

# 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 期证券投资基金 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：中国工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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 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             | 13        |
| 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                 | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 15        |
| 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        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 净资产变动表                              | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 23        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>50</b> |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 50        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 50        |
| 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 .....     | 50        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 50        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 50        |
| 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 .....    | 51        |
| 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 ..... | 51        |
| 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 ..... | 51        |
| 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 .....    | 51        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 51        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 51        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 52        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>52</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 52        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 53        |
| 9.3 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 .....      | 53        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>53</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 53        |
| 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 .....      | 53        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 53        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 54        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 54        |
| 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 .....         | 54        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 54        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>58</b> |
| 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 .....    | 58        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 59        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>59</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 59        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 59        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                |
|------------|--------------------------------|
| 基金名称       | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称       | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期       |
| 基金主代码      | 015863                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                         |
| 基金合同生效日    | 2022 年 6 月 16 日                |
| 基金管理人      | 华泰柏瑞基金管理有限公司                   |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司                   |
| 报告期末基金份额总额 | 1,605,569,069.79 份             |
| 基金合同存续期    | 不定期                            |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。   |
| 投资策略   | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%   |
| 风险收益特征 | 本基金预期的收益与风险低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。                           |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人                             | 基金托管人                      |
|-------------|-----------------------------------|----------------------------|
| 名称          | 华泰柏瑞基金管理有限公司                      | 中国工商银行股份有限公司               |
| 信息披露<br>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                      | 95588                      |
| 传真          | 021-38601799                      | 010-66105798               |
| 注册地址        | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号          |
| 办公地址        | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号          |
| 邮政编码        | 200135                            | 100140                     |
| 法定代表人       | 贾波                                | 陈四清                        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                               |
|---------------------|-------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报                         |
| 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<br>(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<br>2 座普华永道中心 11 楼 |
| 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 弄上海证大五道<br>口广场 1 号 17 层   |

## § 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           | 2022 年 6 月 16 日 (基金合同生效日)<br>-2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|--|
| 本期已实现收益       | 20,596,066.36    | 29,062,501.94                                  |
| 本期利润          | 23,003,848.42    | 29,015,269.61                                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0268           | 0.0094   |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.62%            | 0.93%  |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.51%            | 0.91%  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末          | 2022 年末  |
| 期末可供分配利润      | 52,556,868.10    | 11,859,224.54                                  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0327           | 0.0086   |
| 期末基金资产净值      | 1,660,829,907.13 | 1,395,499,344.25                               |
| 期末基金份额净值      | 1.0344           | 1.0091   |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2023 年末          | 2022 年末  |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.44%            | 0.91%  |

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

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

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

低数。

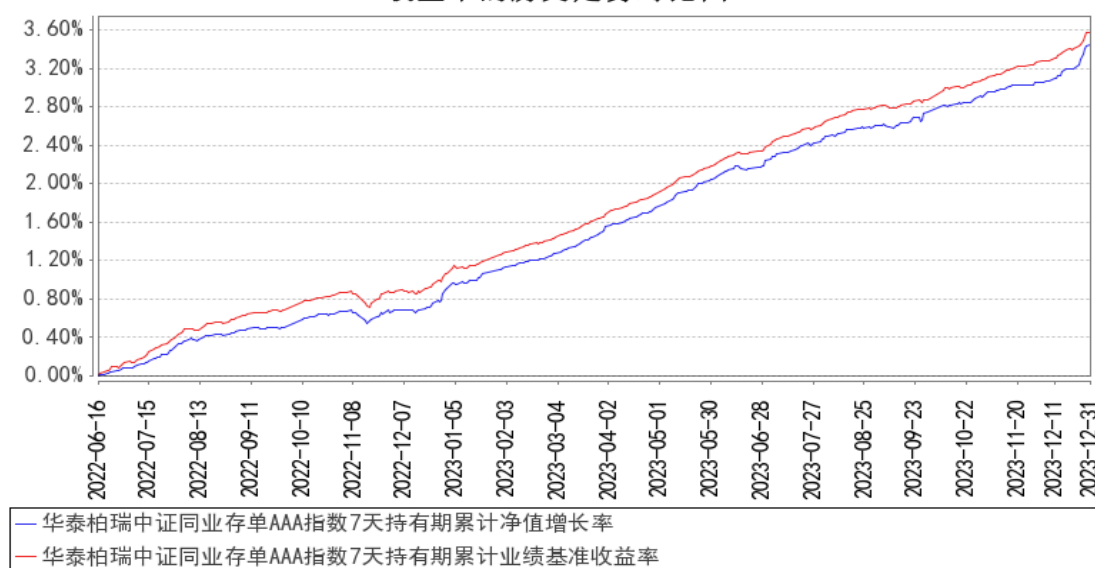
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.68%    | 0.02%       | 0.68%      | 0.02%         | 0.00%  | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.17%    | 0.01%       | 1.16%      | 0.01%         | 0.01%  | 0.00% |
| 过去一年       | 2.51%    | 0.01%       | 2.48%      | 0.01%         | 0.03%  | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.44%    | 0.01%       | 3.57%      | 0.01%         | -0.13% | 0.00% |

#### 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

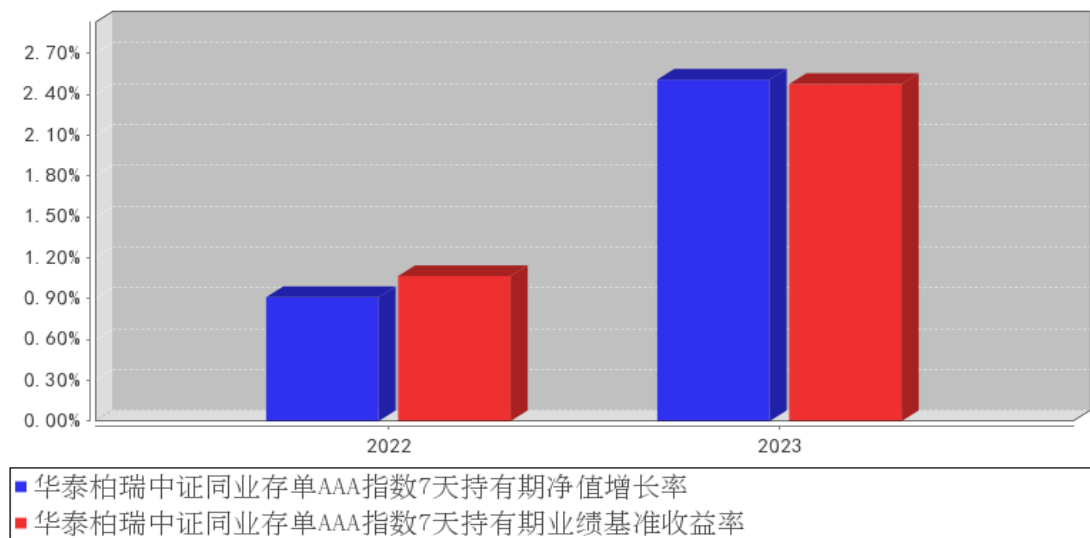
华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2022 年 6 月 16 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 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

华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为 2022 年 6 月 16 日，2022 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            |        |  |
| 姬青 | 本基金的基金经理           | 2023 年 8 月 21 日 | -               | 7 年    | 北京大学企业管理专业硕士。曾任海通证券股份有限公司管理培训生。2017 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任交易部交易员、固定收益部基金经理助理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 8 月起任华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。 |
| 郑青 | 固定收益部联席总监、本基金的基金经理 | 2022 年 6 月 16 日 | 2023 年 8 月 21 日 | 18 年   | 经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司，2008 年 3 月至 2010 年 4 月任中海基金管理有限公司交易员，2010 年加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任固定收益部联席总监。2012 年 6 月起任华泰柏瑞货币市场证券投  |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>资基金基金经理，2013 年 7 月至 2017 年 11 月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起任华泰柏瑞交易型货币市场基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月至 2022 年 12 月任华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2021 年 12 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月起任华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月起任华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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

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

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。

#### 4.3.3 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 年宏观经济呈现波浪式运行，货币市场利率整体呈现宽幅震荡走势。一季度，疫后消费快速复苏，稳增长政策接连落地，资金利率也从较低水平逐渐向政策利率回归，1 年期同业存单利率上行至 2.75% 的年内高位；3 月开始至 8 月下旬，经济基本面复苏不及预期，资金面边际宽松，加之央行两次降息，推动 1 年期存单利率下行至低位 2.22%；8 月下旬以后，信贷投放边际上有所修复，房地产政策放松带动宽信用预期，四季度政府债放量供给、稳汇率压力叠加央行对“防空转”的关注，使得资金面呈现紧平衡态势。年底银行面临流动性指标压力、资本新规实施在即以及货币基金面临赎回的不确定性，使得同业存单的供求关系恶化，1 年期同业存单利率一路上行至 2.68%，12 月下旬受存款利率降息及资金面转松的影响，存单利率快速下行至 2.40%。

本基金密切跟踪资金面的边际变化，灵活控制组合久期和杠杆，积极把握市场交易机会，力求在严格控制回撤的前提下不断提升组合收益。

#### 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 1.0344 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.51%，业绩比较基准收益率为 2.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济增长的抓手仍不明确，基本面仍面临有效需求不足的问题，货币政策预计维持灵活适度、精准有效的基调，资金预计维持平衡偏松水平，1 年期 MLF 利率仍然是存单利率重要的锚。除此之外，受资本新规实施的影响，作为同业存单配置主力之一的货币基金负债端不稳定性提升，同业存单的季节性波动可能加大。华泰柏瑞存单指数基金将保持组合的高流动性，结合市场情况及时对久期和杠杆进行调整，努力把握交易机会。

#### 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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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 22197 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         | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度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中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度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中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合基金,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>华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合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中</p>   |



|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合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算华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合基金、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中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合基金的财务报告过程。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <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，就可能对华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合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中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期混合基金不能持续经营。</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> |
| <p>会计师事务所的名称</p>       | <p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>  |
| <p>注册会计师的姓名</p>        | <p>单峰   胡莲莲</p>  |
| <p>会计师事务所的地址</p>       | <p>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</p>  |
| <p>审计报告日期</p>          | <p>2024 年 3 月 28 日</p>   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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<br>2023 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 7.4.7.1    | 2,691,329.17                    | 253,978.63                       |
| 结算备付金         |            | -                               | -                                |
| 存出保证金         |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 1,729,172,546.39                | 1,687,443,927.22                 |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 1,729,172,546.39                | 1,687,443,927.22                 |
| 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         |            | -                               | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 260,641,931.41                  | 5,324,937.35                     |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 1,992,505,806.97                | 1,693,022,843.20                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2022 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        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 330,988,914.02                  | 296,737,244.24                   |
| 应付清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |

|             |          |                  |                  |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬     |          | 186,076.16       | 246,357.79       |
| 应付托管费       |          | 46,519.07        | 61,589.44        |
| 应付销售服务费     |          | 186,076.16       | 246,357.79       |
| 应付投资顾问费     |          | -                | -                |
| 应交税费        |          | 13,098.74        | 15,537.41        |
| 应付利润        |          | -                | -                |
| 递延所得税负债     |          | -                | -                |
| 其他负债        | 7.4.7.9  | 255,215.69       | 216,412.28       |
| 负债合计        |          | 331,675,899.84   | 297,523,498.95   |
| <b>净资产：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 1,605,569,069.79 | 1,382,978,911.90 |
| 其他综合收益      | 7.4.7.11 | -                | -                |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | 55,260,837.34    | 12,520,432.35    |
| 净资产合计       |          | 1,660,829,907.13 | 1,395,499,344.25 |
| 负债和净资产总计    |          | 1,992,505,806.97 | 1,693,022,843.20 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0344 元，基金份额总额 1,605,569,069.79 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 6 月 16 日（基金<br>合同生效日）至 2022 年<br>12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 30,971,447.43                             | 41,585,396.57  |
| 1. 利息收入               |          | 21,270.32                                 | 8,748,385.60   |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.13 | 8,975.91                                  | 5,085,451.42   |
| 债券利息收入                |          | -   | -  |
| 资产支持证券利息<br>收入        |          | -   | -  |
| 买入返售金融资产<br>收入        |          | 12,294.41                                 | 3,662,934.18   |
| 其他利息收入                |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列） |          | 28,542,395.05                             | 32,884,243.30  |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.14 | -   | -  |
| 基金投资收益                |          | -   | -  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.15 | 28,542,395.05                             | 32,884,243.30  |
| 资产支持证券投资<br>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   | -             | -             |
| 股利收益                       | 7.4.7.19   | -             | -             |
| 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   | 2,407,782.06  | -47,232.33    |
| 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   | -             | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 7,967,599.01  | 12,570,126.96 |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 1,752,845.01  | 3,343,590.16  |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -             | -             |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 438,211.37    | 835,897.53    |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 1,752,845.01  | 3,343,590.16  |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 3,738,357.68  | 4,805,663.29  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 3,738,357.68  | 4,805,663.29  |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 13,603.06     | 30,397.15     |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 271,736.88    | 210,988.67    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 23,003,848.42 | 29,015,269.61 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 23,003,848.42 | 29,015,269.61 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 23,003,848.42 | 29,015,269.61 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023 年 1 月 1 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 | 1,382,978,911.                         | -      | 12,520,432.35 | 1,395,499,344.2 |

|  |  |        |                |                   |
|--|--|--------|----------------|-------------------|
|  | 90   |        |                | 5                 |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -              | -                 |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -              | -                 |
| 其他                                       | -  | -      | -              | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,382,978,911.90                           | -      | 12,520,432.35  | 1,395,499,344.25  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 222,590,157.89                             | -      | 42,740,404.99  | 265,330,562.88    |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | 23,003,848.42  | 23,003,848.42     |
| (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)      | 222,590,157.89                             | -      | 19,736,556.57  | 242,326,714.46    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 3,578,331,924.27                           | -      | 93,165,021.04  | 3,671,496,945.31  |
| 2. 基金赎回款                                 | -3,355,741,766.38                          | -      | -73,428,464.47 | -3,429,170,230.85 |
| (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                                | 1,605,569,069.79                           | -      | 55,260,837.34  | 1,660,829,907.13  |
| 项目                                       | 上年度可比期间                                    |        |                |                   |
|  | 2022 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 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                                | 5,388,860,750.13  | - | -              | 5,388,860,750.13  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -4,005,881,838.23 | - | 12,520,432.35  | -3,993,361,405.88 |
| (一)、综合收益总额                               | -                 | - | 29,015,269.61  | 29,015,269.61     |
| (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)      | -4,005,881,838.23 | - | -16,494,837.26 | -4,022,376,675.49 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,282,081,796.30  | - | 6,973,934.45   | 1,289,055,730.75  |
| 2. 基金赎回款                                 | -5,287,963,634.53 | - | -23,468,771.71 | -5,311,432,406.24 |
| (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                                | 1,382,978,911.90  | - | 12,520,432.35  | 1,395,499,344.25  |

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

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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[2022]1030 号《关于准予华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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《华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 5,387,902,768.47 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(2022)第 0433 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》于 2022 年 6 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,388,860,750.13 份基金份额,其中认购资金利息折合 957,981.66 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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券和备选成份券为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金还可以投资于非属成份券和备选成份券的其他同业存单、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持债券、政府支持机构债券等)、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、现金等货币市场工具等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)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:同业存单的比例不低于基金资产的 80%;本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率(税后) $\times$ 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 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》、《华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 年度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 年度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。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 6 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业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。

## (2) 金融负债

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

### 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

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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净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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损

益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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：

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[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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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              | 上年度末             |
|----------------|------------------|------------------|
|                | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
| 活期存款           | 2,691,329.17     | 253,978.63       |
| 等于：本金          | 2,691,235.44     | 253,950.07       |
| 加：应计利息         | 93.73            | 28.56            |
| 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             | 2,691,329.17     | 253,978.63       |

##### 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            | -                | -         | -             | -        |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -         | -             | -        |
| 债券            |                  |           |               |          |
| 交易所市场         | 12,020,400.00    | 51,419.18 | 12,077,819.18 | 6,000.00 |

|    |                          |                  |               |                  |              |
|----|--------------------------|------------------|---------------|------------------|--------------|
|    | 银行间市场                    | 1,704,466,450.27 | 10,273,727.21 | 1,717,094,727.21 | 2,354,549.73 |
|    | 合计                       | 1,716,486,850.27 | 10,325,146.39 | 1,729,172,546.39 | 2,360,549.73 |
|    | 资产支持证券                   | -                | -             | -                | -            |
|    | 基金                       | -                | -             | -                | -            |
|    | 其他                       | -                | -             | -                | -            |
|    | 合计                       | 1,716,486,850.27 | 10,325,146.39 | 1,729,172,546.39 | 2,360,549.73 |
| 项目 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                  |               |                  |              |
|    |                          | 成本               | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动       |
|    | 股票                       | -                | -             | -                | -            |
|    | 贵金属投资-金交所黄金合约            | -                | -             | -                | -            |
| 债券 | 交易所市场                    | -                | -             | -                | -            |
|    | 银行间市场                    | 1,672,855,232.33 | 14,635,927.22 | 1,687,443,927.22 | -47,232.33   |
|    | 合计                       | 1,672,855,232.33 | 14,635,927.22 | 1,687,443,927.22 | -47,232.33   |
|    | 资产支持证券                   | -                | -             | -                | -            |
|    | 基金                       | -                | -             | -                | -            |
|    | 其他                       | -                | -             | -                | -            |
|    | 合计                       | 1,672,855,232.33 | 14,635,927.22 | 1,687,443,927.22 | -47,232.33   |

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 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      | 65,215.69               | 56,412.28                |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 65,215.69               | 56,412.28                |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 190,000.00              | 160,000.00               |
| 合计          | 255,215.69              | 216,412.28               |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |      |
|----|--|------|
|    | 基金份额（份）                                | 账面金额 |
|    |  |      |



|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末          | 1,382,978,911.90  | 1,382,978,911.90  |
| 本期申购          | 3,578,331,924.27  | 3,578,331,924.27  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,355,741,766.38 | -3,355,741,766.38 |
| 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           | 1,605,569,069.79  | 1,605,569,069.79  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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       |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末           | 11,859,224.54 | 661,207.81   | 12,520,432.35 |
| 加：会计政策变更       | -             | -            | -             |
| 前期差错更正         | -             | -            | -             |
| 其他             | -             | -            | -             |
| 本期期初           | 11,859,224.54 | 661,207.81   | 12,520,432.35 |
| 本期利润           | 20,596,066.36 | 2,407,782.06 | 23,003,848.42 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 20,101,577.20 | -365,020.63  | 19,736,556.57 |
| 其中：基金申购        | 91,364,306.17 | 1,800,714.87 | 93,165,021.04 |

|         |                |               |                |
|---------|----------------|---------------|----------------|
| 款       |                |               |                |
| 金赎回款    | -71,262,728.97 | -2,165,735.50 | -73,428,464.47 |
| 本期已分配利润 | -              | -             | -              |
| 本期末     | 52,556,868.10  | 2,703,969.24  | 55,260,837.34  |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年6月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 2,174.35                    | 5,061,583.85                               |
| 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 | 4.50                        | 23,343.19                                  |
| 其他        | 6,797.06                    | 524.38                                     |
| 合计        | 8,975.91                    | 5,085,451.42                               |

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——买卖股票差价收入。

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——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<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年6月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|----------------------|-----------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入         | 27,101,771.80               | 37,436,620.66                              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到 | 1,440,623.25                | -4,552,377.36                              |

|                    |               |               |
|--------------------|---------------|---------------|
| 期兑付) 差价收入          |               |               |
| 债券投资收益——赎回<br>差价收入 |               |               |
| 债券投资收益——申购<br>差价收入 |               |               |
| 合计                 | 28,542,395.05 | 32,884,243.30 |

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2022年6月16日（基金合同生<br>效日）至2022年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 9,041,612,922.98                | 11,685,333,410.66                              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 8,955,254,713.10                | 11,574,819,521.51                              |
| 减：应计利息总额               | 84,822,661.63                   | 114,957,766.51                                 |
| 减：交易费用                 | 94,925.00                       | 108,500.00                                     |
| 买卖债券差价收入               | 1,440,623.25                    | -4,552,377.36                                  |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 6 月 16 日(基金合<br>同生效日)至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|----------------------------|---|--|
| 1. 交易性金融资产                 | 2,407,782.06                              | -47,232.33   |
| 股票投资                       | -   | -  |
| 债券投资                       | 2,407,782.06                              | -47,232.33   |
| 资产支持证券投资                   | -   | -  |
| 基金投资                       | -   | -  |
| 贵金属投资                      | -   | -  |
| 其他                         | -   | -  |
| 2. 衍生工具                    | -   | -  |
| 权证投资                       | -   | -  |
| 3. 其他                      | -   | -  |
| 减：应税金融商品公允价值<br>变动产生的预估增值税 | -   | -  |
| 合计                         | 2,407,782.06                              | -47,232.33   |

#### 7.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 6 月 16 日（基金合同生效日）<br>至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------|--|---|
| 审计费用     | 70,000.00                              | 100,000.00  |
| 信息披露费    | 120,000.00                             | 60,000.00   |
| 证券出借违约金  | -                                      | -   |
| 银行间账户服务费 | 36,180.00                              | 9,300.00  |
| 银行划款手续费  | 45,556.88                              | 41,688.67   |
| 合计       | 271,736.88                             | 210,988.67  |

#### 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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）    | 基金托管人、基金销售机构          |
| 华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）        | 基金管理人的股东、基金销售机构       |
| 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

#### 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,752,845.01                           | 3,343,590.16  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 844,892.35                             | 1,615,833.36  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 907,952.66                             | 1,727,756.80  |

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 0.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 438,211.37                             | 835,897.53  |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.3 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                       |
|                | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期               |
| 中国工商银行股份有限公司   | 1,309,679.57                           |
| 华泰证券股份有限公司     | 3,632.52                               |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司   | 6,662.06                               |
| 合计             | 1,319,974.15                           |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                                    |  |
|----------------|--|--|
|                | 2022 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |  |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |  |
|                | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期                   |  |
| 中国工商银行股份有限公司   | 2,871,431.28                               |  |
| 华泰证券股份有限公司     | 6,576.47                                   |  |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司   | 2,033.29                                   |  |
| 合计             | 2,880,041.04                               |  |

注：本基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，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。

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间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。

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间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。

##### 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：本基金本报告期及上年度可比期间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。

#### 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：本报告期及上年度，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。

#### 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月<br>31 日 |          | 上年度可比期间<br>2022年6月16日（基金合同生效日）至2022<br>年12月31日 |              |
|--------|---|----------|--|--------------|
|        | 期末余额                                      | 当期利息收入   | 期末余额   | 当期利息收入       |
| 中国工商银行 | 2,691,329.17                              | 2,174.35 | 253,978.63                                     | 5,061,583.85 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 500,000 张工商银行的同业存单，成本总额为人民币 49,604,096.31 元，估值总额为人民币 49,751,131.15 元，占基金净资产的比例为 3.00% (2022 年 12 月 31 日：无)。

#### 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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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的流通受限股票。

##### 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

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 330,988,914.02 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称             | 回购到期日             | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|------------------|-------------------|--------|---------|---------------|
| 112302035 | 23 工商银行<br>CD035 | 2024 年 1 月 2<br>日 | 99.50  | 500,000 | 49,751,131.15 |
| 112308078 | 23 中信银行<br>CD078 | 2024 年 1 月 2<br>日 | 99.34  | 500,000 | 49,668,211.48 |
| 112310313 | 23 兴业银行<br>CD313 | 2024 年 1 月 2<br>日 | 99.24  | 500,000 | 49,620,026.23 |
| 112311163 | 23 平安银行<br>CD163 | 2024 年 1 月 2<br>日 | 99.57  | 500,000 | 49,786,679.12 |
| 112317079 | 23 光大银行<br>CD079 | 2024 年 1 月 2<br>日 | 99.58  | 355,000 | 35,350,862.75 |



|           |                  |                   |        |           |                |
|-----------|------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 112320231 | 23 广发银行<br>CD231 | 2024 年 1 月 2<br>日 | 98.96  | 800,000   | 79,169,961.97  |
| 190404    | 19 农发 04         | 2024 年 1 月 2<br>日 | 102.96 | 95,000    | 9,781,020.91   |
| 210202    | 21 国开 02         | 2024 年 1 月 2<br>日 | 102.94 | 100,000   | 10,294,284.93  |
| 220332    | 22 进出 32         | 2024 年 1 月 2<br>日 | 100.42 | 100,000   | 10,042,000.00  |
| 230024    | 23 付息国债<br>24    | 2024 年 1 月 2<br>日 | 100.64 | 200,000   | 20,127,464.48  |
| 合计        |                  |                   |        | 3,650,000 | 363,591,643.02 |

#### 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：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

### 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

本基金为同业存单指数基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具为具有良好流动性的固定收益类品种。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

#### 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中国工商银行，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 99.10% (2022 年 12 月 31 日：115.12%)。

#### 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一方面来自于基金份额持有人可于约定持有期后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于最早约定持有期到期后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 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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》且于最早约定持有期到期后按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。

于最早约定持有期到期后，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<br>期<br>末<br>202<br>3 年<br>12<br>月<br>31<br>日 | 1 个月以内        | 1-3 个月         | 3 个月-1 年         | 1-<br>5<br>年 | 5<br>年<br>以<br>上 | 不计息            | 合计               |
|---|---------------|----------------|------------------|--------------|------------------|----------------|------------------|
| 资<br>产  |               |                |                  |              |                  |                |                  |
| 货<br>币<br>资<br>金                                | 2,691,329.17  | -              | -                | -            | -                | -              | 2,691,329.17     |
| 交<br>易<br>性<br>金<br>融<br>资<br>产                 | 80,608,417.19 | 439,483,147.69 | 1,209,080,981.51 | -            | -                | -              | 1,729,172,546.39 |
| 应<br>收<br>申<br>购<br>款                           | -             | -              | -                | -            | -                | 260,641,931.41 | 260,641,931.41   |
| 资<br>产<br>总<br>计                                | 83,299,746.36 | 439,483,147.69 | 1,209,080,981.51 | -            | -                | 260,641,931.41 | 1,992,505,806.97 |
| 负   |               |                |                  |              |                  |                |                  |

|           |                 |                |                  |  |  |                |                  |
|-----------|-----------------|----------------|------------------|--|--|----------------|------------------|
| 债         |                 |                |                  |  |  |                |                  |
| 应付管理人报酬   |                 |                |                  |  |  | 186,076.16     | 186,076.16       |
| 应付托管费     |                 |                |                  |  |  | 46,519.07      | 46,519.07        |
| 卖出回购金融资产款 | 330,988,914.02  |                |                  |  |  |                | 330,988,914.02   |
| 应付销售服务费   |                 |                |                  |  |  | 186,076.16     | 186,076.16       |
| 应交税费      |                 |                |                  |  |  | 13,098.74      | 13,098.74        |
| 其他负债      |                 |                |                  |  |  | 255,215.69     | 255,215.69       |
| 负债总计      | 330,988,914.02  |                |                  |  |  | 686,985.82     | 331,675,899.84   |
| 利率敏感      | -247,689,167.66 | 439,483,147.69 | 1,209,080,981.51 |  |  | 259,954,945.59 | 1,660,829,907.13 |

| 度<br>缺<br>口                                    |               |                |                  |       |       |              |                  |
|--|---------------|----------------|------------------|-------|-------|--------------|------------------|
| 上<br>年<br>度<br>末<br>202<br>2 年<br>12 月<br>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<br>产   |               |                |                  |       |       |              |                  |
| 货<br>币<br>资<br>金                               | 253,978.63    | -              | -                | -     | -     | -            | 253,978.63       |
| 交<br>易<br>性<br>金<br>融<br>资<br>产                | 51,010,643.84 | 239,416,298.24 | 1,397,016,985.14 | -     | -     | -            | 1,687,443,927.22 |
| 应<br>收<br>申<br>购<br>款                          | -             | -              | -                | -     | -     | 5,324,937.35 | 5,324,937.35     |
| 资<br>产<br>总<br>计                               | 51,264,622.47 | 239,416,298.24 | 1,397,016,985.14 | -     | -     | 5,324,937.35 | 1,693,022,843.20 |
| 负<br>债   |               |                |                  |       |       |              |                  |
| 应<br>付<br>管<br>理<br>人<br>报<br>酬                | -             | -              | -                | -     | -     | 246,357.79   | 246,357.79       |
| 应  | -             | -              | -                | -     | -     | 61,589.44    | 61,589.44        |

|   |                 |                |                  |   |   |              |                  |
|---|-----------------|----------------|------------------|---|---|--------------|------------------|
| 付<br>托<br>管<br>费                          |                 |                |                  |   |   |              |                  |
| 卖<br>出<br>回<br>购<br>金<br>融<br>资<br>产<br>款 | 296,737,244.24  | -              | -                | - | - | -            | 296,737,244.24   |
| 应<br>付<br>销<br>售<br>服<br>务<br>费           | -               | -              | -                | - | - | 246,357.79   | 246,357.79       |
| 应<br>交<br>税<br>费                          | -               | -              | -                | - | - | 15,537.41    | 15,537.41        |
| 其<br>他<br>负<br>债                          | -               | -              | -                | - | - | 216,412.28   | 216,412.28       |
| 负<br>债<br>总<br>计                          | 296,737,244.24  | -              | -                | - | - | 786,254.71   | 297,523,498.95   |
| 利<br>率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口           | -245,472,621.77 | 239,416,298.24 | 1,397,016,985.14 | - | - | 4,538,682.64 | 1,395,499,344.25 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |
|----|--------------------|
| 假设 | 除市场利率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）       | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点 | 1,945,329.97                | 1,665,163.85           |
|    | 市场利率上升 25 个基点 | -1,939,596.70               | -1,661,440.41          |

#### 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 1,729,172,546.39        | 1,687,443,927.22         |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 1,729,172,546.39        | 1,687,443,927.22         |

##### 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无第三层次公允价值余额及变动情况。

###### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

##### 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

##### 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

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              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,729,172,546.39 | 86.78         |
|    | 其中：债券             | 1,729,172,546.39 | 86.78         |
|    | 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      | 2,691,329.17     | 0.14          |
| 8  | 其他各项资产            | 260,641,931.41   | 13.08         |
| 9  | 合计                | 1,992,505,806.97 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 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。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 8.4.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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      | 32,205,283.66    | 1.94   |
| 2  | 央行票据      | -                | -      |
| 3  | 金融债券      | 51,030,660.79    | 3.07   |
|    | 其中：政策性金融债 | 51,030,660.79    | 3.07   |
| 4  | 企业债券      | -                | -      |
| 5  | 企业短期融资券   | 121,987,655.03   | 7.34   |
| 6  | 中期票据      | -                | -      |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | 1,523,948,946.91 | 91.76  |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 1,729,172,546.39 | 104.11 |

### 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  | 112312183 | 23 北京银行 CD183 | 1,000,000 | 98,863,354.10 | 5.95         |
| 2  | 112320231 | 23 广发银行 CD231 | 800,000   | 79,169,961.97 | 4.77         |
| 3  | 112306227 | 23 交通银行 CD227 | 800,000   | 78,657,229.51 | 4.74         |
| 4  | 112304064 | 23 中国银行 CD064 | 800,000   | 78,159,645.25 | 4.71         |
| 5  | 112373161 | 23 成都银行 CD239 | 700,000   | 69,255,064.59 | 4.17         |

### 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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，23 中国银行 CD064 的发行主体中国银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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 | -              |
| 2  | 应收清算款 | -              |
| 3  | 应收股利  | -              |
| 4  | 应收利息  | -              |
| 5  | 应收申购款 | 260,641,931.41 |
| 6  | 其他应收款 | -              |
| 7  | 待摊费用  | -              |
| 8  | 其他    | -              |
| 9  | 合计    | 260,641,931.41 |

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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 | 户均持有的 | 持有人结构 |
|-------|-------|-------|
|-------|-------|-------|

| (户)    | 基金份额      | 机构投资者          |            | 个人投资者            |            |
|--------|-----------|----------------|------------|------------------|------------|
|        |           | 持有份额           | 占总份额比例 (%) | 持有份额             | 占总份额比例 (%) |
| 21,700 | 73,989.36 | 112,846,611.33 | 7.03       | 1,492,722,458.46 | 92.97      |

### 9.2 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 | 623,149.99 | 0.0388       |

### 9.3 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                             | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发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 (2022 年 6 月 16 日) 基金份额总额 | 5,388,860,750.13 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 1,382,978,911.90 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 3,578,331,924.27 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 3,355,741,766.38 |
| 本报告期基金拆分变动份额                     | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 1,605,569,069.79 |

## § 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。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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 70,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 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 (%) |    |
| 爱建证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 安信证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 德邦证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东方证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东兴证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 方正证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 广发证券 | 6      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 国都证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 国泰君安 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 海通证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 华宝证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源       | 2 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金财富<br>证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | 3 | - | - | - | - | - |

注：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为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

### 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 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 |
|-----|------|--------|------|
|-----|------|--------|------|

| 称    | 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 (%) |
|------|--------------|------------------|------|--------------------|------|------------------|
| 爱建证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 安信证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 长江证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 德邦证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 东方证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 东兴证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 方正证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 广发证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 国都证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 国泰君安 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 海通证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 华宝证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 华泰证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 平安证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 瑞银证券 | 7,995,140.00 | 100.00           | -    | -                  | -    | -                |
| 山西证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 上海证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 申万宏源 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 湘财证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 兴业证券 | -            | -                | -    | -                  | -    | -                |



|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 银河证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 中金财<br>富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建<br>投   | - | - | - | - | - | - |
| 中信证<br>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  | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停转换转入公告           | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 12 月 27 日 |
| 2  | 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 |
| 3  | 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 |
| 4  | 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 |
| 5  | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停代销机构申购和转换转入业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 09 月 21 日 |
| 6  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富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 09 月 20 日 |
| 7  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止尚智逢源(北京)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 09 月 19 日 |
| 8  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止南京途牛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 09 月 07 日 |
| 9  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)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 09 月 07 日 |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下                 | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 09 月 07 日 |

|    |   |            |                  |
|----|---|------------|------------------|
|    | 基金相关业务公告  |            |                  |
| 11 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告     | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 08 月 22 日 |
| 12 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理变更的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 08 月 21 日 |
| 13 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通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 08 月 08 日 |
| 14 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通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 08 月 05 日 |
| 15 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海汇付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 07 月 12 日 |
| 16 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国人寿保险股份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 06 月 27 日 |
| 17 | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停转换转入公告                | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 06 月 20 日 |
| 18 | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停转换转入公告                | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 04 月 25 日 |
| 19 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                             | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 04 月 19 日 |
| 20 | 华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告                  | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 21 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与博时财富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 02 月 08 日 |
| 22 | 华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停代销机构转换转入业务的公告         | 证监会规定报刊和网站 | 2023 年 01 月 17 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日