,010.31
加：应计利息	967.80
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	16,021,978.11

#### 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	188,685,121.42	-	179,882,236.41	-8,802,885.01
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	188,685,121.42	-	179,882,236.41	-8,802,885.01

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	6,198,440.00	-	-	
其中：股指期货投资	6,198,440.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	6,198,440.00	-	-	

### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2407	中证1000股指期货 2407	6.00	5,829,600.00	-368,840.00
合计				-368,840.00
减：可抵销期货暂收款				-368,840.00
净额				0.00

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

### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

##### 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	186.76
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	84,535.36
其他应付款	24,674.85
合计	109,396.97

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

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	201,087,977.65	201,087,977.65
本期申购	20,431,876.58	20,431,876.58
本期赎回（以“-”号填列）	-55,892,964.07	-55,892,964.07
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	165,626,890.16	165,626,890.16

##### 华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

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	85,558,029.11	85,558,029.11

本期申购	7,339,639.16	7,339,639.16
本期赎回（以“-”号填列）	-20,337,120.94	-20,337,120.94
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	72,560,547.33	72,560,547.33

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,392,096.65	-4,126,327.67	-1,734,231.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,392,096.65	-4,126,327.67	-1,734,231.02
本期利润	-29,356,700.96	-1,916,123.69	-31,272,824.65
本期基金份额交易产生的变动数	2,691,332.52	1,612,652.83	4,303,985.35
其中：基金申购款	-1,708,050.62	-227,517.57	-1,935,568.19
基金赎回款	4,399,383.14	1,840,170.40	6,239,553.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,273,271.79	-4,429,798.53	-28,703,070.32

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	919,704.32	-1,754,334.43	-834,630.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	919,704.32	-1,754,334.43	-834,630.11
本期利润	-12,888,125.29	-552,007.71	-13,440,133.00
本期基金份额交易产生的变动数	1,144,505.25	367,966.32	1,512,471.57
其中：基金申购款	-622,831.26	-211,768.60	-834,599.86
基金赎回款	1,767,336.51	579,734.92	2,347,071.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,823,915.72	-1,938,375.82	-12,762,291.54

### 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	19,267.68
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	8,028.15
其他	-
合计	27,295.83

### 6.4.7.14 股票投资收益

#### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-42,693,896.65
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	-42,693,896.65

#### 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	1,520,674,256.38
减：卖出股票成本总额	1,561,415,330.95
减：交易费用	1,952,822.08
买卖股票差价收入	-42,693,896.65

#### 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 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	79,360.36

**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	1,566,813.71
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	1,566,813.71

#### 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	-2,099,291.40
股票投资	-2,099,291.40
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	-368,840.00
权证投资	-
期货投资	-368,840.00
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,468,131.40

#### 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	153,539.65
基金转换费收入	1,259.71
合计	154,799.36

注: 1. 本基金的赎回费率按持有期间递减, 其中 A 类基金份额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。C 类基金份额的赎回费全额计入基金财产。

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 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,000.66
合计	87,536.02

### 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、基金注册登记机构、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、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

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

2、本基金成立于 2023 年 09 月 19 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 2023 年 09 月 19 日，无上年可比期间数据。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

2、本基金成立于 2023 年 09 月 19 日，无上年可比期间数据。

###### 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 2023 年 09 月 19 日，无上年可比期间数据。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

2、本基金成立于 2023 年 09 月 19 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 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	921,068.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	364,798.10
应支付基金管理人的净管理费	556,270.10

注：自 2023 年 9 月 19 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.80 % / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	230,267.06

注：自 2023 年 9 月 19 日起，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 0.20 % 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20 \% / \text{当年天数}。$$

#### 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 1 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 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	66,977.04	66,977.04
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	326.94	326.94
合计	0.00	67,303.98	67,303.98

注：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 类基金份额前一日的基金资产净值

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、本基金本报告期内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 2023 年 09 月 19 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、本基金本报告期内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 2023 年 09 月 19 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、本基金本报告期内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 2023 年 09 月 19 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 2023 年 09 月 19 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	3,257,961.17	3,552.45

注：本基金的银行存款由基金托管人招商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 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
华泰联合证券有限责任公司	688709	成都华微	网下申购	4,562	71,577.78
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
华泰联合证券有限责任公司	603341	龙旗科技	网下申购	1,296	33,696.00
华泰联合证券有限责任公司	603312	西典新能	网下申购	1,010	29310.2
华泰联合证券有限责任公司	301587	中瑞股份	网下申购	2,934	63755.82

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定期内	17.39	20.60	160	2,782.40	3,296.00	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.98	13.48	210	3,565.80	2,830.80	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期内	17.43	34.56	197	3,433.71	6,808.32	-
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	417	6,738.72	13,456.59	-
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	-
301539	宏鑫	2024年4月	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-

	科技	3 日		期内						
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股 锁定期内	11.88	18.98	498	5,916.24	9,452.04	-
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	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股 锁定期内	44.95	65.93	132	5,933.40	8,702.76	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股 锁定期内	21.73	25.26	294	6,388.62	7,426.44	-
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	-
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	383	6,204.60	6,112.68	-
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	1,029	19,190.85	19,190.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股 锁定期内	29.02	25.36	101	2,931.02	2,561.36	-
603325	博隆技	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股 锁定期内	72.46	68.06	44	3,188.24	2,994.64	-



	术									
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定期内	26.00	37.49	130	3,380.00	4,873.70	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	19.18	22.66	137	2,627.66	3,104.42	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
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	93	2,171.55	2,337.09	-
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	366	8,293.56	5,815.74	-
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	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期内	86.96	174.93	81	7,043.76	14,169.33	-
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	457	7,170.33	8,587.03	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中

基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日 期	复牌 开 盘 单 价	数量 (股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
300630	普利制药	2024 年 5 月 6 日	重大事 项停牌	12.35	-	-	15,300	219,682.00	188,955.00	-

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

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间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：同)。

#### 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	16,021,978.11	-	-	-	-	-	16,021,978.11
结算备付金	402,501.16	-	-	-	-	-	402,501.16
存出保证金	699,552.00	-	-	-	-	-	699,552.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	179,882,236.41	179,882,236.41
应收申购款	-	-	-	-	-	63,639.90	63,639.90
资产总计	17,124,031.27	-	-	-	-	179,945,876.31	197,069,907.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	49,553.83	49,553.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	134,894.85	134,894.85
应付托管费	-	-	-	-	-	33,723.74	33,723.74

应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,262.56	20,262.56
其他负债	-	-	-	-	-	109,396.97	109,396.97
负债总计	-	-	-	-	-	347,831.95	347,831.95
利率敏感度缺口	17,124,031.27	-	-	-	-	-179,598,044.36	196,722,075.63
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	15,664,360.49	-	-	-	-	-	15,664,360.49
结算备付金	71,767.95	-	-	-	-	-	71,767.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-268,494,208.10	268,494,208.10
应收申购款	-	-	-	-	-	1,194,220.71	1,194,220.71
资产总计	15,736,128.44	-	-	-	-	-269,688,428.81	285,424,557.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	969,775.10	969,775.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	210,483.91	210,483.91
应付托管费	-	-	-	-	-	52,620.99	52,620.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	32,320.89	32,320.89
其他负债	-	-	-	-	-	82,210.73	82,210.73
负债总计	-	-	-	-	-	1,347,411.62	1,347,411.62
利率敏感度缺口	15,736,128.44	-	-	-	-	-268,341,017.19	284,077,145.63

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：同)，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	179,882,236.41	91.44	268,494,208.10	94.51
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	179,882,236.41	91.44	268,494,208.10	94.51

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	中证 1000 指数上升 5%	9,182,538.82	14,892,889.70
	中证 1000 指数下降 5%	-9,182,538.82	-14,892,889.70

#### 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	179,461,023.46	267,206,553.86
第二层次	239,529.13	1,137,290.00
第三层次	181,683.82	150,364.24
合计	179,882,236.41	268,494,208.10

##### 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	179,882,236.41	91.28
	其中：股票	179,882,236.41	91.28



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	16,424,479.27	8.33
8	其他各项资产	763,191.90	0.39
9	合计	197,069,907.58	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	1,232,856.00	0.63
B	采矿业	5,412,231.21	2.75
C	制造业	120,846,619.95	61.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,526,290.00	2.81
E	建筑业	4,319,514.00	2.20
F	批发和零售业	6,328,902.00	3.22
G	交通运输、仓储和邮政业	4,961,478.00	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,437,796.60	7.85
J	金融业	5,534,541.15	2.81
K	房地产业	1,156,914.00	0.59
L	租赁和商务服务业	3,130,101.00	1.59
M	科学研究和技术服务业	1,300,748.82	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	487,242.68	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,130,714.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	3,076,287.00	1.56
S	综合	-	-
	合计	179,882,236.41	91.44

### 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	601918	新集能源	158,700	1,547,325.00	0.79
2	603556	海兴电力	33,000	1,545,390.00	0.79
3	600757	长江传媒	188,600	1,520,116.00	0.77
4	600718	东软集团	165,800	1,371,166.00	0.70
5	600971	恒源煤电	109,600	1,308,624.00	0.67
6	002174	游族网络	170,300	1,292,577.00	0.66
7	002204	大连重工	297,400	1,269,898.00	0.65
8	300049	福瑞股份	25,100	1,263,534.00	0.64
9	601038	一拖股份	79,900	1,263,219.00	0.64
10	300327	中颖电子	63,600	1,251,648.00	0.64
11	300446	航天智造	101,800	1,211,420.00	0.62
12	600252	中恒集团	536,200	1,163,554.00	0.59
13	688048	长光华芯	36,400	1,137,136.00	0.58
14	688270	臻镭科技	41,600	1,085,760.00	0.55
15	002023	海特高新	118,000	1,079,700.00	0.55
16	300693	盛弘股份	51,400	1,076,316.00	0.55
17	600055	万东医疗	87,100	1,075,685.00	0.55
18	603283	赛腾股份	14,000	1,069,600.00	0.54
19	000927	中国铁物	439,900	1,046,962.00	0.53
20	002182	宝武镁业	91,200	1,028,736.00	0.52
21	002108	沧州明珠	335,200	1,025,712.00	0.52
22	600248	陕建股份	281,200	1,020,756.00	0.52
23	000737	北方铜业	109,500	1,016,160.00	0.52
24	600874	创业环保	180,400	1,008,436.00	0.51
25	300687	赛意信息	72,400	1,007,808.00	0.51
26	002498	汉缆股份	303,700	999,173.00	0.51
27	600993	马应龙	36,200	965,454.00	0.49
28	688088	虹软科技	32,800	946,608.00	0.48
29	600929	雪天盐业	174,900	926,970.00	0.47
30	600195	中牧股份	120,600	903,294.00	0.46
31	600577	精达股份	227,100	901,587.00	0.46
32	603699	纽威股份	48,800	835,456.00	0.42
33	002139	拓邦股份	78,400	832,608.00	0.42
34	600562	国睿科技	60,900	831,894.00	0.42
35	002226	江南化工	185,000	828,800.00	0.42
36	001269	欧晶科技	29,100	808,980.00	0.41
37	600667	太极实业	141,600	808,536.00	0.41
38	603439	贵州三力	62,400	796,224.00	0.40
39	300185	通裕重工	459,300	789,996.00	0.40
40	002249	大洋电机	165,600	783,288.00	0.40

41	601608	中信重工	204,900	780,669.00	0.40
42	600888	新疆众和	110,400	780,528.00	0.40
43	300233	金城医药	52,300	780,316.00	0.40
44	300735	光弘科技	36,100	779,760.00	0.40
45	600552	凯盛科技	81,200	765,716.00	0.39
46	002745	木林森	94,100	758,446.00	0.39
47	603063	禾望电气	49,200	754,236.00	0.38
48	688559	海目星	22,800	749,892.00	0.38
49	688278	特宝生物	14,000	749,700.00	0.38
50	600185	格力地产	175,800	747,150.00	0.38
51	002761	浙江建投	95,000	741,950.00	0.38
52	000761	本钢板材	294,700	739,697.00	0.38
53	002705	新宝股份	52,400	737,268.00	0.37
54	600976	健民集团	14,500	732,250.00	0.37
55	300303	聚飞光电	150,200	729,972.00	0.37
56	603806	福斯特	49,000	720,300.00	0.37
57	688036	传音控股	9,400	719,476.00	0.37
58	300142	沃森生物	63,000	716,940.00	0.36
59	001270	铖昌科技	19,400	712,368.00	0.36
60	000058	深赛格	132,400	710,988.00	0.36
61	601369	陕鼓动力	87,900	704,958.00	0.36
62	300119	瑞普生物	51,700	704,154.00	0.36
63	603212	赛伍技术	63,500	701,040.00	0.36
64	603013	亚普股份	51,500	693,705.00	0.35
65	301239	普瑞眼科	19,600	692,468.00	0.35
66	002891	中宠股份	32,600	680,362.00	0.35
67	300409	道氏技术	78,900	675,384.00	0.34
68	003039	顺控发展	53,900	675,367.00	0.34
69	601399	国机重装	260,900	673,122.00	0.34
70	000915	华特达因	22,200	669,552.00	0.34
71	600783	鲁信创投	71,700	668,961.00	0.34
72	600169	太原重工	364,100	666,303.00	0.34
73	002267	陕天然气	87,900	664,524.00	0.34
74	000727	冠捷科技	321,300	661,878.00	0.34
75	002125	湘潭电化	68,000	661,640.00	0.34
76	603666	亿嘉和	41,400	653,292.00	0.33
77	300113	顺网科技	62,800	643,072.00	0.33
78	600787	中储股份	133,400	641,654.00	0.33
79	600125	铁龙物流	107,400	641,178.00	0.33
80	605333	沪光股份	23,000	640,550.00	0.33
81	002840	华统股份	38,600	640,374.00	0.33
82	000813	德展健康	307,600	639,808.00	0.33
83	300166	东方国信	103,800	635,256.00	0.32

84	688556	高测股份	53,258	633,237.62	0.32
85	002851	麦格米特	24,500	633,080.00	0.32
86	000061	农产品	130,200	632,772.00	0.32
87	603985	恒润股份	53,100	631,890.00	0.32
88	000597	东北制药	162,900	630,423.00	0.32
89	300660	江苏雷利	24,600	627,792.00	0.32
90	600575	淮河能源	159,200	619,288.00	0.31
91	002646	天佑德酒	60,300	616,869.00	0.31
92	300775	三角防务	20,100	615,060.00	0.31
93	600273	嘉化能源	86,100	614,754.00	0.31
94	601988	中国银行	131,900	609,378.00	0.31
95	300379	东方通	75,400	609,232.00	0.31
96	000550	江铃汽车	28,000	607,880.00	0.31
97	001236	弘业期货	84,600	601,506.00	0.31
98	002043	兔宝宝	57,000	591,090.00	0.30
99	300077	国民技术	67,600	590,148.00	0.30
100	603026	石大胜华	17,400	588,120.00	0.30
101	000600	建投能源	93,100	586,530.00	0.30
102	300039	上海凯宝	109,200	584,220.00	0.30
103	603187	海容冷链	50,100	584,166.00	0.30
104	300183	东软载波	50,300	582,474.00	0.30
105	300315	掌趣科技	139,200	580,464.00	0.30
106	002516	旷达科技	157,300	572,572.00	0.29
107	300618	寒锐钴业	21,500	568,675.00	0.29
108	000990	诚志股份	76,100	566,184.00	0.29
109	603118	共进股份	84,100	563,470.00	0.29
110	000016	深康佳 A	264,200	562,746.00	0.29
111	600633	浙数文化	63,600	560,316.00	0.28
112	600391	航发科技	36,600	558,150.00	0.28
113	688147	微导纳米	22,200	552,780.00	0.28
114	688409	富创精密	14,804	546,859.76	0.28
115	002265	建设工业	62,800	541,964.00	0.28
116	002461	珠江啤酒	72,500	537,950.00	0.27
117	002859	洁美科技	26,400	530,112.00	0.27
118	002093	国脉科技	87,000	528,090.00	0.27
119	002250	联化科技	109,500	525,600.00	0.27
120	601068	中铝国际	124,400	523,724.00	0.27
121	600206	有研新材	58,200	517,980.00	0.26
122	301262	海看股份	22,960	517,748.00	0.26
123	600775	南京熊猫	64,700	517,600.00	0.26
124	002993	奥海科技	13,900	517,080.00	0.26
125	600645	中源协和	31,700	510,370.00	0.26
126	603871	嘉友国际	28,800	509,472.00	0.26

127	600556	天下秀	138,900	505,596.00	0.26
128	002215	诺普信	67,600	503,620.00	0.26
129	002065	东华软件	110,200	498,104.00	0.25
130	600000	浦发银行	60,100	494,623.00	0.25
131	000801	四川九洲	49,400	494,000.00	0.25
132	600037	歌华有线	82,500	493,350.00	0.25
133	600566	济川药业	15,500	491,505.00	0.25
134	002967	广电计量	41,600	490,880.00	0.25
135	002484	江海股份	37,000	490,250.00	0.25
136	603298	杭叉集团	24,900	489,036.00	0.25
137	600459	贵研铂业	36,100	487,711.00	0.25
138	002276	万马股份	67,200	481,824.00	0.24
139	000810	创维数字	55,700	477,906.00	0.24
140	300741	华宝股份	31,200	475,488.00	0.24
141	002292	奥飞娱乐	79,400	474,812.00	0.24
142	600282	南钢股份	95,200	474,096.00	0.24
143	600563	法拉电子	6,200	472,316.00	0.24
144	300415	伊之密	22,700	471,706.00	0.24
145	000818	航锦科技	21,300	470,304.00	0.24
146	000030	富奥股份	95,300	467,923.00	0.24
147	002697	红旗连锁	100,900	467,167.00	0.24
148	000883	湖北能源	75,900	456,159.00	0.23
149	688617	惠泰医疗	1,000	456,100.00	0.23
150	002635	安洁科技	29,300	452,392.00	0.23
151	002945	华林证券	45,300	452,094.00	0.23
152	300122	智飞生物	16,100	451,283.00	0.23
153	601717	郑煤机	30,400	449,920.00	0.23
154	300428	立中集团	24,200	449,878.00	0.23
155	002567	唐人神	83,400	447,024.00	0.23
156	600335	国机汽车	76,400	440,828.00	0.22
157	300034	钢研高纳	27,700	440,153.00	0.22
158	002402	和而泰	41,000	439,110.00	0.22
159	601163	三角轮胎	28,800	438,336.00	0.22
160	300143	盈康生命	58,200	438,246.00	0.22
161	002458	益生股份	50,600	438,196.00	0.22
162	000598	兴蓉环境	57,400	431,648.00	0.22
163	601598	中国外运	76,400	430,132.00	0.22
164	002768	国恩股份	22,900	428,230.00	0.22
165	301381	赛维时代	18,800	427,324.00	0.22
166	688510	航亚科技	23,200	427,112.00	0.22
167	002706	良信股份	62,000	425,320.00	0.22
168	600461	洪城环境	36,700	424,986.00	0.22
169	002091	江苏国泰	61,800	420,858.00	0.21

170	301071	力量钻石	15,100	418,421.00	0.21
171	002153	石基信息	72,600	415,998.00	0.21
172	002056	横店东磁	33,300	415,251.00	0.21
173	002362	汉王科技	24,800	412,920.00	0.21
174	002101	广东鸿图	39,200	412,776.00	0.21
175	300450	先导智能	24,700	410,761.00	0.21
176	000557	西部创业	108,900	409,464.00	0.21
177	600557	康缘药业	25,900	406,630.00	0.21
178	603567	珍宝岛	38,500	405,405.00	0.21
179	600188	兖矿能源	17,700	402,321.00	0.20
180	000065	北方国际	38,700	401,319.00	0.20
181	002867	周大生	30,700	400,942.00	0.20
182	300382	斯莱克	66,800	394,788.00	0.20
183	600869	远东股份	112,900	394,021.00	0.20
184	300445	康斯特	24,400	392,840.00	0.20
185	002838	道恩股份	43,300	392,298.00	0.20
186	002236	大华股份	25,300	391,138.00	0.20
187	603319	湘油泵	24,300	388,557.00	0.20
188	002378	章源钨业	67,500	387,450.00	0.20
189	002041	登海种业	47,700	385,416.00	0.20
190	601198	东兴证券	48,300	384,468.00	0.20
191	600643	爱建集团	101,600	383,032.00	0.19
192	300821	东岳硅材	55,300	378,252.00	0.19
193	600050	中国联通	80,400	377,880.00	0.19
194	688372	伟测科技	9,600	377,568.00	0.19
195	000567	海德股份	67,015	375,954.15	0.19
196	300134	大富科技	54,900	374,418.00	0.19
197	002318	久立特材	16,000	373,280.00	0.19
198	002245	蔚蓝锂芯	48,100	372,775.00	0.19
199	600872	中炬高新	16,400	372,116.00	0.19
200	600551	时代出版	52,500	371,700.00	0.19
201	603881	数据港	29,200	371,132.00	0.19
202	300857	协创数据	6,500	370,500.00	0.19
203	600961	株冶集团	39,200	370,048.00	0.19
204	002349	精华制药	56,200	368,672.00	0.19
205	601718	际华集团	148,600	368,528.00	0.19
206	300850	新强联	24,200	363,484.00	0.18
207	605365	立达信	22,900	363,423.00	0.18
208	601326	秦港股份	114,600	363,282.00	0.18
209	000581	威孚高科	22,300	363,044.00	0.18
210	603093	南华期货	41,900	362,854.00	0.18
211	001914	招商积余	36,200	362,724.00	0.18
212	603678	火炬电子	14,600	360,474.00	0.18

213	002866	传艺科技	28,000	360,360.00	0.18
214	600098	广州发展	56,300	360,320.00	0.18
215	600006	东风汽车	56,300	359,757.00	0.18
216	002960	青鸟消防	28,400	358,976.00	0.18
217	002038	双鹭药业	48,500	357,445.00	0.18
218	603297	永新光学	5,900	356,891.00	0.18
219	603322	超讯通信	13,300	352,583.00	0.18
220	002020	京新药业	33,500	350,745.00	0.18
221	603098	森特股份	44,500	349,770.00	0.18
222	600651	飞乐音响	125,900	347,484.00	0.18
223	002296	辉煌科技	33,700	347,447.00	0.18
224	002191	劲嘉股份	96,200	347,282.00	0.18
225	300224	正海磁材	37,400	346,324.00	0.18
226	600710	苏美达	42,400	345,560.00	0.18
227	300170	汉得信息	56,100	344,454.00	0.18
228	002237	恒邦股份	29,900	344,149.00	0.17
229	000762	西藏矿业	19,000	343,520.00	0.17
230	688798	艾为电子	6,000	339,720.00	0.17
231	300158	振东制药	87,800	335,396.00	0.17
232	300755	华致酒行	24,500	334,670.00	0.17
233	600546	山煤国际	22,700	331,874.00	0.17
234	603733	仙鹤股份	18,800	330,504.00	0.17
235	002111	威海广泰	31,500	328,230.00	0.17
236	600580	卧龙电驱	26,900	326,835.00	0.17
237	002127	南极电商	125,200	325,520.00	0.17
238	300296	利亚德	71,600	322,200.00	0.16
239	300747	锐科激光	18,100	321,275.00	0.16
240	000821	京山轻机	28,300	320,639.00	0.16
241	301316	慧博云通	21,600	317,088.00	0.16
242	002416	爱施德	35,800	316,830.00	0.16
243	000788	北大医药	63,400	316,366.00	0.16
244	600449	宁夏建材	26,700	313,725.00	0.16
245	688066	航天宏图	17,600	313,280.00	0.16
246	600602	云赛智联	28,300	312,432.00	0.16
247	603508	思维列控	16,600	311,250.00	0.16
248	688128	中国电研	18,000	309,780.00	0.16
249	002534	西子洁能	30,900	309,309.00	0.16
250	002961	瑞达期货	27,700	303,315.00	0.15
251	002662	京威股份	99,700	303,088.00	0.15
252	002154	报喜鸟	55,700	303,008.00	0.15
253	002643	万润股份	30,300	303,000.00	0.15
254	600348	华阳股份	30,400	302,784.00	0.15
255	000088	盐田港	66,500	301,245.00	0.15

256	000837	秦川机床	40,900	301,024.00	0.15
257	600361	创新新材	74,500	300,235.00	0.15
258	600612	老凤祥	5,100	296,769.00	0.15
259	300105	龙源技术	45,900	296,514.00	0.15
260	300566	激智科技	20,400	285,396.00	0.15
261	601801	皖新传媒	41,100	284,823.00	0.14
262	300123	亚光科技	61,000	283,040.00	0.14
263	301205	联特科技	4,500	282,375.00	0.14
264	001213	中铁特货	71,000	280,450.00	0.14
265	600478	科力远	73,200	275,964.00	0.14
266	603939	益丰药房	11,200	274,960.00	0.14
267	300709	精研科技	10,800	273,024.00	0.14
268	688333	铂力特	5,600	271,320.00	0.14
269	600058	五矿发展	40,800	269,280.00	0.14
270	601128	常熟银行	35,100	265,707.00	0.14
271	002777	久远银海	17,600	263,824.00	0.13
272	002612	朗姿股份	18,900	261,198.00	0.13
273	600776	东方通信	26,300	258,529.00	0.13
274	601877	正泰电器	13,500	257,310.00	0.13
275	000966	长源电力	58,300	257,103.00	0.13
276	600120	浙江东方	76,700	256,178.00	0.13
277	600380	健康元	22,400	250,208.00	0.13
278	000758	中色股份	49,200	249,936.00	0.13
279	600598	北大荒	20,000	249,800.00	0.13
280	002163	海南发展	45,400	248,792.00	0.13
281	002467	二六三	74,300	248,162.00	0.13
282	002563	森马服饰	42,500	246,925.00	0.13
283	002896	中大力德	8,800	245,520.00	0.12
284	600197	伊力特	13,700	243,997.00	0.12
285	603626	科森科技	43,700	242,972.00	0.12
286	000848	承德露露	30,800	242,088.00	0.12
287	300596	利安隆	8,800	238,744.00	0.12
288	605009	豪悦护理	6,000	236,640.00	0.12
289	600126	杭钢股份	57,300	235,503.00	0.12
290	688007	光峰科技	14,600	235,060.00	0.12
291	300226	上海钢联	13,800	233,772.00	0.12
292	688352	颀中科技	20,200	230,482.00	0.12
293	002068	黑猫股份	32,400	230,040.00	0.12
294	600480	凌云股份	23,400	230,022.00	0.12
295	000828	东莞控股	25,400	228,854.00	0.12
296	600570	恒生电子	12,900	227,814.00	0.12
297	002287	奇正藏药	11,600	227,128.00	0.12
298	605599	菜百股份	17,700	225,321.00	0.11



299	601609	金田股份	39,500	223,570.00	0.11
300	300153	科泰电源	37,500	223,125.00	0.11
301	601969	海南矿业	34,900	221,266.00	0.11
302	600582	天地科技	32,100	221,169.00	0.11
303	601975	招商南油	60,900	218,631.00	0.11
304	603719	良品铺子	18,700	218,229.00	0.11
305	002274	华昌化工	29,400	218,148.00	0.11
306	688091	上海谊众	9,600	216,864.00	0.11
307	601200	上海环境	25,400	215,900.00	0.11
308	603866	桃李面包	42,500	215,475.00	0.11
309	000555	神州信息	23,100	215,292.00	0.11
310	002011	盾安环境	21,700	213,311.00	0.11
311	002897	意华股份	5,600	210,896.00	0.11
312	688046	药康生物	20,631	210,848.82	0.11
313	000795	英洛华	38,000	210,520.00	0.11
314	600535	天士力	16,600	208,828.00	0.11
315	000969	安泰科技	25,900	205,387.00	0.10
316	600420	国药现代	19,100	203,988.00	0.10
317	002396	星网锐捷	15,400	203,434.00	0.10
318	000685	中山公用	27,700	199,717.00	0.10
319	000681	视觉中国	17,300	198,950.00	0.10
320	002837	英维克	9,300	198,927.00	0.10
321	600502	安徽建工	45,700	196,510.00	0.10
322	600075	新疆天业	56,800	195,960.00	0.10
323	301060	兰卫医学	23,900	194,068.00	0.10
324	300630	普利制药	15,300	188,955.00	0.10
325	600835	上海机电	16,400	188,764.00	0.10
326	601999	出版传媒	36,100	188,442.00	0.10
327	601333	广深铁路	58,100	188,244.00	0.10
328	300271	华宇软件	40,100	187,668.00	0.10
329	301171	易点天下	12,700	186,690.00	0.09
330	002456	欧菲光	23,500	183,535.00	0.09
331	301216	万凯新材	16,400	183,516.00	0.09
332	000425	徐工机械	25,300	180,895.00	0.09
333	600477	杭萧钢构	77,600	180,808.00	0.09
334	600475	华光环能	20,700	180,297.00	0.09
335	601595	上海电影	9,100	179,998.00	0.09
336	002537	海联金汇	34,200	176,814.00	0.09
337	002126	银轮股份	10,100	175,841.00	0.09
338	002737	葵花药业	7,500	175,350.00	0.09
339	600880	博瑞传播	46,100	173,336.00	0.09
340	600062	华润双鹤	8,800	172,304.00	0.09
341	002985	北摩高科	7,700	169,631.00	0.09

342	600072	中船科技	12,200	164,944.00	0.08
343	601398	工商银行	28,800	164,160.00	0.08
344	603345	安井食品	2,200	163,482.00	0.08
345	002315	焦点科技	6,000	161,760.00	0.08
346	300443	金雷股份	10,500	160,965.00	0.08
347	002911	佛燃能源	17,600	160,864.00	0.08
348	002060	广东建工	47,000	160,740.00	0.08
349	300087	荃银高科	25,800	159,444.00	0.08
350	600295	鄂尔多斯	16,000	158,720.00	0.08
351	603367	辰欣药业	11,300	157,522.00	0.08
352	002053	云南能投	12,600	152,334.00	0.08
353	002190	成飞集成	10,500	148,260.00	0.08
354	603993	洛阳钼业	17,400	147,900.00	0.08
355	000025	特力A	11,000	147,840.00	0.08
355	002617	露笑科技	30,800	147,840.00	0.08
356	601958	金钼股份	13,700	142,617.00	0.07
357	300571	平治信息	6,800	142,392.00	0.07
358	002581	未名医药	14,500	139,925.00	0.07
359	600662	外服控股	34,700	139,147.00	0.07
360	603558	健盛集团	13,900	138,305.00	0.07
361	603313	梦百合	18,500	138,195.00	0.07
362	601012	隆基绿能	9,800	137,396.00	0.07
363	300570	太辰光	4,100	133,906.00	0.07
364	002158	汉钟精机	8,000	133,760.00	0.07
365	603096	新经典	7,900	133,510.00	0.07
366	300475	香农芯创	4,500	133,065.00	0.07
367	605218	伟时电子	8,200	132,430.00	0.07
368	600956	新天绿能	15,900	129,903.00	0.07
369	600507	方大特钢	34,700	129,778.00	0.07
370	600059	古越龙山	16,100	127,834.00	0.06
371	300323	华灿光电	28,200	122,670.00	0.06
372	603083	剑桥科技	3,800	122,664.00	0.06
373	000559	万向钱潮	27,500	122,650.00	0.06
374	300416	苏试试验	9,400	120,884.00	0.06
375	003021	兆威机电	2,600	119,990.00	0.06
376	600707	彩虹股份	17,600	119,856.00	0.06
377	605056	咸亨国际	11,000	118,580.00	0.06
378	301376	致欧科技	5,600	118,552.00	0.06
379	601890	亚星锚链	16,800	118,440.00	0.06
380	001212	中旗新材	5,800	117,740.00	0.06
381	300452	山河药辅	10,200	115,872.00	0.06
382	603997	继峰股份	11,300	115,599.00	0.06
383	603505	金石资源	4,100	114,513.00	0.06

384	600850	电科数字	6,200	112,220.00	0.06
385	600711	盛屯矿业	30,500	111,935.00	0.06
386	002681	奋达科技	30,100	109,865.00	0.06
387	000935	四川双马	9,100	109,291.00	0.06
388	603661	恒林股份	2,540	107,213.40	0.05
389	002073	软控股份	14,200	104,938.00	0.05
390	600409	三友化工	20,800	104,416.00	0.05
391	002941	新疆交建	10,400	103,792.00	0.05
392	000913	钱江摩托	6,500	102,440.00	0.05
393	688179	阿拉丁	10,400	100,568.00	0.05
394	601101	昊华能源	10,859	99,794.21	0.05
395	300620	光库科技	2,700	99,306.00	0.05
396	002151	北斗星通	4,100	99,138.00	0.05
397	600986	浙文互联	23,600	99,120.00	0.05
398	301078	孩子王	19,100	96,646.00	0.05
399	300184	力源信息	20,400	94,452.00	0.05
400	300349	金卡智能	7,900	94,168.00	0.05
401	600210	紫江企业	17,600	93,632.00	0.05
402	603530	神马电力	3,500	92,715.00	0.05
403	002653	海思科	3,000	92,100.00	0.05
404	002392	北京利尔	28,900	91,035.00	0.05
405	000923	河钢资源	5,100	87,822.00	0.04
406	601696	中银证券	9,600	87,168.00	0.04
407	605005	合兴股份	5,400	86,184.00	0.04
408	301246	宏源药业	6,200	83,452.00	0.04
409	688383	新益昌	1,600	83,376.00	0.04
410	601900	南方传媒	6,700	83,281.00	0.04
411	000719	中原传媒	8,200	82,902.00	0.04
412	603258	电魂网络	5,000	80,750.00	0.04
413	002088	鲁阳节能	6,500	78,585.00	0.04
414	300978	东箭科技	8,500	78,455.00	0.04
415	002488	金固股份	17,800	78,142.00	0.04
416	601500	通用股份	14,600	77,964.00	0.04
417	600428	中远海特	12,500	76,500.00	0.04
418	600262	北方股份	4,600	75,578.00	0.04
419	600313	农发种业	13,500	75,465.00	0.04
420	002036	联创电子	11,000	74,250.00	0.04
421	600812	华北制药	17,900	73,748.00	0.04
422	300035	中科电气	8,300	70,633.00	0.04
423	300054	鼎龙股份	3,100	70,308.00	0.04
424	600635	大众公用	26,100	69,948.00	0.04
425	600903	贵州燃气	11,200	69,888.00	0.04
426	688235	百济神州	600	69,504.00	0.04

427	600720	中交设计	7,700	68,530.00	0.03
428	000157	中联重科	8,600	66,048.00	0.03
429	603169	兰石重装	14,100	63,450.00	0.03
430	002222	福晶科技	2,750	61,957.50	0.03
431	601860	紫金银行	23,900	59,750.00	0.03
432	301117	佳缘科技	2,300	59,340.00	0.03
433	600797	浙大网新	12,700	58,801.00	0.03
434	603999	读者传媒	12,300	58,179.00	0.03
435	603327	福蓉科技	4,500	58,005.00	0.03
436	603299	苏盐井神	5,900	56,050.00	0.03
437	002518	科士达	3,100	54,870.00	0.03
438	300257	开山股份	5,400	54,540.00	0.03
439	603636	南威软件	6,900	53,130.00	0.03
440	603128	华贸物流	9,200	53,084.00	0.03
441	300608	思特奇	5,900	52,982.00	0.03
442	600864	哈投股份	10,800	51,300.00	0.03
443	300869	康泰医学	3,900	50,973.00	0.03
444	300406	九强生物	3,200	49,216.00	0.03
445	600559	老白干酒	2,600	47,268.00	0.02
446	688348	昱能科技	800	47,200.00	0.02
447	000718	苏宁环球	28,000	47,040.00	0.02
448	600400	红豆股份	21,200	46,004.00	0.02
449	300442	润泽科技	1,900	45,505.00	0.02
450	601908	京运通	17,300	43,769.00	0.02
451	301015	百洋医药	1,800	42,354.00	0.02
452	301291	明阳电气	1,400	42,070.00	0.02
453	301075	多瑞医药	2,600	41,340.00	0.02
454	603300	华铁应急	7,000	38,220.00	0.02
455	301175	中科环保	8,600	37,754.00	0.02
456	002549	凯美特气	6,900	35,259.00	0.02
457	600389	江山股份	2,400	33,864.00	0.02
458	600741	华域汽车	2,000	32,760.00	0.02
459	002421	达实智能	13,300	30,989.00	0.02
460	605376	博迁新材	1,300	29,341.00	0.01
461	603918	金桥信息	2,800	29,260.00	0.01
462	001308	康冠科技	1,300	29,250.00	0.01
463	002317	众生药业	2,500	28,575.00	0.01
464	600623	华谊集团	4,400	25,432.00	0.01
465	000878	云南铜业	2,000	24,920.00	0.01
466	002988	豪美新材	1,500	23,025.00	0.01
467	002079	苏州固锔	2,700	23,004.00	0.01
468	601991	大唐发电	7,600	22,876.00	0.01
469	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01

470	001287	中电港	1,200	19,836.00	0.01
471	603285	键邦股份	1,029	19,190.85	0.01
472	300130	新国都	1,100	18,304.00	0.01
473	300109	新开源	1,500	17,370.00	0.01
474	002283	天润工业	3,700	15,873.00	0.01
475	603889	新澳股份	1,900	14,706.00	0.01
476	688692	达梦数据	81	14,169.33	0.01
477	000049	德赛电池	600	14,070.00	0.01
478	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
479	300648	星云股份	800	13,584.00	0.01
480	301536	星辰科技	417	13,456.59	0.01
481	601519	大智慧	2,300	12,788.00	0.01
482	600916	中国黄金	1,300	12,506.00	0.01
483	603199	九华旅游	400	11,920.00	0.01
484	688289	圣湘生物	600	10,548.00	0.01
485	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.01
486	300322	硕贝德	1,200	10,056.00	0.01
487	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
488	301565	中仑新材	498	9,452.04	0.00
489	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
490	301580	爱迪特	132	8,702.76	0.00
491	688709	成都华微	457	8,587.03	0.00
492	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
493	000791	甘肃能源	1,300	8,021.00	0.00
494	301587	中瑞股份	294	7,426.44	0.00
495	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
496	600572	康恩贝	1,600	7,152.00	0.00
497	001389	广合科技	197	6,808.32	0.00
498	600959	江苏有线	2,500	6,600.00	0.00
499	601033	永兴股份	383	6,112.68	0.00
500	300079	数码视讯	1,500	6,090.00	0.00
501	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
502	688584	上海合晶	366	5,815.74	0.00
503	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
504	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
505	000725	京东方 A	1,300	5,317.00	0.00
506	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
507	301301	川宁生物	400	5,112.00	0.00
508	603341	龙旗科技	130	4,873.70	0.00
509	002955	鸿合科技	200	4,676.00	0.00
510	300304	云意电气	600	3,906.00	0.00
511	001359	平安电工	160	3,296.00	0.00
512	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00

513	603344	星德胜	137	3,104.42	0.00
514	603325	博隆技术	44	2,994.64	0.00
515	001379	腾达科技	210	2,830.80	0.00
516	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
517	300058	蓝色光标	500	2,720.00	0.00
518	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
519	603312	西典新能	101	2,561.36	0.00
520	603381	永臻股份	93	2,337.09	0.00
521	601279	英利汽车	500	1,865.00	0.00
522	603025	大豪科技	100	1,382.00	0.00
523	600926	杭州银行	100	1,305.00	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	002174	游族网络	7,542,402.00	2.66
2	300475	香农芯创	6,778,689.00	2.39
3	000762	西藏矿业	5,086,216.65	1.79
4	000032	深桑达 A	4,752,020.38	1.67
5	601918	新集能源	4,202,245.00	1.48
6	000552	甘肃能化	3,902,903.00	1.37
7	002777	久远银海	3,895,918.00	1.37
8	688568	中科星图	3,890,017.55	1.37
9	300693	盛弘股份	3,828,299.00	1.35
10	300456	赛微电子	3,779,696.00	1.33
11	002292	奥飞娱乐	3,777,515.00	1.33
12	603392	万泰生物	3,775,672.14	1.33
13	688167	炬光科技	3,743,593.21	1.32
14	688278	特宝生物	3,660,259.57	1.29
15	688408	中信博	3,653,281.40	1.29
16	002456	欧菲光	3,558,523.00	1.25
17	688158	优刻得	3,521,961.39	1.24
18	300134	大富科技	3,514,330.70	1.24
19	688322	奥比中光	3,438,516.91	1.21
20	301236	软通动力	3,435,140.00	1.21

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	300475	香农芯创	6,764,561.53	2.38

2	002174	游族网络	6,065,068.00	2.14
3	300065	海兰信	5,263,334.00	1.85
4	002456	欧菲光	5,183,574.00	1.82
5	000032	深桑达 A	4,763,143.00	1.68
6	000762	西藏矿业	4,632,873.00	1.63
7	300613	富瀚微	4,548,142.08	1.60
8	300002	神州泰岳	4,522,414.00	1.59
9	300762	上海瀚讯	4,306,438.00	1.52
10	688568	中科星图	4,175,526.37	1.47
11	688110	东芯股份	4,117,647.75	1.45
12	000552	甘肃能化	4,022,192.00	1.42
13	603392	万泰生物	3,991,916.00	1.41
14	000543	皖能电力	3,967,140.50	1.40
15	000829	天音控股	3,904,771.00	1.37
16	688167	炬光科技	3,832,546.10	1.35
17	002276	万马股份	3,786,871.00	1.33
18	002060	广东建工	3,786,719.00	1.33
19	688408	中信博	3,766,293.53	1.33
20	300456	赛微电子	3,673,789.24	1.29

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	1,474,902,650.66
卖出股票收入（成交）总额	1,520,674,256.38

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	699,552.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	63,639.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	763,191.90

#### 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 (%)
华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	1,410	117,465.88	6,319,286.74	3.82	159,307,603.42	96.18
华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	918	79,041.99	700,025.00	0.96	71,860,522.33	99.04
合计	2,300	103,559.76	7,019,311.74	2.95	231,168,125.75	97.05

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 1000 指数增强 A	0.00	0.0000
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	1,253,010.37	1.7268
	合计	1,253,010.37	0.5261

### 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 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 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 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 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 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 19 日) 基金份额总额	237,197,469.05	110,701,240.53
本报告期期初基金份额总额	201,087,977.65	85,558,029.11
本报告期基金总申购份额	20,431,876.58	7,339,639.16
减：本报告期基金总赎回份额	55,892,964.07	20,337,120.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	165,626,890.16	72,560,547.33

### § 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 (%)	
中金财富证券	3	2,994,324,190.17	100.00	1,000,354.98	100.00	-

注：本报告期内：

1、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要，并能为基金提供全面的信息服务。

5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

3、本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	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 (%)
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

### 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	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
10	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

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

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