

华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券
投资基金
2023 年年度报告

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

送出日期：2024 年 3 月 30 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。本年度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 3 月 29 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	53

8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	73
8.7 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	73
8.8 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	73
8.9 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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末上市基金前十名持有人	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	76
§ 10 开放式基金份额变动	76
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	79
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A 股 ETF
场内简称	A 股 ETF（扩位证券简称：A 股 ETF）
基金主代码	563330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 10 月 30 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	299,421,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 11 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、股票（含存托凭证）的投资策略</p> <p>本基金主要采用抽样复制法跟踪标的指数。抽样复制依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，以“跟踪误差最小化”为优化目标创建组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争做到日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金将根据投资目标，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务</p>
业绩比较基准	中证 A 股指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用抽样复制策略，跟踪中证 A 股指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	张姗
		400-61-95555

电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-0001	400-61-95555
传真	021-38601799	0755-83195201
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,895,372.86
本期利润	682,103.66
加权平均基金份额本期利润	0.0025
本期加权平均净值利润率	0.26%
本期基金份额净值增长率	-2.78%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	-8,338,676.66
期末可供分配基金份额利润	-0.0278
期末基金资产净值	291,082,323.34
期末基金份额净值	0.9722
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-2.78%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相

关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

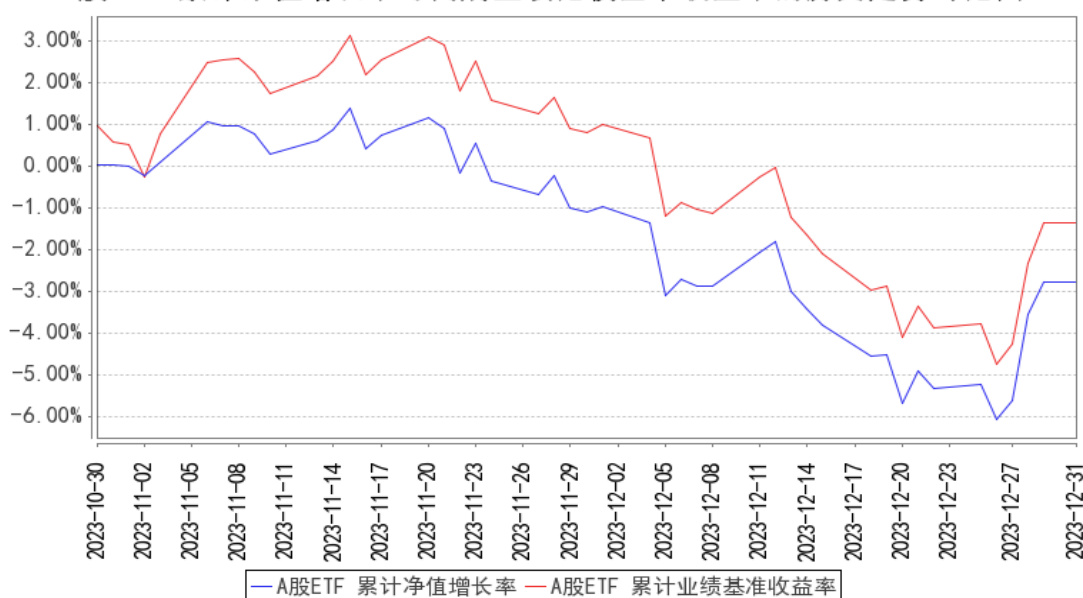
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-2.78%	0.69%	-1.37%	0.78%	-1.41%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A股ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

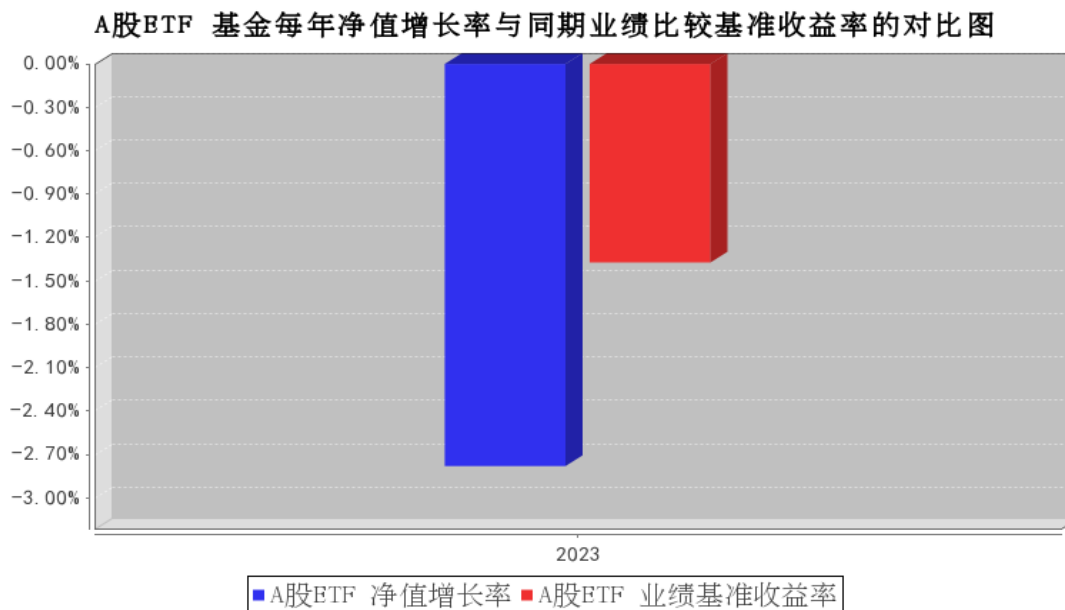


注：1、图示日期为2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同自 2023 年 10 月 30 日起生效，2023 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

§ 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%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升

级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏

交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资

基金（QDII）、华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞致远混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞益享债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦合债券型证券投资基金、华泰柏瑞祥泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞科技创新混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2023 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 3801.46 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 10 月 30 日	-	22 年	复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证

				<p>500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指</p>
--	--	--	--	---

					数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023年9月起任华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年10月起任华泰柏瑞中证A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 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中的公平交易模块，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。

4.3.3 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 20 次，其中 4 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 16 次为指数量化投资组合因投资策略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

2023 年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、计算机、电子的表现相对较好，涨跌幅分别为 25.75%、16.80%、8.97% 和 7.25%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为-11.38%、-7.42%、-6.28% 和 -19.41%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-4.10% 和 -21.85%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

2023 年，在疫情对经济的边际影响逐渐退出以后，国内经济呈现渐进式复苏。在总量驱动、库存周期及中美经济周期错位的驱动下，市场呈现震荡走势，以结构性机会为主。中证央企红利全收益指数表现十分亮眼，上涨 6.91%，表现出较强的防御性。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.061%，期间日跟踪误差为 0.077%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9722 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.78%，业绩比较基准收益率为-1.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，投资者会在政策预期与实际兑现之间博弈，市场波动仍然会震荡加剧，红利策略的防御属性仍将是资金的“避风港”。同时，国内经济在 2024 年将继续温和复苏，确定性较高的驱动因素在于国内积极财政政策的前置下，财政政策将对基建发力形成积极支撑。在私人部门缺乏加杠杆的情况下，政府部门加杠杆或成为信用周期的最主要抓手。红利策略在稳增长板块暴露较高，再次成为攻守兼备的标的重要抓手。

同时，我们始终认为在“中特估”行情下，高分红特点的央国企是一条重要且清晰的投资思路。因此，以“股息率”为筛选标准的红利策略在央国企行情下具备天然优势，具有估值重塑的

投资机会。我们认为“中特估”机会仍然是全年投资主线之一，为获得更强的 Beta，可以加大高股息策略的配置权重作为“杠铃配置”中的重要一头。当前中证央企红利指数处于右侧布局合理区间。从估值的角度看，当前处于 30%以下的估值分位数水平，属于合理偏低的位置，仍具有配置价值。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司

员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为-8,338,676.66 元。

4.9 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。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22168 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞 A 股 ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞 A 股 ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞 A 股 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞 A 股 ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞 A 股 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清</p>

	算华泰柏瑞 A 股 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞 A 股 ETF 基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞 A 股 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞 A 股 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	5,061,688.17
结算备付金		7,328,773.67
存出保证金		1,286,862.18
交易性金融资产	7.4.7.2	279,606,837.33
其中：股票投资		279,566,735.64
基金投资		-
债券投资		40,101.69
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		507,384.91
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		293,791,546.26
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-12.70
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-

应付管理人报酬		93,499.60
应付托管费		18,699.93
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		14.36
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	2,597,021.73
负债合计		2,709,222.92
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	299,421,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-8,338,676.66
净资产合计		291,082,323.34
负债和净资产总计		293,791,546.26

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9722 元，基金份额总额 299,421,000.00 份。

2、本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 10 月 30 日(基金合同 生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,077,091.26
1. 利息收入		85,744.30
其中：存款利息收入	7.4.7.13	85,744.30
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）		3,919,500.56
其中：股票投资收益	7.4.7.14	3,745,505.97
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	1.69
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-

衍生工具收益	7.4.7.18	-147.97
股利收益	7.4.7.19	174,140.87
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）	7.4.7.20	-4,213,269.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,285,115.60
减：二、营业总支出		394,987.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	216,915.93
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	43,383.23
3. 销售服务费		-
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	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		1.54
8. 其他费用	7.4.7.23	134,686.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		682,103.66
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		682,103.66
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		682,103.66

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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、本期期初净资产	635,421,000.00	-	-	635,421,000.00

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-336,000,000.00	-	-8,338,676.66	-344,338,676.66
(一)、综合收益总额	-	-	682,103.66	682,103.66
(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)	-336,000,000.00	-	-9,020,780.32	-345,020,780.32
其中：1. 基金申购款	168,000,000.00	-	-4,203,418.15	163,796,581.85
2. 基金赎回款	-504,000,000.00	-	-4,817,362.17	-508,817,362.17
(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	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2267 号《关于准予华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息

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

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]244 号核准,本基金 635,421,000.00 份基金份额于 2023 年 11 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 A 股指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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 2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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业务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的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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中以交易性金融负债列示。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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收

率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	5,061,688.17
等于：本金	5,061,280.65
加：应计利息	407.52
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,061,688.17

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	283,728,688.84	-	279,566,735.64	-4,161,953.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	40,100.00	1.69	40,101.69
	银行间市场	-	-	-
	合计	40,100.00	1.69	40,101.69
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	283,768,788.84	1.69	279,606,837.33	-4,161,953.20

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	9,001,000.00	-	-	
其中：股指期 货投资	9,001,000.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	9,001,000.00	-	-	

7.4.7.3.2 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
IC2401	中证 500 股指 期货 2401	2.00	2,174,720.00	-26,640.00
IF2401	深 300 股指期 货 2401	2.00	2,063,880.00	35,640.00
IM2401	中证 1000 股指 期货 2401	4.00	4,710,400.00	-61,000.00
合计				-52,000.00
减：可抵销期货 暂收款				-52,000.00
净额				-

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

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 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。

7.4.7.6.2 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。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	572,757.45
其中：交易所市场	572,757.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,000.00
应退退补款	1,929,264.28
合计	2,597,021.73

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	635,421,000.00	635,421,000.00
本期申购	168,000,000.00	168,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-504,000,000.00	-504,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	299,421,000.00	299,421,000.00

注：1. 投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

2. 本基金自 2023 年 10 月 18 日至 2023 年 10 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币为 635,421,000.00 元，折合为 635,421,000.00 份基金份额。本基金设立募集期内认购资金未产生利息收入。

3. 根据《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同招募说明书》及《华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 11 月 6 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务和赎回业务自 2023 年 11 月 7 日起开始办理。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

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	4,895,372.86	-4,213,269.20	682,103.66
本期基金份额交易产生的变动数	-492,818.77	-8,527,961.55	-9,020,780.32
其中：基金申购款	2,348,883.76	-6,552,301.91	-4,203,418.15
金赎回款	-2,841,702.53	-1,975,659.64	-4,817,362.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,402,554.09	-12,741,230.75	-8,338,676.66

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	32,764.19
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	52,711.87
其他	268.24
合计	85,744.30

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,238,345.55
股票投资收益——赎回差价收入	1,507,160.42
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	3,745,505.97

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	250,792,159.07
减：卖出股票成本总额	247,525,230.12
减：交易费用	1,028,583.40
买卖股票差价收入	2,238,345.55

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	508,817,362.17
减：现金支付赎回款总额	239,951,588.17
减：赎回股票成本总额	267,358,613.58
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,507,160.42

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	1.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1.69

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.15.3 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。

7.4.7.15.4 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。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 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。

7.4.7.16.4 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。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 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。

7.4.7.17.3 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。

7.4.7.17.4 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。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	-147.97

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	174,140.87
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	174,140.87

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,161,953.20
股票投资	-4,161,953.20
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	-52,000.00
权证投资	-
期货投资	-52,000.00
3. 其他	684.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,213,269.20

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,146,545.39
其他	138,570.21

合计	1,285,115.60
----	--------------

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

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00
信息披露费	20,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
注册登记费	37,500.00
IOPV 计算发布费	20,000.00
银行划款手续费	1,786.90
合计	134,686.90

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	287,015,290.64	29.78

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31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	268,616.93	31.93	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	216,915.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,863.46
应支付基金管理人的净管理费	213,052.47

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费		43,383.23

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

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

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 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：本报告期内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	5,061,688.17	32,764.19

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31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	127100	神码转债	网上配售	111	11,100.00
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	4,575	40,717.50
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,068	35,511.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	12.05	19.92	128	1,542.40	2,549.76	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	41.00	44.16	51	2,091.00	2,252.16	-
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	33.25	58.19	107	3,557.75	6,226.33	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	31.90	39.84	109	3,477.10	4,342.56	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	2.66	4.45	2,707	7,200.62	12,046.15	-
301566	达利凯	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	8.90	22.14	458	4,076.20	10,140.12	-

	普	日								
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定期内	48.94	68.32	85	4,159.90	5,807.20	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	1,284	2,182.80	5,213.04	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定期内	16.80	31.19	90	1,512.00	2,807.10	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	21.29	21.53	61	1,298.69	1,313.33	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定期内	19.10	34.75	74	1,413.40	2,571.50	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111018	华康转债	2023年12月25日	1个月	配债未上市	100.00	100.00	290	29,000.89	29,000.89	-
127100	神码转债	2023年12月21日	1个月	配债未上市	100.00	100.01	111	11,100.80	11,100.80	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 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 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%。

7.4.13.3 流动性风险

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

于 2023 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12。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 2023 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,061,688.17	-	-	-	-	-	5,061,688.17
结算备付金	7,328,773.67	-	-	-	-	-	7,328,773.67
存出保证金	212,982.18	-	-	-	-	1,073,880.00	1,286,862.18
交易性金融资产	-	-	-	-40,101.69	279,566,735.64	279,606,837.33	
应收清算款	-	-	-	-	-	507,384.91	507,384.91
资产总计	12,603,444.02	-	-	-40,101.69	281,148,000.55	293,791,546.26	
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-12.70	-12.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	93,499.60	93,499.60
应付托管费	-	-	-	-	-	18,699.93	18,699.93
应交税费	-	-	-	-	-	14.36	14.36
其他负债	-	-	-	-	-	2,597,021.73	2,597,021.73
负债总计	-	-	-	-	-	2,709,222.92	2,709,222.92
利率敏感度缺口	12,603,444.02	-	-	-40,101.69	278,438,777.63	291,082,323.34	

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2023年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.01%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	279,566,735.64	96.04
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	12.70	—
合计	279,566,748.34	96.04

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A 股指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)
		本期末(2023 年 12 月 31 日)
	中证 A 股指数上升 5%	14,369,880.37
	中证 A 股指数下降 5%	-14,369,880.37

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023年12月31日
第一层次	279,511,466.39
第二层次	40,101.69
第三层次	55,269.25
合计	279,606,837.33

7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	32,511.86	32,511.86
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	22,757.39	22,757.39
其中：计入损益的利得或损失	-	22,757.39	22,757.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	55,269.25	55,269.25
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	22,757.39	22,757.39

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年 10 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	55,269.25	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.5141~2.1775	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 基金申购款

于 2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间, 本基金申购基金份额的对价总额为 163,796,581.85 元, 其中包括以股票支付的申购款 85,110,416.60 元和以现金支付的申购款 78,686,165.25 元。

(2) 除基金申购款外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	279,566,735.64	95.16
	其中: 股票	279,566,735.64	95.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,101.69	0.01
	其中: 债券	40,101.69	0.01
	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	12,390,461.84	4.22
8	其他各项资产	1,794,247.09	0.61
9	合计	293,791,546.26	100.00

注: 上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,764,796.00	1.29
B	采矿业	11,399,914.00	3.92
C	制造业	167,769,741.74	57.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,320,544.00	2.86
E	建筑业	4,133,867.00	1.42
F	批发和零售业	5,709,045.00	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	7,490,812.00	2.57
H	住宿和餐饮业	215,280.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,051,522.77	6.55

J	金融业	34,652,976.88	11.90
K	房地产业	4,588,180.00	1.58
L	租赁和商务服务业	2,725,917.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	2,553,853.00	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	1,655,067.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,054,413.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	2,748,196.00	0.94
S	综合	675,050.00	0.23
	合计	279,509,175.39	96.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,988.75	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,571.50	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐	-	-

	业		
S	综合	-	-
	合计	57,560.25	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,200	12,427,200.00	4.27
2	300750	宁德时代	21,456	3,502,906.56	1.20
3	601318	中国平安	78,000	3,143,400.00	1.08
4	688012	中微公司	14,397	2,211,379.20	0.76
5	300760	迈瑞医疗	7,200	2,092,320.00	0.72
6	000858	五粮液	14,300	2,006,433.00	0.69
7	000333	美的集团	35,899	1,961,162.37	0.67
8	600809	山西汾酒	7,200	1,661,256.00	0.57
9	600276	恒瑞医药	35,900	1,623,757.00	0.56
10	601166	兴业银行	99,400	1,611,274.00	0.55
11	600900	长江电力	64,700	1,510,098.00	0.52
12	601899	紫金矿业	121,100	1,508,906.00	0.52
13	002475	立讯精密	43,000	1,481,350.00	0.51
14	002594	比亚迪	7,200	1,425,600.00	0.49
15	300059	东方财富	92,400	1,297,296.00	0.45
16	600030	中信证券	63,500	1,293,495.00	0.44
17	000568	泸州老窖	7,200	1,291,824.00	0.44
18	002415	海康威视	35,900	1,246,448.00	0.43
19	601012	隆基绿能	52,600	1,204,540.00	0.41
20	600887	伊利股份	43,100	1,152,925.00	0.40
21	601328	交通银行	199,200	1,143,408.00	0.39
22	000725	京东方A	290,800	1,134,120.00	0.39
23	600309	万华化学	14,300	1,098,526.00	0.38
24	601398	工商银行	227,900	1,089,362.00	0.37
25	603259	药明康德	14,300	1,040,468.00	0.36
26	000651	格力电器	28,700	923,279.00	0.32
27	300124	汇川技术	14,300	902,902.00	0.31
28	688099	晶晨股份	14,237	891,663.31	0.31
29	002714	牧原股份	21,500	885,370.00	0.30
30	300498	温氏股份	43,100	864,586.00	0.30
31	600028	中国石化	148,900	830,862.00	0.29

32	300308	中际旭创	7,200	812,952.00	0.28
33	600406	国电南瑞	35,900	801,288.00	0.28
34	601816	京沪高铁	157,200	773,424.00	0.27
35	603501	韦尔股份	7,200	768,312.00	0.26
36	000063	中兴通讯	28,700	759,976.00	0.26
37	688981	中芯国际	14,197	752,724.94	0.26
38	601288	农业银行	205,800	749,112.00	0.26
39	601728	中国电信	135,300	731,973.00	0.25
40	000625	长安汽车	43,100	725,373.00	0.25
41	002142	宁波银行	35,900	721,949.00	0.25
42	600050	中国联通	164,300	719,634.00	0.25
43	600941	中国移动	7,200	716,256.00	0.25
44	601857	中国石油	99,700	703,882.00	0.24
45	600089	特变电工	50,300	694,140.00	0.24
46	600031	三一重工	50,300	692,631.00	0.24
47	601601	中国太保	28,700	682,486.00	0.23
48	300131	英唐智控	113,000	679,130.00	0.23
49	000009	中国宝安	57,500	675,050.00	0.23
50	601088	中国神华	21,500	674,025.00	0.23
51	600016	民生银行	178,400	667,216.00	0.23
52	600563	法拉电子	7,200	666,720.00	0.23
53	603986	兆易创新	7,200	665,208.00	0.23
54	002230	科大讯飞	14,300	663,234.00	0.23
55	600373	中文传媒	50,200	661,636.00	0.23
56	300394	天孚通信	7,200	658,944.00	0.23
57	688777	中控技术	14,237	645,647.95	0.22
58	300661	圣邦股份	7,200	640,872.00	0.22
59	600150	中国船舶	21,500	632,960.00	0.22
60	002050	三花智控	21,500	632,100.00	0.22
61	300274	阳光电源	7,200	630,648.00	0.22
62	688002	睿创微纳	14,237	629,560.14	0.22
63	002027	分众传媒	98,300	621,256.00	0.21
64	002074	国轩高科	28,700	617,050.00	0.21
65	300088	长信科技	91,500	612,135.00	0.21
66	000100	TCL 科技	141,700	609,310.00	0.21
67	605117	德业股份	7,200	604,080.00	0.21
68	300014	亿纬锂能	14,300	603,460.00	0.21
69	601888	中国中免	7,200	602,568.00	0.21
70	601225	陕西煤业	28,700	599,543.00	0.21
71	688230	芯导科技	14,290	597,893.60	0.21
72	000001	平安银行	63,500	596,265.00	0.20
73	600885	宏发股份	21,500	594,260.00	0.20
74	688180	君实生物	14,197	593,860.51	0.20

75	000338	潍柴动力	43,100	588,315.00	0.20
76	601668	中国建筑	121,100	582,491.00	0.20
77	002352	顺丰控股	14,300	577,720.00	0.20
78	300496	中科创达	7,200	576,432.00	0.20
79	600048	保利发展	57,400	568,260.00	0.20
80	601988	中国银行	142,400	568,176.00	0.20
81	300015	爱尔眼科	35,900	567,938.00	0.20
82	603019	中科曙光	14,300	564,707.00	0.19
83	300832	新产业	7,200	563,040.00	0.19
84	002129	TCL 中环	35,900	561,476.00	0.19
85	688556	高测股份	14,397	561,339.03	0.19
86	000938	紫光股份	28,700	555,345.00	0.19
87	601162	天风证券	178,700	552,183.00	0.19
88	600763	通策医疗	7,200	550,440.00	0.19
89	300296	利亚德	91,500	549,000.00	0.19
90	601127	赛力斯	7,200	548,640.00	0.19
91	688788	科思科技	14,176	548,327.68	0.19
92	600642	申能股份	85,000	545,700.00	0.19
93	601138	工业富联	35,900	542,808.00	0.19
94	603288	海天味业	14,300	542,685.00	0.19
95	300463	迈克生物	35,900	541,013.00	0.19
96	603392	万泰生物	7,200	540,936.00	0.19
97	600438	通威股份	21,500	538,145.00	0.18
98	300418	昆仑万维	14,300	534,820.00	0.18
99	300724	捷佳伟创	7,200	532,872.00	0.18
100	601689	拓普集团	7,200	529,200.00	0.18
101	000799	酒鬼酒	7,200	526,680.00	0.18
102	000002	万 科 A	50,200	525,092.00	0.18
103	002396	星网锐捷	28,700	518,609.00	0.18
104	601997	贵阳银行	99,600	511,944.00	0.18
105	002402	和而泰	35,800	511,582.00	0.18
106	300142	沃森生物	21,500	505,465.00	0.17
107	300763	锦浪科技	7,200	503,280.00	0.17
108	603596	伯特利	7,200	498,960.00	0.17
109	603160	汇顶科技	7,200	497,520.00	0.17
110	600460	士兰微	21,500	490,845.00	0.17
111	002185	华天科技	57,300	488,196.00	0.17
112	600535	天士力	28,600	486,772.00	0.17
113	002049	紫光国微	7,200	485,640.00	0.17
114	601390	中国中铁	85,000	482,800.00	0.17
115	600528	中铁工业	64,700	481,368.00	0.17
116	600123	兰花科创	43,100	475,824.00	0.16
117	002463	沪电股份	21,500	475,580.00	0.16

118	000977	浪潮信息	14,300	474,760.00	0.16
119	600919	江苏银行	70,600	472,314.00	0.16
120	603799	华友钴业	14,300	470,899.00	0.16
121	600837	海通证券	50,200	470,374.00	0.16
122	601985	中国核电	62,600	469,500.00	0.16
123	002739	万达电影	36,000	468,720.00	0.16
124	688314	康拓医疗	14,237	468,539.67	0.16
125	002801	微光股份	21,500	467,625.00	0.16
126	002131	利欧股份	204,500	466,260.00	0.16
127	300182	捷成股份	91,500	464,820.00	0.16
128	002239	奥特佳	142,700	463,775.00	0.16
129	002465	海格通信	35,900	461,315.00	0.16
130	600461	洪城环境	50,300	459,742.00	0.16
131	002332	仙琚制药	35,900	458,443.00	0.16
132	000792	盐湖股份	28,700	457,765.00	0.16
133	002936	郑州银行	227,500	457,275.00	0.16
134	600690	海尔智家	21,500	451,500.00	0.16
135	601615	明阳智能	35,900	450,186.00	0.15
136	300036	超图软件	21,500	449,350.00	0.15
137	601766	中国中车	85,200	448,152.00	0.15
138	002008	大族激光	21,500	445,480.00	0.15
138	002459	晶澳科技	21,500	445,480.00	0.15
139	603882	金域医学	7,100	444,247.00	0.15
140	000887	中鼎股份	35,900	444,083.00	0.15
141	300568	星源材质	28,700	442,554.00	0.15
142	300122	智飞生物	7,200	439,992.00	0.15
143	300769	德方纳米	7,200	439,416.00	0.15
144	601098	中南传媒	43,100	438,327.00	0.15
145	300803	指南针	7,200	433,872.00	0.15
146	688388	嘉元科技	21,356	433,099.68	0.15
147	300001	特锐德	21,500	432,150.00	0.15
148	601187	厦门银行	85,200	431,964.00	0.15
149	002958	青农商行	164,100	429,942.00	0.15
150	603927	中科软	14,300	428,714.00	0.15
151	000750	国海证券	121,100	428,694.00	0.15
152	000650	仁和药业	64,600	428,298.00	0.15
153	000528	柳工	63,500	427,990.00	0.15
154	600584	长电科技	14,300	426,998.00	0.15
155	002241	歌尔股份	20,300	426,503.00	0.15
156	603881	数据港	21,500	426,130.00	0.15
157	000988	华工科技	14,300	425,568.00	0.15
158	002624	完美世界	35,800	423,872.00	0.15
159	000733	振华科技	7,200	423,648.00	0.15

160	300207	欣旺达	28,700	423,612.00	0.15
161	600779	水井坊	7,200	423,144.00	0.15
162	002436	兴森科技	28,700	422,751.00	0.15
163	601058	赛轮轮胎	35,900	421,825.00	0.14
164	000997	新大陆	21,500	421,615.00	0.14
165	300408	三环集团	14,300	421,135.00	0.14
166	002500	山西证券	78,000	420,420.00	0.14
167	301050	雷电微力	7,200	419,472.00	0.14
168	000900	现代投资	106,700	418,264.00	0.14
169	002422	科伦药业	14,300	415,415.00	0.14
170	300357	我武生物	14,300	414,700.00	0.14
171	600777	新潮能源	135,500	414,630.00	0.14
172	600795	国电电力	99,600	414,336.00	0.14
172	603323	苏农银行	99,600	414,336.00	0.14
173	603308	应流股份	28,700	411,271.00	0.14
174	600570	恒生电子	14,300	411,268.00	0.14
175	600256	广汇能源	57,500	410,550.00	0.14
176	002966	苏州银行	63,500	410,210.00	0.14
177	601168	西部矿业	28,700	409,549.00	0.14
178	600269	赣粤高速	99,600	409,356.00	0.14
179	600511	国药股份	14,300	409,266.00	0.14
180	002812	恩捷股份	7,200	409,104.00	0.14
181	000762	西藏矿业	14,300	408,980.00	0.14
182	688599	天合光能	14,237	406,181.61	0.14
183	603197	保隆科技	7,200	406,080.00	0.14
184	601628	中国人寿	14,300	405,405.00	0.14
185	300077	国民技术	35,900	405,311.00	0.14
186	002555	三七互娱	21,500	404,415.00	0.14
187	002807	江阴银行	113,900	404,345.00	0.14
188	600163	中闽能源	92,400	403,788.00	0.14
189	000598	兴蓉环境	70,600	401,714.00	0.14
190	002466	天齐锂业	7,200	401,688.00	0.14
191	002126	银轮股份	21,500	401,405.00	0.14
192	002409	雅克科技	7,200	401,256.00	0.14
193	300775	三角防务	14,300	398,970.00	0.14
194	600703	三安光电	28,700	397,495.00	0.14
195	600711	盛屯矿业	91,500	397,110.00	0.14
196	688689	银河微电	14,237	396,785.19	0.14
197	002236	大华股份	21,500	396,675.00	0.14
198	601860	紫金银行	156,700	396,451.00	0.14
199	002335	科华数据	14,300	395,824.00	0.14
200	300347	泰格医药	7,200	395,784.00	0.14
201	002039	黔源电力	28,700	395,773.00	0.14

202	300346	南大光电	14,300	394,823.00	0.14
203	002675	东诚药业	21,500	394,095.00	0.14
204	600183	生益科技	21,500	393,665.00	0.14
205	605358	立昂微	14,300	391,677.00	0.13
206	600125	铁龙物流	64,700	391,435.00	0.13
207	600572	康恩贝	77,500	391,375.00	0.13
208	002384	东山精密	21,500	390,870.00	0.13
209	002948	青岛银行	128,100	390,705.00	0.13
210	002192	融捷股份	7,200	390,312.00	0.13
211	002926	华西证券	50,200	389,552.00	0.13
212	600908	无锡银行	77,100	389,355.00	0.13
213	600867	通化东宝	35,900	388,797.00	0.13
214	002273	水晶光电	28,700	388,598.00	0.13
215	601100	恒立液压	7,100	388,228.00	0.13
216	002262	恩华药业	14,300	387,816.00	0.13
217	600011	华能国际	50,300	387,310.00	0.13
218	600201	生物股份	35,900	386,643.00	0.13
219	600085	同仁堂	7,200	386,640.00	0.13
220	002138	顺络电子	14,300	386,243.00	0.13
221	600699	均胜电子	21,500	386,140.00	0.13
222	002439	启明星辰	14,300	386,100.00	0.13
223	600771	广誉远	14,300	385,957.00	0.13
224	002839	张家港行	99,400	385,672.00	0.13
225	600019	宝钢股份	64,700	383,671.00	0.13
226	300487	蓝晓科技	7,200	382,032.00	0.13
227	002413	雷科防务	70,700	381,780.00	0.13
228	601375	中原证券	99,600	381,468.00	0.13
229	300002	神州泰岳	43,100	381,435.00	0.13
230	603087	甘李药业	7,200	379,080.00	0.13
231	300091	金通灵	141,700	378,339.00	0.13
232	600886	国投电力	28,700	378,266.00	0.13
233	600797	浙大网新	57,400	376,544.00	0.13
234	601989	中国重工	91,100	376,243.00	0.13
235	002756	永兴材料	7,200	375,912.00	0.13
236	002497	雅化集团	28,700	375,683.00	0.13
237	600958	东方证券	43,100	374,970.00	0.13
238	002028	思源电气	7,200	374,688.00	0.13
239	600369	西南证券	91,500	374,235.00	0.13
240	002510	天汽模	76,900	373,734.00	0.13
241	000735	罗牛山	64,700	373,319.00	0.13
242	601177	杭齿前进	35,900	372,283.00	0.13
243	600157	永泰能源	271,100	371,407.00	0.13
244	300068	南都电源	28,700	371,378.00	0.13

245	001227	兰州银行	142,700	371,020.00	0.13
246	601658	邮储银行	85,200	370,620.00	0.13
247	600118	中国卫星	14,300	369,226.00	0.13
248	601128	常熟银行	57,500	367,425.00	0.13
249	601555	东吴证券	50,200	366,962.00	0.13
250	300352	北信源	77,100	366,225.00	0.13
251	600285	羚锐制药	21,400	366,154.00	0.13
252	300450	先导智能	14,300	366,080.00	0.13
252	600529	山东药玻	14,300	366,080.00	0.13
253	603179	新泉股份	7,211	365,669.81	0.13
254	600621	华鑫股份	25,900	364,413.00	0.13
255	002020	京新药业	28,600	363,792.00	0.12
256	300390	天华新能	14,300	362,505.00	0.12
257	601021	春秋航空	7,200	361,440.00	0.12
258	000933	神火股份	21,500	361,200.00	0.12
259	002602	世纪华通	69,900	360,684.00	0.12
260	601633	长城汽车	14,300	360,646.00	0.12
261	600643	爱建集团	70,700	360,570.00	0.12
262	300413	芒果超媒	14,300	360,360.00	0.12
263	000543	皖能电力	57,500	359,950.00	0.12
264	002709	天赐材料	14,300	358,644.00	0.12
265	600522	中天科技	28,700	358,463.00	0.12
266	300233	金城医药	21,500	358,190.00	0.12
267	603111	康尼机电	64,300	358,151.00	0.12
268	000999	华润三九	7,200	358,056.00	0.12
269	600498	烽火通信	21,500	357,760.00	0.12
270	000686	东北证券	50,300	357,130.00	0.12
271	600340	华夏幸福	205,200	357,048.00	0.12
272	688257	新锐股份	14,237	356,494.48	0.12
273	600179	安通控股	142,500	356,250.00	0.12
274	600079	人福医药	14,300	355,498.00	0.12
275	000423	东阿阿胶	7,200	355,104.00	0.12
275	300502	新易盛	7,200	355,104.00	0.12
276	300144	宋城演艺	35,900	354,333.00	0.12
277	603369	今世缘	7,200	351,000.00	0.12
278	002649	博彦科技	28,600	350,922.00	0.12
279	300674	宇信科技	21,500	350,020.00	0.12
280	300383	光环新网	35,900	348,948.00	0.12
281	601011	宝泰隆	99,600	348,600.00	0.12
282	601963	重庆银行	50,078	348,542.88	0.12
283	688567	孚能科技	21,356	348,316.36	0.12
284	605189	富春染织	21,460	347,652.00	0.12
285	300003	乐普医疗	21,500	347,440.00	0.12

286	000672	上峰水泥	43,100	347,386.00	0.12
287	600626	申达股份	83,300	347,361.00	0.12
288	600418	江淮汽车	21,500	347,225.00	0.12
289	300355	蒙草生态	92,400	346,500.00	0.12
290	002025	航天电器	7,200	345,744.00	0.12
291	000690	宝新能源	78,000	345,540.00	0.12
292	002085	万丰奥威	69,900	345,306.00	0.12
293	002252	上海莱士	43,100	344,800.00	0.12
294	300456	赛微电子	14,300	343,772.00	0.12
295	601577	长沙银行	50,300	343,046.00	0.12
296	600487	亨通光电	28,700	342,678.00	0.12
297	603901	永创智能	28,700	341,530.00	0.12
298	600909	华安证券	69,900	341,112.00	0.12
299	300037	新宙邦	7,200	340,560.00	0.12
300	600649	城投控股	91,900	340,030.00	0.12
301	300024	机器人	28,600	339,482.00	0.12
302	603127	昭衍新药	14,300	339,053.00	0.12
303	300017	网宿科技	43,100	338,335.00	0.12
304	600057	厦门象屿	50,300	337,513.00	0.12
305	300136	信维通信	14,300	337,480.00	0.12
306	000060	中金岭南	78,000	336,960.00	0.12
307	600129	太极集团	7,200	334,512.00	0.11
308	601108	财通证券	43,100	334,456.00	0.11
309	002797	第一创业	57,500	334,075.00	0.11
310	603697	有友食品	35,900	333,870.00	0.11
311	002293	罗莱生活	35,900	333,511.00	0.11
312	002326	永太科技	28,700	333,494.00	0.11
313	002448	中原内配	50,200	333,328.00	0.11
314	601665	齐鲁银行	85,200	333,132.00	0.11
315	600000	浦发银行	50,300	332,986.00	0.11
316	601666	平煤股份	28,700	331,772.00	0.11
317	600820	隧道股份	57,500	331,200.00	0.11
317	603991	至正股份	7,200	331,200.00	0.11
318	002156	通富微电	14,300	330,616.00	0.11
319	603026	胜华新材	7,200	330,192.00	0.11
320	002603	以岭药业	14,300	329,901.00	0.11
321	300701	森霸传感	28,700	329,476.00	0.11
322	002841	视源股份	7,200	329,472.00	0.11
323	000157	中联重科	50,300	328,459.00	0.11
324	600728	佳都科技	57,400	328,328.00	0.11
325	002407	多氟多	21,500	327,230.00	0.11
326	600547	山东黄金	14,300	327,041.00	0.11
327	603589	口子窖	7,200	326,160.00	0.11

328	600023	浙能电力	70,700	325,927.00	0.11
329	000778	新兴铸管	85,200	325,464.00	0.11
330	002240	盛新锂能	14,300	325,325.00	0.11
331	600712	南宁百货	62,300	325,206.00	0.11
332	601600	中国铝业	57,500	324,300.00	0.11
333	600917	重庆燃气	50,300	323,932.00	0.11
334	600110	诺德股份	57,400	323,736.00	0.11
335	002180	纳思达	14,300	323,609.00	0.11
336	002311	海大集团	7,200	323,352.00	0.11
337	601838	成都银行	28,700	323,162.00	0.11
338	601360	三六零	35,800	322,558.00	0.11
339	000975	银泰黄金	21,500	322,500.00	0.11
340	600559	老白干酒	14,300	322,465.00	0.11
341	002373	千方科技	28,700	321,727.00	0.11
342	002517	恺英网络	28,700	320,579.00	0.11
343	600221	海航控股	233,900	320,443.00	0.11
344	601528	瑞丰银行	64,700	320,265.00	0.11
345	000768	中航西飞	14,300	319,891.00	0.11
346	300409	道氏技术	28,700	319,718.00	0.11
347	002741	光华科技	21,500	319,705.00	0.11
348	600398	海澜之家	43,000	319,060.00	0.11
349	002558	巨人网络	28,600	318,604.00	0.11
350	603806	福斯特	13,100	317,937.00	0.11
351	002625	光启技术	21,500	317,770.00	0.11
352	300316	晶盛机电	7,200	317,448.00	0.11
353	600227	圣济堂	120,500	316,915.00	0.11
354	600100	同方股份	43,100	316,785.00	0.11
355	600862	中航高科	14,300	316,745.00	0.11
356	002007	华兰生物	14,300	316,459.00	0.11
357	600012	皖通高速	28,700	316,274.00	0.11
358	603279	景津装备	14,300	316,173.00	0.11
359	300577	开润股份	21,500	315,405.00	0.11
360	002340	格林美	57,500	313,950.00	0.11
361	000425	徐工机械	57,400	313,404.00	0.11
362	601699	潞安环能	14,300	313,313.00	0.11
363	002775	文科股份	78,000	312,000.00	0.11
364	002508	老板电器	14,300	311,454.00	0.11
365	601456	国联证券	28,700	311,108.00	0.11
366	002065	东华软件	50,200	309,734.00	0.11
367	002488	金固股份	43,100	309,458.00	0.11
367	300058	蓝色光标	43,100	309,458.00	0.11
368	603337	杰克股份	14,300	308,880.00	0.11
369	000783	长江证券	57,400	308,812.00	0.11

370	002460	赣锋锂业	7,200	308,160.00	0.11
371	603606	东方电缆	7,200	307,800.00	0.11
372	600928	西安银行	92,400	307,692.00	0.11
373	002250	联化科技	43,100	307,303.00	0.11
374	002507	涪陵榨菜	21,500	307,235.00	0.11
375	600745	闻泰科技	7,200	304,632.00	0.10
376	300862	蓝盾光电	7,200	304,128.00	0.10
377	600760	中航沈飞	7,200	303,696.00	0.10
378	600499	科达制造	28,700	302,785.00	0.10
379	600998	九州通	43,100	302,131.00	0.10
380	600988	赤峰黄金	21,500	301,215.00	0.10
381	300087	荃银高科	35,900	300,842.00	0.10
382	600938	中国海油	14,300	299,871.00	0.10
383	603659	璞泰来	14,300	299,299.00	0.10
384	600350	山东高速	43,100	299,114.00	0.10
385	600060	海信视像	14,300	298,870.00	0.10
386	300829	金丹科技	14,300	298,584.00	0.10
386	600750	江中药业	14,300	298,584.00	0.10
387	000963	华东医药	7,200	298,512.00	0.10
388	601000	唐山港	85,000	297,500.00	0.10
389	600351	亚宝药业	43,100	297,390.00	0.10
390	600027	华电国际	57,500	295,550.00	0.10
391	601696	中银证券	28,700	295,323.00	0.10
392	600502	安徽建工	63,500	295,275.00	0.10
393	601377	兴业证券	50,300	295,261.00	0.10
394	688312	燕麦科技	14,237	293,994.05	0.10
395	300197	节能铁汉	141,700	293,319.00	0.10
396	601169	北京银行	64,700	293,091.00	0.10
397	000720	新能泰山	70,700	292,698.00	0.10
398	600392	盛和资源	28,700	292,166.00	0.10
399	600166	福田汽车	106,700	291,291.00	0.10
400	300034	钢研高纳	14,300	291,005.00	0.10
401	000066	中国长城	28,700	290,444.00	0.10
402	601010	文峰股份	119,000	290,360.00	0.10
403	002176	江特电机	21,500	290,250.00	0.10
404	600029	南方航空	50,300	289,728.00	0.10
405	300748	金力永磁	14,300	289,146.00	0.10
406	000042	中洲控股	50,300	288,722.00	0.10
407	601099	太平洋	78,000	288,600.00	0.10
408	601077	渝农商行	70,700	288,456.00	0.10
409	603939	益丰药房	7,200	288,288.00	0.10
410	000723	美锦能源	43,100	287,046.00	0.10
411	600489	中金黄金	28,700	285,852.00	0.10

412	688030	山石网科	14,237	285,024.74	0.10
413	600066	宇通客车	21,500	284,875.00	0.10
414	605166	聚合顺	28,700	284,704.00	0.10
415	600167	联美控股	50,200	284,634.00	0.10
416	002154	报喜鸟	50,100	284,568.00	0.10
417	002318	久立特材	14,300	284,284.00	0.10
418	300433	蓝思科技	21,500	283,800.00	0.10
419	000983	山西焦煤	28,700	283,556.00	0.10
420	600188	兖矿能源	14,300	283,283.00	0.10
421	000627	天茂集团	99,600	282,864.00	0.10
422	002798	帝欧家居	43,100	282,305.00	0.10
423	600423	柳化股份	77,100	282,186.00	0.10
424	600383	金地集团	64,700	282,092.00	0.10
425	002179	中航光电	7,200	280,800.00	0.10
426	002212	天融信	28,700	280,686.00	0.10
427	601939	建设银行	43,100	280,581.00	0.10
428	002930	宏川智慧	14,300	277,277.00	0.10
429	600111	北方稀土	14,300	276,562.00	0.10
430	000401	冀东水泥	43,100	275,409.00	0.09
431	300073	当升科技	7,200	275,040.00	0.09
432	000036	华联控股	70,700	275,023.00	0.09
433	002271	东方雨虹	14,300	274,560.00	0.09
434	601117	中国化学	43,100	274,116.00	0.09
435	601995	中金公司	7,200	273,960.00	0.09
436	300604	长川科技	7,200	273,528.00	0.09
437	001979	招商蛇口	28,700	273,511.00	0.09
438	600765	中航重机	14,300	273,273.00	0.09
439	300470	中密控股	7,200	272,160.00	0.09
440	002187	广百股份	43,100	271,961.00	0.09
441	603979	金诚信	7,200	271,872.00	0.09
442	600660	福耀玻璃	7,200	269,208.00	0.09
443	600893	航发动力	7,200	269,136.00	0.09
444	002738	中矿资源	7,200	268,632.00	0.09
445	000523	红棉股份	85,200	267,528.00	0.09
446	605060	联德股份	14,300	267,410.00	0.09
447	600801	华新水泥	21,500	267,245.00	0.09
448	688015	交控科技	14,237	267,086.12	0.09
449	600839	四川长虹	50,300	266,087.00	0.09
450	002081	金螳螂	70,700	265,832.00	0.09
451	600733	北汽蓝谷	43,100	264,203.00	0.09
452	601111	中国国航	35,900	263,506.00	0.09
453	300395	菲利华	7,200	263,232.00	0.09
454	000807	云铝股份	21,500	262,730.00	0.09

455	300597	吉大通信	28,600	262,262.00	0.09
456	600596	新安股份	28,700	261,744.00	0.09
457	600338	西藏珠峰	21,500	261,440.00	0.09
458	600536	中国软件	7,200	261,072.00	0.09
459	600141	兴发集团	14,300	260,975.00	0.09
460	600109	国金证券	28,700	260,596.00	0.09
461	601881	中国银河	21,500	259,075.00	0.09
462	000932	华菱钢铁	50,300	259,045.00	0.09
463	002044	美年健康	43,100	259,031.00	0.09
464	600325	华发股份	35,900	258,839.00	0.09
465	002195	岩山科技	84,300	258,801.00	0.09
466	600376	首开股份	85,000	258,400.00	0.09
467	603885	吉祥航空	21,500	258,000.00	0.09
468	003033	征和工业	7,200	257,832.00	0.09
469	600482	中国动力	14,300	257,543.00	0.09
470	002385	大北农	43,100	256,876.00	0.09
471	002312	川发龙蟒	35,900	256,685.00	0.09
472	002277	友阿股份	63,500	255,905.00	0.09
473	002405	四维图新	28,700	255,430.00	0.09
474	300287	飞利信	63,500	255,270.00	0.09
475	600588	用友网络	14,300	254,397.00	0.09
476	002233	塔牌集团	35,900	254,172.00	0.09
477	002321	华英农业	106,700	253,946.00	0.09
478	300236	上海新阳	7,200	253,584.00	0.09
479	600298	安琪酵母	7,200	253,296.00	0.09
480	688223	晶科能源	28,475	252,288.50	0.09
481	301028	东亚机械	21,500	252,195.00	0.09
482	603816	顾家家居	7,200	252,000.00	0.09
483	600255	鑫科材料	113,900	251,719.00	0.09
484	002557	洽洽食品	7,200	250,704.00	0.09
485	600287	江苏舜天	39,700	250,507.00	0.09
486	600546	山煤国际	14,300	250,393.00	0.09
487	300082	奥克股份	35,900	250,223.00	0.09
487	600755	厦门国贸	35,900	250,223.00	0.09
488	002456	欧菲光	28,700	249,977.00	0.09
489	002223	鱼跃医疗	7,200	248,976.00	0.09
490	002884	凌霄泵业	14,300	248,248.00	0.09
491	600119	长江投资	35,900	246,992.00	0.08
492	600843	上工申贝	43,100	246,532.00	0.08
493	600115	中国东航	63,400	245,992.00	0.08
494	002299	圣农发展	14,300	245,674.00	0.08
495	601155	新城控股	21,500	245,315.00	0.08
496	000728	国元证券	35,900	245,197.00	0.08

497	002410	广联达	14,300	245,102.00	0.08
498	002601	龙佰集团	14,300	244,959.00	0.08
499	000608	阳光股份	85,000	244,800.00	0.08
500	002054	德美化工	35,900	244,120.00	0.08
501	300146	汤臣倍健	14,300	243,529.00	0.08
502	300168	万达信息	28,700	243,376.00	0.08
503	002718	友邦吊顶	14,300	243,243.00	0.08
504	688126	沪硅产业	14,037	243,120.84	0.08
505	600505	西昌电力	28,600	242,814.00	0.08
506	002001	新和成	14,300	242,528.00	0.08
507	600824	益民集团	63,300	242,439.00	0.08
508	300717	华信新材	14,300	240,097.00	0.08
509	002429	兆驰股份	43,000	239,940.00	0.08
510	002155	湖南黄金	21,500	239,510.00	0.08
511	600515	海南机场	64,700	239,390.00	0.08
512	600155	华创阳安	28,700	239,358.00	0.08
513	601005	重庆钢铁	171,500	238,385.00	0.08
514	603600	永艺股份	21,500	237,360.00	0.08
515	001332	锡装股份	7,200	236,520.00	0.08
516	600009	上海机场	7,200	236,016.00	0.08
517	600160	巨化股份	14,300	235,807.00	0.08
518	600881	亚泰集团	120,900	235,755.00	0.08
519	002294	信立泰	7,200	235,152.00	0.08
520	603181	皇马科技	21,500	234,995.00	0.08
521	002650	加加食品	57,500	234,600.00	0.08
522	000516	国际医学	28,700	232,757.00	0.08
523	603818	曲美家居	43,100	232,740.00	0.08
524	002263	大东南	92,200	232,344.00	0.08
525	000630	铜陵有色	70,700	231,896.00	0.08
526	002663	普邦股份	128,100	231,861.00	0.08
527	300932	三友联众	14,240	231,827.20	0.08
528	000021	深科技	14,300	231,803.00	0.08
529	603027	千禾味业	14,300	231,231.00	0.08
530	600732	爱旭股份	13,100	231,084.00	0.08
531	603813	原尚股份	14,300	230,945.00	0.08
532	300388	节能国祯	35,900	230,837.00	0.08
533	603385	惠达卫浴	28,700	229,887.00	0.08
534	600321	正源股份	128,300	229,657.00	0.08
535	601990	南京证券	28,700	229,026.00	0.08
536	600859	王府井	14,300	228,371.00	0.08
537	600790	轻纺城	57,500	228,275.00	0.08
538	002832	比音勒芬	7,200	228,240.00	0.08
539	002572	索菲亚	14,300	228,085.00	0.08

540	605100	华丰股份	14,300	227,513.00	0.08
541	002495	佳隆股份	70,700	226,240.00	0.08
542	000818	航锦科技	7,200	225,936.00	0.08
543	001206	依依股份	14,300	225,654.00	0.08
544	600516	方大炭素	43,000	225,320.00	0.08
545	601336	新华保险	7,200	224,136.00	0.08
546	603993	洛阳钼业	43,100	224,120.00	0.08
547	002127	南极电商	57,500	223,675.00	0.08
548	002986	宇新股份	14,300	223,080.00	0.08
548	600096	云天化	14,300	223,080.00	0.08
549	600161	天坛生物	7,200	222,768.00	0.08
550	300669	沪宁股份	14,275	222,547.25	0.08
551	002493	荣盛石化	21,500	222,525.00	0.08
552	603511	爱慕股份	14,300	221,364.00	0.08
553	601788	光大证券	14,300	220,506.00	0.08
554	600705	中航产融	70,600	219,566.00	0.08
555	603488	展鹏科技	21,500	219,515.00	0.08
556	002092	中泰化学	35,900	218,990.00	0.08
557	601186	中国铁建	28,700	218,407.00	0.08
558	688280	精进电动	28,475	218,403.25	0.08
559	301088	戎美股份	14,300	217,789.00	0.07
560	600497	驰宏锌锗	43,000	217,150.00	0.07
561	601233	桐昆股份	14,300	216,359.00	0.07
562	600674	川投能源	14,300	216,216.00	0.07
563	002532	天山铝业	35,900	215,759.00	0.07
564	000830	鲁西化工	21,500	215,645.00	0.07
565	000034	神州数码	7,200	215,352.00	0.07
566	600754	锦江酒店	7,200	215,280.00	0.07
567	600926	杭州银行	21,500	215,215.00	0.07
568	002261	拓维信息	14,300	215,072.00	0.07
569	688655	迅捷兴	14,237	214,978.70	0.07
570	300777	中简科技	7,200	214,776.00	0.07
571	600583	海油工程	35,900	213,246.00	0.07
572	300596	利安隆	7,200	212,832.00	0.07
573	300628	亿联网络	7,200	212,760.00	0.07
574	600963	岳阳林纸	35,900	211,451.00	0.07
575	601872	招商轮船	35,900	211,092.00	0.07
576	002648	卫星化学	14,300	210,925.00	0.07
577	601669	中国电建	43,100	210,759.00	0.07
578	000683	远兴能源	35,900	210,733.00	0.07
579	002430	杭氧股份	7,200	210,312.00	0.07
580	600415	小商品城	28,700	210,084.00	0.07
581	000626	远大控股	28,700	209,510.00	0.07

582	605183	确成股份	14,300	209,209.00	0.07
583	600399	抚顺特钢	21,500	208,980.00	0.07
584	300759	康龙化成	7,200	208,656.00	0.07
585	300891	惠云钛业	21,500	208,550.00	0.07
586	301189	奥尼电子	7,200	208,152.00	0.07
587	300509	新美星	28,700	207,501.00	0.07
588	688038	中科通达	14,397	207,460.77	0.07
589	002372	伟星新材	14,300	206,921.00	0.07
590	601919	中远海控	21,500	205,970.00	0.07
591	600873	梅花生物	21,500	205,325.00	0.07
592	600725	云维股份	70,600	204,740.00	0.07
593	300438	鹏辉能源	7,200	203,688.00	0.07
594	300012	华测检测	14,300	203,060.00	0.07
595	002353	杰瑞股份	7,200	202,392.00	0.07
596	600872	中炬高新	7,200	202,320.00	0.07
597	300166	东方国信	21,500	202,100.00	0.07
598	000998	隆平高科	14,300	201,630.00	0.07
599	603000	人民网	7,200	201,456.00	0.07
600	003008	开普检测	7,200	200,952.00	0.07
601	600970	中材国际	21,500	200,810.00	0.07
602	002670	国盛金控	21,500	200,380.00	0.07
603	002229	鸿博股份	7,200	200,160.00	0.07
604	000831	中国稀土	7,200	199,224.00	0.07
605	000410	沈阳机床	28,700	199,178.00	0.07
606	300720	海川智能	14,300	198,913.00	0.07
607	600426	华鲁恒升	7,200	198,648.00	0.07
608	600170	上海建工	84,700	198,198.00	0.07
609	002831	裕同科技	7,200	198,072.00	0.07
610	600433	冠豪高新	57,100	197,566.00	0.07
611	002264	新华都	35,800	197,258.00	0.07
612	002306	中科云网	33,800	197,054.00	0.07
613	601636	旗滨集团	28,700	196,308.00	0.07
614	300601	康泰生物	7,200	195,480.00	0.07
615	603098	森特股份	14,300	194,623.00	0.07
616	300824	北鼎股份	21,500	194,145.00	0.07
617	603517	绝味食品	7,200	193,392.00	0.07
618	002183	怡亚通	43,100	193,088.00	0.07
619	000703	恒逸石化	28,700	192,864.00	0.07
620	000980	众泰汽车	64,600	192,508.00	0.07
621	300699	光威复材	7,200	192,024.00	0.07
622	603755	日辰股份	7,200	191,376.00	0.07
623	001217	华尔泰	13,500	190,620.00	0.07
624	000893	亚钾国际	7,200	188,928.00	0.06

625	600905	三峡能源	43,100	188,347.00	0.06
626	600358	国旅联合	35,900	188,116.00	0.06
627	603588	高能环境	28,700	187,698.00	0.06
628	002472	双环传动	7,200	187,344.00	0.06
629	300339	润和软件	7,200	187,056.00	0.06
630	001216	华瓷股份	14,300	186,615.00	0.06
631	000729	燕京啤酒	21,500	185,545.00	0.06
632	002972	科安达	14,300	184,899.00	0.06
633	601818	光大银行	63,500	184,150.00	0.06
634	603408	建霖家居	14,300	183,612.00	0.06
635	002673	西部证券	28,700	182,819.00	0.06
636	605378	野马电池	7,200	182,376.00	0.06
637	000565	渝三峡 A	28,600	180,466.00	0.06
638	600196	复星医药	7,200	180,216.00	0.06
639	600722	金牛化工	35,900	179,141.00	0.06
640	002568	百润股份	7,200	177,192.00	0.06
641	605389	长龄液压	6,600	176,616.00	0.06
642	300923	研奥股份	7,200	176,544.00	0.06
643	600233	圆通速递	14,300	175,747.00	0.06
644	603500	祥和实业	14,300	175,175.00	0.06
645	600026	中远海能	14,300	175,032.00	0.06
646	600182	S 佳通	11,800	174,876.00	0.06
647	605303	园林股份	14,300	174,460.00	0.06
648	603456	九洲药业	7,200	174,312.00	0.06
649	300054	鼎龙股份	7,200	174,240.00	0.06
650	000545	金浦钛业	57,400	173,922.00	0.06
651	001201	东瑞股份	7,200	173,808.00	0.06
652	301019	宁波色母	7,200	173,016.00	0.06
653	300422	博世科	28,700	171,913.00	0.06
654	002734	利民股份	21,500	171,355.00	0.06
655	600084	中葡股份	21,500	168,990.00	0.06
656	000786	北新建材	7,200	168,192.00	0.06
657	000803	山高环能	28,700	166,747.00	0.06
658	603077	和邦生物	70,600	166,616.00	0.06
659	300285	国瓷材料	7,200	166,464.00	0.06
660	000504	南华生物	14,300	165,880.00	0.06
661	600585	海螺水泥	7,200	162,432.00	0.06
662	300641	正丹股份	28,700	161,868.00	0.06
663	605589	圣泉集团	7,200	161,136.00	0.06
664	600039	四川路桥	21,500	161,035.00	0.06
665	002346	柘中股份	14,300	159,445.00	0.05
666	600359	新农开发	21,500	159,315.00	0.05
667	603613	国联股份	7,200	158,472.00	0.05

668	301020	密封科技	7,200	156,456.00	0.05
669	300196	长海股份	14,300	155,584.00	0.05
670	301000	肇民科技	7,200	153,792.00	0.05
671	605077	华康股份	7,100	153,644.00	0.05
672	600371	万向德农	14,300	153,439.00	0.05
673	002040	南京港	21,500	153,295.00	0.05
674	600097	开创国际	14,300	152,867.00	0.05
675	601998	中信银行	28,700	151,823.00	0.05
676	600628	新世界	21,500	150,715.00	0.05
677	301002	崧盛股份	7,200	149,328.00	0.05
678	002672	东江环保	28,700	147,231.00	0.05
679	301032	新柴股份	14,300	144,859.00	0.05
680	300070	碧水源	28,700	143,213.00	0.05
681	600176	中国巨石	14,300	140,569.00	0.05
682	600895	张江高科	7,200	138,960.00	0.05
683	601916	浙商银行	54,500	137,340.00	0.05
684	000301	东方盛虹	14,300	137,280.00	0.05
685	600827	百联股份	14,300	135,707.00	0.05
686	603217	元利科技	7,200	131,328.00	0.05
687	300464	星徽股份	21,500	129,430.00	0.04
688	600955	维远股份	7,100	127,445.00	0.04
689	300867	圣元环保	7,200	114,840.00	0.04
690	603970	中农立华	7,200	110,592.00	0.04

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301526	国际复材	2,707	12,046.15	0.00
2	301566	达利凯普	458	10,140.12	0.00
3	301413	安培龙	107	6,226.33	0.00
4	301578	辰奕智能	85	5,807.20	0.00
5	601096	宏盛华源	1,284	5,213.04	0.00
6	301459	丰茂股份	109	4,342.56	0.00
7	603004	鼎龙科技	90	2,807.10	0.00
8	603373	安邦护卫	74	2,571.50	0.00
9	001239	永达股份	128	2,549.76	0.00
10	835185	贝特瑞	100	2,291.00	0.00
11	001358	兴欣新材	51	2,252.16	0.00
12	603231	索宝蛋白	61	1,313.33	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	28,380,984.16	9.75
2	300750	宁德时代	11,205,168.71	3.85
3	601318	中国平安	8,021,597.00	2.76
4	000858	五粮液	6,217,637.00	2.14
5	300760	迈瑞医疗	5,685,842.00	1.95
6	000333	美的集团	5,300,745.94	1.82
7	688012	中微公司	5,251,900.20	1.80
8	002594	比亚迪	4,606,714.00	1.58
9	000568	泸州老窖	4,276,100.00	1.47
10	300059	东方财富	3,972,363.00	1.36
11	600809	山西汾酒	3,927,276.00	1.35
12	002475	立讯精密	3,893,856.03	1.34
13	600276	恒瑞医药	3,816,911.00	1.31
14	002415	海康威视	3,605,303.00	1.24
15	601899	紫金矿业	3,291,684.00	1.13
16	601166	兴业银行	3,289,770.00	1.13
17	600030	中信证券	3,232,259.00	1.11
18	000725	京东方 A	3,142,511.00	1.08
19	600900	长江电力	3,113,699.00	1.07
20	601012	隆基绿能	2,996,138.00	1.03

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	300750	宁德时代	7,436,421.00	2.55
2	000858	五粮液	4,056,016.00	1.39
3	300760	迈瑞医疗	3,636,934.70	1.25
4	000333	美的集团	3,399,425.00	1.17
5	002594	比亚迪	3,074,662.00	1.06
6	000568	泸州老窖	2,787,067.00	0.96
7	300059	东方财富	2,619,682.00	0.90
8	002475	立讯精密	2,542,470.00	0.87
9	002415	海康威视	2,372,647.00	0.82
10	000725	京东方 A	2,078,349.00	0.71
11	000651	格力电器	1,736,190.00	0.60
12	300124	汇川技术	1,631,296.00	0.56

13	002142	宁波银行	1,607,808.40	0.55
14	002714	牧原股份	1,437,369.00	0.49
15	300498	温氏股份	1,414,729.00	0.49
16	000063	中兴通讯	1,393,798.00	0.48
17	002027	分众传媒	1,245,715.00	0.43
18	002230	科大讯飞	1,233,716.60	0.42
19	000001	平安银行	1,223,428.00	0.42
20	300014	亿纬锂能	1,219,381.00	0.42

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	713,502,115.94
卖出股票收入（成交）总额	250,792,159.07

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	40,101.69	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,101.69	0.01

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111018	华康转债	290	29,000.89	0.01
2	127100	神码转债	111	11,100.80	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,286,862.18
2	应收清算款	507,384.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,794,247.09

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301526	国际复材	12,046.15	0.00	新股锁定期内
2	301566	达利凯普	10,140.12	0.00	新股锁定期内
3	301413	安培龙	6,226.33	0.00	新股锁定期内
4	301578	辰奕智能	5,807.20	0.00	新股锁定期内
5	601096	宏盛华源	5,213.04	0.00	新股锁定期内

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,511	198,160.82	237,955,098.00	79.47	61,465,902.00	20.53

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	BARCLAYS BANK PLC	25,088,400.00	8.38
2	中信建投证券有限责任公司	21,777,400.00	7.27
3	国泰君安证券股份有限公司	20,240,000.00	6.76
4	中国银河证券股份有限公司	18,143,300.00	6.06
5	民生通惠资管—工商银行—民生通惠量化选股3号资产管理产品	12,523,900.00	4.18
6	华泰柏瑞基金—农业银行—华泰柏瑞稳利1号集合资产管理计划	11,500,000.00	3.84
7	北京市(贰号)职业年金计划—农业银行	11,303,300.00	3.78
8	方正证券股份有限公司	10,679,700.00	3.57

9	上海东证期货有限公司	10,564,400.00	3.53
10	中泰期货股份有限公司	10,552,000.00	3.52

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年10月30日） 基金份额总额	635,421,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	168,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	504,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	299,421,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

基金管理人的重大人事变动：

2023年4月18日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 55,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 11 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	私募资产管理业务与投资顾问业务未能有效分离
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	2	576,734,467.87	59.83	543,123.59	64.55	-
华泰证券	5	287,015,290.64	29.78	268,616.93	31.93	-
方正证券	4	90,052,937.37	9.34	20,064.85	2.38	-
中信建投	2	7,763,787.68	0.81	7,344.61	0.87	-
广发证券	2	2,376,727.94	0.25	2,224.40	0.26	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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、上述交易单元均系本报告期内租用。

11.7.2 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(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

银河证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 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终止北京增财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	2023 年 12 月 26 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承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 23 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 23 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与贵州省贵文文化基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 16 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	2023 年 12 月 13 日
6	关于同意中信证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 29 日
7	关于同意方正证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 27 日
8	关于同意中国银河证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 10 日
9	关于同意广发证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 09 日
10	关于同意中信建投证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 08 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 08 日
12	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 07 日
13	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 07 日

14	关于同意招商证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 07 日
15	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 02 日
16	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 02 日
17	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 10 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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 3 月 30 日