

华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资  
基金  
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 22 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 01 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	286,646,006.76 份
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。
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

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	201,087,977.65 份	85,558,029.11 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 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
1. 本期已实现收益	3,449,183.24	1,639,715.75
2. 本期利润	-1,152,075.53	-515,776.91
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0050	-0.0049
4. 期末基金资产净值	199,353,746.63	84,723,399.00
5. 期末基金份额净值	0.9914	0.9902

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。

#### 3.2 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	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.89%	0.85%	-2.98%	0.98%	2.09%	-0.13%
自基金合同 生效起至今	-0.86%	0.79%	-3.05%	0.97%	2.19%	-0.18%

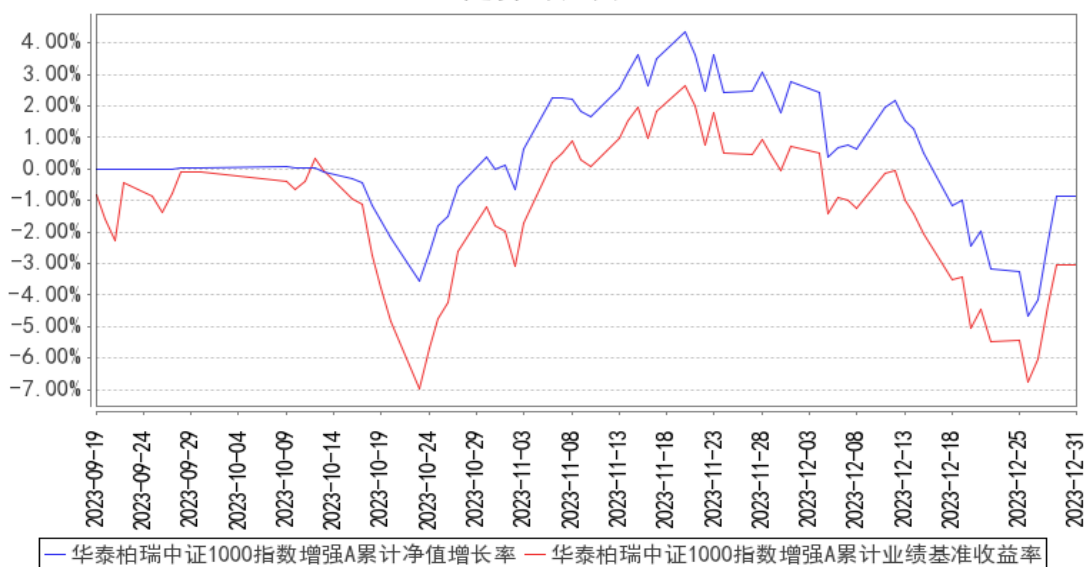
华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

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

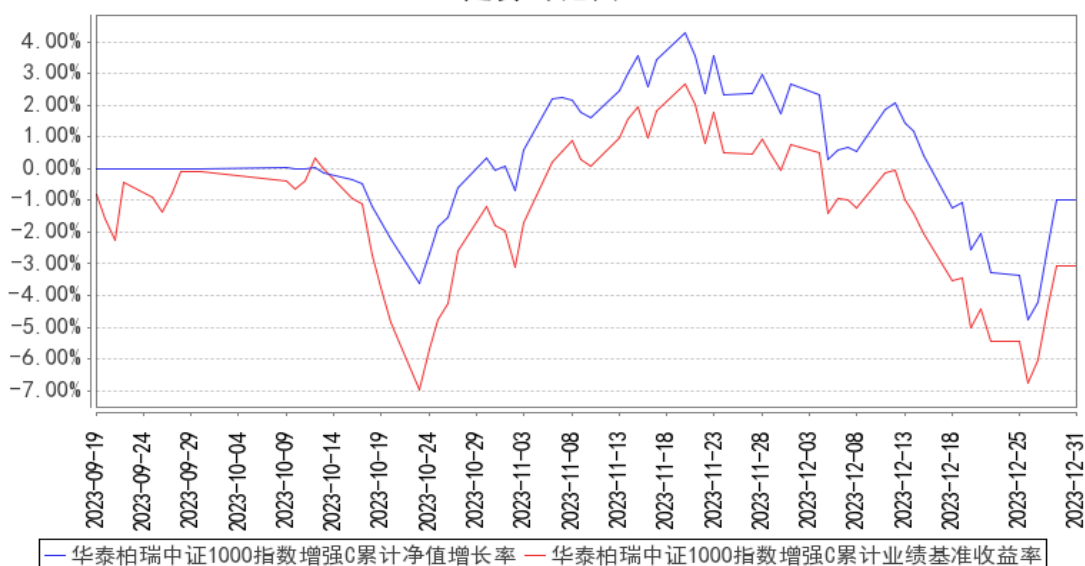
过去三个月	-0.99%	0.85%	-2.98%	0.98%	1.99%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-0.98%	0.79%	-3.05%	0.97%	2.07%	-0.18%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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2023年12月31日。C类图示日期为2023年9月19日至2023年12月31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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
笪篁	本基金的基金经理	2023 年 9 月 19 日	-	9 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。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。

#### 4.1.1 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遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 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 10 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年四季度，A 股整体呈现下行趋势。从短期经济数据来看，国内经济复苏依然较慢，“疤痕效应”造成的内需不足问题仍未完全消除，政府出台的稳经济和风险化解政策传导见效仍需时间。海外方面，美联储议息会议“鸽派”表态，市场预期美国经济软着陆概率较大，叠加领导人旧金山会晤，外部环境整体稳中有升。由此来看，市场核心分歧点主要集中在国内经济复苏进度、房地产业和地方债务等风险的化解上，A 股市场与此相关的消费、传统制造、金融等板块下跌较多。另一方面，外需主导的相关产业链表现较强，同时以创新药、大模型、华为链为代表的高科技赛道逐步成为市场热点。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别下跌 7.22% 和 7.00%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别下跌 5.62% 和 4.03%；中小市值指数中证 1000 和中证 2000 同期涨幅分别为 -3.15% 和 1.92%。横向比较来看，大市值与传统行业下跌较多，中小市值和成长板块相对较强。

本报告期内，我们坚持技术面为主的短期量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

展望未来几个季度，经济的恢复和增长仍然是值得期待的，中国经济基本盘依然稳固，科技创新的政策支持力度预计也将进一步加强。此外，中美关系进入边际缓和期，美联储降息也将提上日程，外部环境正在呈现积极变化。A 股市场当前的整体估值很有吸引力，结构上的估值风险已经释放较充分，只待投资人情绪的恢复。估值修复本身也可以推动市场的上行，在不出现极端情况的前提下，我们对 2024 年的 A 股股票市场持比较乐观的态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，短期策略模型在四季度表现平稳。考虑到市场风险加剧，我们采取相对谨慎的组合管理方法，以求降低组合整体波动。展望后市，我们预计短期市场波动会加剧，无论是大

小盘之间的轮动，还是主题板块的轮动，变化会更加多样，但同时波动也更剧烈。当前我们的组合配置依然较为均衡，力争通过模型的选股能力获取超额收益。一方面，模型的技术面因子通过捕捉资金流特征，或能较好地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。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用量化选股策略，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

#### 4.5 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 0.9914 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.89%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%，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 0.9902 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.99%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	268,494,208.10	94.07
	其中：股票	268,494,208.10	94.07
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	15,736,128.44	5.51
8	其他资产	1,194,220.71	0.42
9	合计	285,424,557.25	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	354,564.00	0.12
B	采矿业	4,902,313.00	1.73
C	制造业	170,735,104.30	60.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,658,296.00	2.70
E	建筑业	4,476,500.00	1.58
F	批发和零售业	7,282,072.00	2.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,805,140.92	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,354,376.56	17.73
J	金融业	5,532,187.00	1.95
K	房地产业	1,547,963.00	0.54
L	租赁和商务服务业	1,050,824.40	0.37
M	科学研究和技术服务业	1,858,392.92	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,153,428.00	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,888,013.00	1.02
R	文化、体育和娱乐业	6,020,562.00	2.12
S	综合	874,471.00	0.31
	合计	268,494,208.10	94.51

## 5.2.2 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	603728	鸣志电器	44,700	2,943,495.00	1.04
2	300451	创业慧康	443,800	2,906,890.00	1.02
3	002544	普天科技	138,400	2,812,288.00	0.99
4	600037	歌华有线	363,200	2,807,536.00	0.99
5	300002	神州泰岳	294,300	2,604,555.00	0.92
6	300065	海兰信	253,500	2,578,095.00	0.91
7	300024	机器人	217,000	2,575,790.00	0.91
8	600158	中体产业	323,200	2,514,496.00	0.89
9	000818	航锦科技	76,200	2,391,156.00	0.84
10	688277	天智航	178,400	2,351,312.00	0.83



#### 5.4 报告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。

#### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,194,220.71
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,194,220.71

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

### 5.11.6 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。

## §6 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
报告期期初基金份额总额	237,197,469.05	110,701,240.53
报告期期间基金总申购份额	9,223,591.52	3,486,075.98
减：报告期期间基金总赎回份额	45,333,082.92	28,629,287.40
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	201,087,977.65	85,558,029.11

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 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

### 9.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 1 月 22 日