

华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2025 年 3 月 28 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，安永华明会计师事务所（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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75
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	75
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	75
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	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	76
§ 9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末上市基金前十名持有人	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	78
§ 10 开放式基金份额变动	78
§ 11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
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	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8 其他重大事件	81
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 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	38,560,621.00 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	1、股票（含存托凭证）的投资策略 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，从而实现对标的指数的紧密跟踪。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。 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。 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
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 A 股指数收益率
风险收益特征	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。 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。

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	张姗
	联系电话	021-38601777	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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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	2024 年	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	-464,605.28	4,895,372.86
本期利润	10,702,186.28	682,103.66
加权平均基金份额本期利润	0.0739	0.0025
本期加权平均净值利润率	6.71%	0.26%
本期基金份额净值增长率	11.47%	-2.78%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	6,503,088.43	-8,338,676.66
期末可供分配基金份额利润	0.1686	-0.0278
期末基金资产净值	125,503,475.55	291,082,323.34

期末基金份额净值	3.2547	0.9722
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	8.37%	-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。

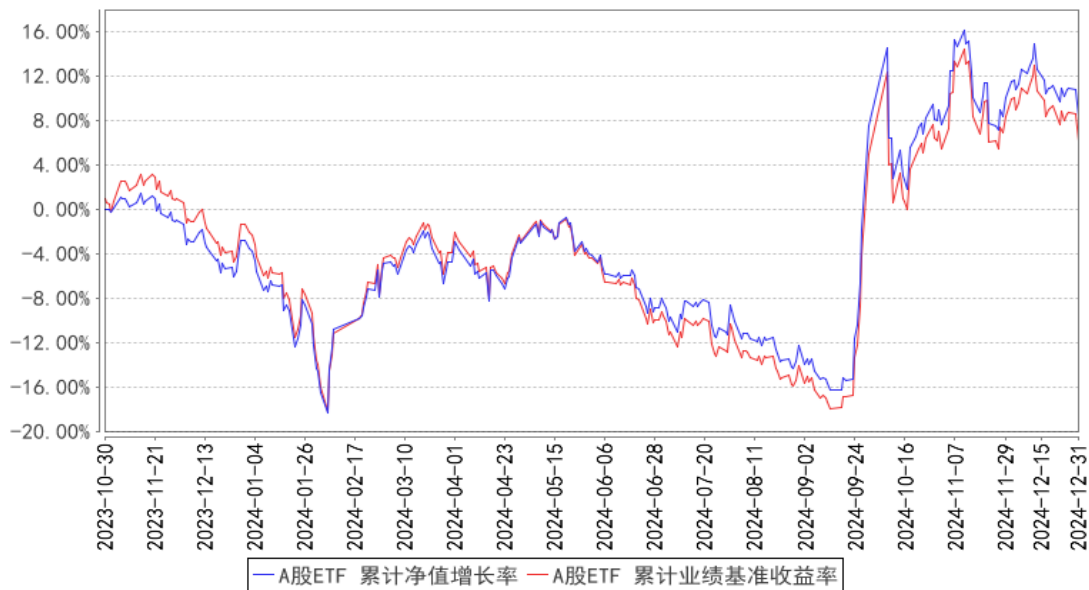
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.78%	1.89%	1.17%	1.96%	-0.39%	-0.07%
过去六个月	18.86%	1.83%	17.87%	1.86%	0.99%	-0.03%
过去一年	11.47%	1.58%	7.67%	1.61%	3.80%	-0.03%
自基金合同生效起至今	8.37%	1.48%	6.19%	1.51%	2.18%	-0.03%

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

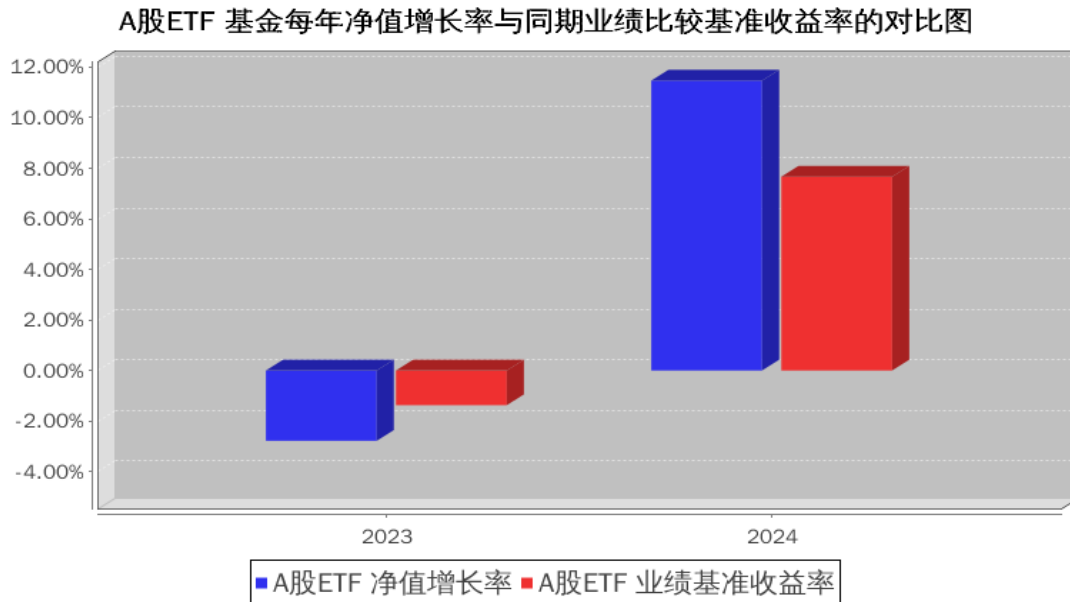
A股ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2023 年 10 月 30 日至 2024 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。

3.2.3 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%。截至 2024 年 12 月 31 日，公司旗下管理 165 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶	本基金的	2024 年 4	-	6 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专

青	基金经理助理	月 22 日			业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 10 月 30 日	-	23 年	副总经理，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、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。 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。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 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的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

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 29 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年市场以结构性机会为主，其中银行、非银金融、通信、家用电器的表现相对较好，涨跌幅分别为 34.39%、30.17%、28.82% 和 25.44%。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 14.68%、5.46%、1.20% 和 13.23%。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 24.85% 和 4.24%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

回顾 2024 年全年，内外部因素持续扰动 A 股市场走势。外部地缘局势再度升温、美联储降息

落地、美国大选特朗普获胜带来特朗普交易行情震荡；而内部低通胀在上半年有一定困扰，但一系列稳增长政策组合拳在四季度明显加码，给市场带来一针强心剂。在内外部的综合影响下，A 股最终呈现出先抑后扬再震荡的趋势，最终上证指数结束了过去持续低迷的表现，实现 12.7% 的正收益。

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 0.087%，期间日跟踪误差为 0.125%，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 3.2547 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.47%，业绩比较基准收益率为 7.67%。

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 2025 年，政策延续性、需求不足物价承压、外部环境（美联储政策、地缘风险）或仍将是影响市场的关键因素。虽然面临扰动，但投资者风险偏好在政府一系列稳增长政策的决心带动下有望整体好于 2024 年，并且随着更多行业自发收缩供给叠加配套政策上的支持，A 股结构性机会仍将持续并进一步增多，宽基指数配置性价比凸现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 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。公司合规法律部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，同时定期向董事会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

本年度公司合规法律部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，公司合规法律部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

本年度公司合规法律部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 6,503,088.43 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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	安永华明（2025）审字第 70025451_B22 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	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的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。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 A 股交易型开放式指

	数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。 在编制财务报表时，管理层负责评估华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （1）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。 （2）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。 （3）评价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。 （4）对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，就可能导致对华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资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 A 股交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 （5）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。 我们与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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	施翊洲	张晓阳
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2025 年 3 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	8,447,589.65	5,061,688.17
结算备付金		3,829,535.60	7,328,773.67
存出保证金		1,418,992.40	1,286,862.18
交易性金融资产	7.4.7.2	112,831,716.41	279,606,837.33
其中：股票投资		112,831,716.41	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		127,092.59	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		126,654,926.65	293,791,546.26
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		1,444.00	-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		75,423.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		64,697.98	93,499.60
应付托管费		12,939.59	18,699.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		51,739.43	14.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	945,207.10	2,597,021.73
负债合计		1,151,451.10	2,709,222.92
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	115,805,369.78	299,421,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	9,698,105.77	-8,338,676.66
净资产合计		125,503,475.55	291,082,323.34
负债和净资产总计		126,654,926.65	293,791,546.26

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.2547 元，基金份额总额 38,560,621.00 份。

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024	上年度可比期间 2023 年 10 月 30 日 (基金)
-----	-----	----------------------------	----------------------------------

		年 12 月 31 日	合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		11,984,143.99	1,077,091.26
1. 利息收入		72,057.81	85,744.30
其中：存款利息收入	7.4.7.13	72,057.81	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）		290,985.22	3,919,500.56
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-3,975,655.64	3,745,505.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	13,361.32	1.69
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	1,589,658.98	-147.97
股利收益	7.4.7.19	2,663,620.56	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	11,166,791.56	-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	454,309.40	1,285,115.60
减：二、营业总支出		1,281,957.71	394,987.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	799,877.35	216,915.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	159,975.51	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		5,732.41	1.54
8. 其他费用	7.4.7.23	316,372.44	134,686.90
三、利润总额（亏损总额		10,702,186.28	682,103.66

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		10,702,186.28	682,103.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,702,186.28	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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	299,421,000.00	-	-8,338,676.66	291,082,323.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	-183,615,630.22	-	18,036,782.43	-165,578,847.79
（一）、综合收益总额	-	-	10,702,186.28	10,702,186.28
（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)	-183,615,630.22	-	7,334,596.15	-176,281,034.07
其中：1. 基金申购款	110,659,318.25	-	-572,683.07	110,086,635.18
2. 基金赎回款	-294,274,948.47	-	7,907,279.22	-286,367,669.25
（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	-	-	-	-

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	115,805,369.78	-	9,698,105.77	125,503,475.55
项目	上年度可比期间 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)。本基金可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 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。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 2024 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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 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对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	8,447,589.65	5,061,688.17
等于：本金	8,446,667.25	5,061,280.65
加：应计利息	922.40	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	8,447,589.65	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 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		105,699,554.05	-	112,831,716.41	7,132,162.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		105,699,554.05	-	112,831,716.41	7,132,162.36
项目		上年度末 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 2024 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	11,879,520.00	-	-	-
其中：股指期货投资	11,879,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,879,520.00	-	-	-
项目	上年度末 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	-	-	-

资				
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
IC2503	中证 500 股指期货 2503	2.00	2,270,160.00	-47,240.00
IF2503	沪深 300 股指期货 2503	4.00	4,725,600.00	12,360.00
IM2503	中证 1000 股指期货 2503	4.00	4,705,120.00	-143,760.00
合计				-178,640.00
减：可抵销期货暂收款				-178,640.00
净额				0.00

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

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：本基金本报告期末及上年度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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 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	13,864.41	572,757.45
其中：交易所市场	13,864.41	572,757.45
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提费用	180,000.00	95,000.00
应退退补款	751,342.69	1,929,264.28
合计	945,207.10	2,597,021.73

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	299,421,000.00	299,421,000.00
本期申购	56,000,000.00	56,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-224,000,000.00	-224,000,000.00
2024 年 10 月 11 日 基金拆分/ 份额折算前	131,421,000.00	131,421,000.00
基金拆分/份额折算调整	-87,661,404.00	—
本期申购	18,201,025.00	54,659,318.25

本期赎回（以“-”号填列）	-23,400,000.00	-70,274,948.47
本期末	38,560,621.00	115,805,369.78

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、本基金已于 2024 年 10 月 11 日进行了基金份额合并，合并比例为 0.33297263。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,402,554.09	-12,741,230.75	-8,338,676.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,402,554.09	-12,741,230.75	-8,338,676.66
本期利润	-464,605.28	11,166,791.56	10,702,186.28
本期基金份额交易产生的变动数	2,565,139.62	4,769,456.53	7,334,596.15
其中：基金申购款	-1,383,614.99	810,931.92	-572,683.07
基金赎回款	3,948,754.61	3,958,524.61	7,907,279.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,503,088.43	3,195,017.34	9,698,105.77

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	28,021.75	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	42,074.19	52,711.87
其他	1,961.87	268.24
合计	72,057.81	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 2024年1月1日至2024年12月31	上年度可比期间 2023年10月30日（基金合同
----	----------------------------	-----------------------------

	日	生效日) 至2023年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-4,777,557.49	2,238,345.55
股票投资收益——赎回 差价收入	801,901.85	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	-3,975,655.64	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 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 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	204,691,171.11	250,792,159.07
减：卖出股票成本 总额	209,207,739.15	247,525,230.12
减：交易费用	260,989.45	1,028,583.40
买卖股票差价收 入	-4,777,557.49	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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 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	286,367,669.25	508,817,362.17
减：现金支付赎回款 总额	136,219,795.25	239,951,588.17
减：赎回股票成本总 额	149,345,972.15	267,358,613.58
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	801,901.85	1,507,160.42

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 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	10.35	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	13,350.97	—
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	13,361.32	1.69

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年10月30日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	112,367.74	—
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,000.00	—
减：应计利息总额	12.28	—
减：交易费用	4.49	—
买卖债券差价收入	13,350.97	—

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	1,589,658.98	-147.97

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月	上年度可比期间 2023 年 10 月 30 日（基金合同生
----	-----------------------------------	-----------------------------------

	31 日	效日) 至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,663,620.56	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	2,663,620.56	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	11,294,115.56	-4,161,953.20
股票投资	11,294,115.56	-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	-126,640.00	-52,000.00
权证投资	-	-
期货投资	-126,640.00	-52,000.00
3. 其他	-684.00	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	11,166,791.56	-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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	454,309.40	1,146,545.39
其他	-	138,570.21
合计	454,309.40	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 10 月 30 日(基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	20,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	-	400.00
注册登记费	150,000.00	37,500.00
IOPV 计算发布费	3,013.70	20,000.00
银行划款手续费	3,358.74	1,786.90
合计	316,372.44	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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（%）	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 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	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	799,877.35	216,915.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,461.28	3,863.46
应支付基金管理人的净管理费	781,416.07	213,052.47

注：自 2023 年 10 月 30 日起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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托管费	159,975.51	43,383.23

注：自 2023 年 10 月 30 日起，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：本报告期及上年度可比期间，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
招商银行	8,447,589.65	28,021.75	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688709	成都华微	网下申购	4,318	67,749.42
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	1,173	30,498.00
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	622	18,050.44
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	5,893	66,531.97
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	1,866	41,723.76
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	2,506	54,455.38
上年度可比期间 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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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（2024 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
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	2.30	6.80	1,100	2,530.00	7,480.00	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	23.95	35.85	162	3,879.90	5,807.70	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	27.76	39.79	137	3,803.12	5,451.23	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	22.36	44.92	187	4,181.32	8,400.04	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	72.99	101.96	55	4,014.45	5,607.80	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	12.30	12.30	1,085	13,345.50	13,345.50	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月以上	新股锁定期内	12.30	12.30	121	1,488.30	1,488.30	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	20.32	28.13	120	2,438.40	3,375.60	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	14.65	27.35	120	1,758.00	3,282.00	-

603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定期内	18.65	22.61	62	1,156.30	1,401.82	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定期内	20.56	36.17	67	1,377.52	2,423.39	-
603395	红四方	2024年11月19日	6个月	新股锁定期内	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024年11月20日	6个月	新股锁定期内	11.25	29.44	562	6,322.50	16,545.28	-
688605	先锋精科	2024年12月4日	6个月	新股锁定期内	11.29	53.68	590	6,661.10	31,671.20	-
688708	佳驰科技	2024年11月27日	6个月	新股锁定期内	27.08	48.95	250	6,770.00	12,237.50	-
688750	金天钛业	2024年11月12日	6个月	新股锁定期内	7.16	15.44	884	6,329.44	13,648.96	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大资产重组	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	14,900	111,184.60	107,578.00	-

注：本基金截至 2024 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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市场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市场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开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2024 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(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 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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 2024 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 2024 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	8,447,589.65	-	-	-	-	-	8,447,589.65
结算备付金	3,829,535.60	-	-	-	-	-	3,829,535.60
存出保证金	14,886.80	-	-	-	-	1,404,105.60	1,418,992.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	112,831,716.41	112,831,716.41
应收清算款	-	-	-	-	-	127,092.59	127,092.59
资产总计	12,292,012.05	-	-	-	-	114,362,914.60	126,654,926.65
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,444.00	1,444.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,697.98	64,697.98
应付托管费	-	-	-	-	-	12,939.59	12,939.59
应付清算款	-	-	-	-	-	75,423.00	75,423.00
应交税费	-	-	-	-	-	51,739.43	51,739.43
其他负债	-	-	-	-	-	945,207.10	945,207.10
负债总计	-	-	-	-	-	1,151,451.10	1,151,451.10
利率敏感度缺口	12,292,012.05	-	-	-	-	113,211,463.50	125,503,475.55
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	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	-	-	-	-	-	93,499.60	93,499.60

酬							
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

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：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(2023 年 12 月 31 日：同)。

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	112,831,716.41	89.90	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	－1,444.00	－0.00	12.70	－
合计	112,830,272.41	89.90	279,566,748.34	96.04

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 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	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	6,101,676.54	14,369,880.37
	业绩比较基准下降 5%	－6,101,676.54	－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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	112,586,463.51	279,511,466.39

第二层次	122,411.80	40,101.69
第三层次	122,841.10	55,269.25
合计	112,831,716.41	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 2024年1月1日至2024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	—	55,269.25	55,269.25
当期购买	—	—	—
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	188,751.32	188,751.32
转出第三层次	—	293,360.40	293,360.40
当期利得或损失总额	—	172,180.93	172,180.93
其中：计入损益的利得或损失	—	172,180.93	172,180.93
计入其他综合收益的利得或损失	—	—	—
期末余额	—	122,841.10	122,841.10
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	—	70,390.13	70,390.13
项目	上年度可比期间 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 2024 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 2024 年度，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	122,841.10	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3521~4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	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 2024 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(2023 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

(1) 基金申购款

于 2024 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 110,086,635.18 元(2023 年度：163,796,581.85 元)，其中包括以股票支付的申购款 55,547,827.59 元和以现金支付的申购款 54,538,807.59 元(2023 年度：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	112,831,716.41	89.09
	其中：股票	112,831,716.41	89.09
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	12,277,125.25	9.69
8	其他各项资产	1,546,084.99	1.22
9	合计	126,654,926.65	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	1,013,329.00	0.81
B	采矿业	4,198,022.00	3.34

C	制造业	67,105,628.21	53.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,756,739.00	2.99
E	建筑业	1,681,583.00	1.34
F	批发和零售业	1,846,051.40	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,382,821.16	2.70
H	住宿和餐饮业	146,120.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,821,725.80	5.44
J	金融业	16,366,563.94	13.04
K	房地产业	1,737,462.00	1.38
L	租赁和商务服务业	1,126,348.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	1,218,698.20	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	904,642.00	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	89,760.00	0.07
Q	卫生和社会工作	461,978.80	0.37
R	文化、体育和娱乐业	745,417.00	0.59
S	综合	89,191.00	0.07
	合计	112,692,080.51	89.79

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	115,610.62	0.09
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	7,480.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,545.28	0.01
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	139,635.90	0.11

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	2,600	3,962,400.00	3.16
2	300750	宁德时代	7,856	2,089,696.00	1.67
3	601318	中国平安	29,200	1,537,380.00	1.22
4	600900	长江电力	34,500	1,019,475.00	0.81
5	000333	美的集团	13,199	992,828.78	0.79
6	300059	东方财富	34,500	890,790.00	0.71
7	601166	兴业银行	42,400	812,384.00	0.65
8	688041	海光信息	5,250	786,397.50	0.63
9	002594	比亚迪	2,600	734,916.00	0.59
10	000858	五粮液	5,200	728,208.00	0.58
11	601899	紫金矿业	47,700	721,224.00	0.57
12	600030	中信证券	23,900	697,163.00	0.56
13	300760	迈瑞医疗	2,600	663,000.00	0.53
14	300308	中际旭创	5,280	652,132.80	0.52
15	601398	工商银行	93,000	643,560.00	0.51
16	600276	恒瑞医药	13,200	605,880.00	0.48
17	000651	格力电器	13,200	599,940.00	0.48
18	601328	交通银行	74,300	577,311.00	0.46
19	002475	立讯精密	13,200	538,032.00	0.43
20	688981	中芯国际	5,120	484,454.40	0.39

21	600887	伊利股份	15,800	476,844.00	0.38
22	601288	农业银行	82,200	438,948.00	0.35
23	603259	药明康德	7,900	434,816.00	0.35
24	000725	京东方 A	93,000	408,270.00	0.33
25	300274	阳光电源	5,280	389,822.40	0.31
26	603019	中科曙光	5,200	376,064.00	0.30
27	600309	万华化学	5,200	371,020.00	0.30
28	601816	京沪高铁	58,400	359,744.00	0.29
29	688008	澜起科技	5,250	356,475.00	0.28
30	600000	浦发银行	34,500	355,005.00	0.28
31	601127	赛力斯	2,600	346,814.00	0.28
32	000001	平安银行	29,200	341,640.00	0.27
33	601088	中国神华	7,800	339,144.00	0.27
34	600919	江苏银行	34,500	338,790.00	0.27
35	000568	泸州老窖	2,600	325,520.00	0.26
36	600660	福耀玻璃	5,200	324,480.00	0.26
37	002415	海康威视	10,500	322,350.00	0.26
38	000063	中兴通讯	7,900	319,160.00	0.25
39	601988	中国银行	55,800	307,458.00	0.24
40	600941	中国移动	2,600	307,216.00	0.24
41	300124	汇川技术	5,200	304,616.00	0.24
42	002714	牧原股份	7,900	303,676.00	0.24
43	300502	新易盛	2,600	300,508.00	0.24
44	600690	海尔智家	10,500	298,935.00	0.24
45	601919	中远海控	18,700	289,850.00	0.23
46	601728	中国电信	39,800	287,356.00	0.23
47	601668	中国建筑	47,700	286,200.00	0.23
48	601857	中国石油	31,900	285,186.00	0.23
49	603986	兆易创新	2,600	277,680.00	0.22
50	601985	中国核电	26,600	277,438.00	0.22
51	603501	韦尔股份	2,600	271,466.00	0.22
52	601601	中国太保	7,900	269,232.00	0.21
53	601766	中国中车	31,900	267,322.00	0.21
54	000100	TCL 科技	53,000	266,590.00	0.21
55	600406	国电南瑞	10,500	264,810.00	0.21
56	600016	民生银行	63,800	263,494.00	0.21
57	300498	温氏股份	15,800	260,858.00	0.21
58	600031	三一重工	15,800	260,384.00	0.21
59	300355	蒙草生态	50,300	258,039.00	0.21
60	601689	拓普集团	5,205	255,045.00	0.20
61	600050	中国联通	47,700	253,287.00	0.20
62	002230	科大讯飞	5,200	251,264.00	0.20
63	002625	光启技术	5,200	248,560.00	0.20

64	688002	睿创微纳	5,282	248,306.82	0.20
65	601012	隆基绿能	15,800	248,218.00	0.20
66	300394	天孚通信	2,680	244,844.80	0.20
67	601225	陕西煤业	10,500	244,230.00	0.19
68	600340	华夏幸福	90,300	242,907.00	0.19
69	688230	芯导科技	5,135	240,318.00	0.19
70	002402	和而泰	13,200	239,052.00	0.19
71	603288	海天味业	5,200	238,680.00	0.19
72	603596	伯特利	5,280	235,435.20	0.19
73	300782	卓胜微	2,600	233,220.00	0.19
74	600028	中国石化	34,500	230,460.00	0.18
75	605117	德业股份	2,680	227,264.00	0.18
76	601138	工业富联	10,500	225,750.00	0.18
77	000627	天茂集团	47,700	222,759.00	0.18
78	000938	紫光股份	7,900	219,857.00	0.18
79	601628	中国人寿	5,200	217,984.00	0.17
80	000792	盐湖股份	13,200	217,272.00	0.17
81	000338	潍柴动力	15,800	216,460.00	0.17
82	601818	光大银行	55,600	215,172.00	0.17
83	300661	圣邦股份	2,600	212,628.00	0.17
84	600584	长电科技	5,200	212,472.00	0.17
85	002352	顺丰控股	5,200	209,560.00	0.17
86	603160	汇顶科技	2,600	209,404.00	0.17
87	600837	海通证券	18,600	206,832.00	0.16
88	002463	沪电股份	5,200	206,180.00	0.16
89	300674	宇信科技	10,500	204,960.00	0.16
90	002027	分众传媒	29,100	204,573.00	0.16
91	002241	歌尔股份	7,900	203,899.00	0.16
92	002628	成都路桥	45,000	203,850.00	0.16
93	601933	永辉超市	31,800	201,612.00	0.16
94	601162	天风证券	45,000	201,600.00	0.16
95	300408	三环集团	5,200	200,252.00	0.16
96	002797	第一创业	23,900	199,565.00	0.16
97	600418	江淮汽车	5,200	195,000.00	0.16
98	000564	供销大集	55,800	192,510.00	0.15
99	002142	宁波银行	7,900	192,049.00	0.15
100	600797	浙大网新	26,600	190,988.00	0.15
101	300088	长信科技	29,200	190,968.00	0.15
102	300919	中伟股份	5,280	190,713.60	0.15
103	002028	思源电气	2,600	189,020.00	0.15
104	300024	机器人	10,500	188,475.00	0.15
105	300296	利亚德	29,200	188,048.00	0.15
106	600150	中国船舶	5,200	186,992.00	0.15

107	002050	三花智控	7,900	185,729.00	0.15
108	300303	聚飞光电	26,600	181,412.00	0.14
109	601169	北京银行	29,200	179,580.00	0.14
110	300223	北京君正	2,600	177,320.00	0.14
111	000625	长安汽车	13,200	176,352.00	0.14
112	600221	海航控股	103,500	175,950.00	0.14
113	300015	爱尔眼科	13,200	174,900.00	0.14
114	600438	通威股份	7,900	174,669.00	0.14
115	601888	中国中免	2,600	174,226.00	0.14
116	000402	金 融 街	53,000	172,780.00	0.14
117	603927	中科软	7,920	171,864.00	0.14
118	600702	舍得酒业	2,600	171,418.00	0.14
119	601390	中国中铁	26,500	169,335.00	0.13
120	000425	徐工机械	21,200	168,116.00	0.13
121	300352	北信源	31,800	167,904.00	0.13
122	603338	浙江鼎力	2,600	167,752.00	0.13
123	002049	紫光国微	2,600	167,362.00	0.13
124	688005	容百科技	5,262	166,016.10	0.13
125	600048	保利发展	18,700	165,682.00	0.13
126	600885	宏发股份	5,200	165,464.00	0.13
127	002488	金固股份	15,800	164,952.00	0.13
128	600206	有研新材	10,500	164,535.00	0.13
129	300724	捷佳伟创	2,600	164,346.00	0.13
130	000423	东阿阿胶	2,600	163,072.00	0.13
131	002851	麦格米特	2,600	159,796.00	0.13
132	002472	双环传动	5,200	159,224.00	0.13
133	002456	欧菲光	13,200	158,136.00	0.13
134	300237	美晨科技	71,600	156,088.00	0.12
135	000538	云南白药	2,600	155,870.00	0.12
136	601600	中国铝业	21,200	155,820.00	0.12
137	300182	捷成股份	26,500	155,555.00	0.12
138	300496	中科创达	2,600	154,856.00	0.12
139	002065	东华软件	21,200	153,912.00	0.12
140	002156	通富微电	5,200	153,660.00	0.12
141	600938	中国海油	5,200	153,452.00	0.12
142	601010	文峰股份	55,800	153,450.00	0.12
143	002185	华天科技	13,200	153,252.00	0.12
144	000066	中国长城	10,500	152,985.00	0.12
145	301236	软通动力	2,600	152,646.00	0.12
146	002405	四维图新	15,800	152,312.00	0.12
147	603799	华友钴业	5,200	152,152.00	0.12
148	002312	川发龙蟒	10,500	151,935.00	0.12
149	002384	东山精密	5,200	151,840.00	0.12

150	300383	光环新网	10,400	151,736.00	0.12
151	002966	苏州银行	18,600	150,846.00	0.12
152	002409	雅克科技	2,600	150,670.00	0.12
153	601058	赛轮轮胎	10,500	150,465.00	0.12
154	600486	扬农化工	2,600	150,462.00	0.12
155	002396	星网锐捷	7,900	150,021.00	0.12
156	600642	申能股份	15,800	149,942.00	0.12
156	601021	春秋航空	2,600	149,942.00	0.12
157	600015	华夏银行	18,700	149,787.00	0.12
158	688314	康拓医疗	5,182	149,241.60	0.12
159	300454	深信服	2,600	149,240.00	0.12
160	002506	协鑫集成	55,800	148,986.00	0.12
161	300509	新美星	21,200	146,916.00	0.12
162	000768	中航西飞	5,200	146,848.00	0.12
163	688360	德马科技	7,895	146,689.10	0.12
164	300058	蓝色光标	15,800	146,624.00	0.12
165	600570	恒生电子	5,200	145,548.00	0.12
166	600300	维维股份	45,000	144,900.00	0.12
167	000799	酒鬼酒	2,600	144,612.00	0.12
168	603272	联翔股份	10,500	144,480.00	0.12
169	688180	君实生物	5,264	143,865.12	0.11
170	002139	拓邦股份	10,500	142,905.00	0.11
171	300347	泰格医药	2,600	142,012.00	0.11
172	600908	无锡银行	23,800	140,658.00	0.11
173	300558	贝达药业	2,600	140,218.00	0.11
174	601989	中国重工	29,100	139,971.00	0.11
175	002131	利欧股份	45,000	139,050.00	0.11
176	601939	建设银行	15,800	138,882.00	0.11
177	000401	冀东水泥	26,400	138,072.00	0.11
178	601375	中原证券	31,900	137,808.00	0.11
179	002212	天融信	21,300	137,385.00	0.11
180	601100	恒立液压	2,600	137,202.00	0.11
181	600066	宇通客车	5,200	137,176.00	0.11
182	603606	东方电缆	2,600	136,630.00	0.11
183	000750	国海证券	31,900	136,532.00	0.11
184	002202	金风科技	13,200	136,356.00	0.11
185	002082	万邦德	21,200	136,316.00	0.11
186	688227	品高股份	5,268	136,177.80	0.11
187	600487	亨通光电	7,900	136,038.00	0.11
188	601658	邮储银行	23,900	135,752.00	0.11
189	002281	光迅科技	2,600	135,642.00	0.11
190	301019	宁波色母	7,909	135,560.26	0.11
191	300054	鼎龙股份	5,200	135,304.00	0.11

191	600460	士兰微	5,200	135,304.00	0.11
192	601838	成都银行	7,900	135,169.00	0.11
193	300442	润泽科技	2,600	135,096.00	0.11
194	000002	万科A	18,600	135,036.00	0.11
195	000977	浪潮信息	2,600	134,888.00	0.11
196	600089	特变电工	10,500	133,770.00	0.11
197	601665	齐鲁银行	23,800	133,042.00	0.11
198	002865	钧达股份	2,600	132,860.00	0.11
199	300136	信维通信	5,200	132,288.00	0.11
200	600760	中航沈飞	2,600	131,872.00	0.11
201	600862	中航高科	5,200	131,352.00	0.10
202	002130	沃尔核材	5,200	131,300.00	0.10
203	600886	国投电力	7,900	131,298.00	0.10
204	603922	金鸿顺	5,260	131,184.40	0.10
205	300929	华骐环保	15,800	130,666.00	0.10
206	300241	瑞丰光电	23,800	130,662.00	0.10
207	002595	豪迈科技	2,600	130,494.00	0.10
208	002984	森麒麟	5,280	130,204.80	0.10
209	300339	润和软件	2,600	130,078.00	0.10
210	002008	大族激光	5,200	130,000.00	0.10
211	002268	电科网安	7,900	128,375.00	0.10
212	300854	中兰环保	10,500	128,310.00	0.10
213	601200	上海环境	15,700	128,269.00	0.10
214	601077	渝农商行	21,200	128,260.00	0.10
215	600703	三安光电	10,500	127,785.00	0.10
216	002311	海大集团	2,600	127,530.00	0.10
217	600839	四川长虹	13,200	127,380.00	0.10
218	000069	华侨城A	47,700	127,359.00	0.10
219	600482	中国动力	5,200	127,244.00	0.10
220	601997	贵阳银行	21,200	127,200.00	0.10
221	600810	神马股份	15,700	127,013.00	0.10
222	601168	西部矿业	7,900	126,953.00	0.10
223	000783	长江证券	18,600	126,852.00	0.10
224	300142	沃森生物	10,500	126,840.00	0.10
225	600110	诺德股份	31,700	126,800.00	0.10
226	002067	景兴纸业	31,900	126,324.00	0.10
227	002025	航天电器	2,600	126,256.00	0.10
228	002195	岩山科技	31,800	126,246.00	0.10
229	002807	江阴银行	29,000	126,150.00	0.10
230	002407	多氟多	10,500	126,000.00	0.10
231	603323	苏农银行	23,800	125,902.00	0.10
232	000686	东北证券	15,800	125,452.00	0.10
233	600160	巨化股份	5,200	125,424.00	0.10

234	600183	生益科技	5,200	125,060.00	0.10
235	600363	联创光电	2,600	124,488.00	0.10
236	300487	蓝晓科技	2,600	124,462.00	0.10
237	300385	雪浪环境	26,400	124,344.00	0.10
238	688303	大全能源	5,139	124,055.46	0.10
239	600728	佳都科技	26,500	124,020.00	0.10
240	000735	罗 牛 山	18,600	123,876.00	0.10
241	603993	洛阳钼业	18,600	123,690.00	0.10
242	600585	海螺水泥	5,200	123,656.00	0.10
243	600865	百大集团	10,500	123,585.00	0.10
244	002539	云图控股	15,800	123,556.00	0.10
244	002555	三七互娱	7,900	123,556.00	0.10
245	601099	太平洋	29,000	123,540.00	0.10
246	688267	中触媒	5,257	123,539.50	0.10
247	600369	西南证券	26,400	123,288.00	0.10
248	600643	爱建集团	23,800	123,046.00	0.10
249	002497	雅化集团	10,500	122,850.00	0.10
250	601106	中国一重	42,100	122,511.00	0.10
251	300126	锐奇股份	23,800	122,094.00	0.10
252	002318	久立特材	5,200	121,732.00	0.10
253	600079	人福医药	5,200	121,576.00	0.10
254	300014	亿纬锂能	2,600	121,524.00	0.10
255	002340	格林美	18,600	121,458.00	0.10
256	600536	中国软件	2,600	121,394.00	0.10
257	002958	青农商行	39,800	120,992.00	0.10
258	600795	国电电力	26,400	120,912.00	0.10
259	000009	中国宝安	13,200	120,780.00	0.10
259	601229	上海银行	13,200	120,780.00	0.10
260	300026	红日药业	31,700	120,143.00	0.10
261	300390	天华新能	5,200	119,860.00	0.10
262	601128	常熟银行	15,830	119,833.10	0.10
263	300640	德艺文创	21,200	119,568.00	0.10
263	601187	厦门银行	21,200	119,568.00	0.10
264	601611	中国核建	13,200	119,328.00	0.10
265	688237	超卓航科	5,274	119,034.18	0.09
266	000036	华联控股	29,000	118,320.00	0.09
267	600879	航天电子	13,200	118,272.00	0.09
268	600763	通策医疗	2,662	118,192.80	0.09
269	688096	京源环保	15,830	118,091.80	0.09
270	301358	湖南裕能	2,600	117,832.00	0.09
271	600547	山东黄金	5,200	117,676.00	0.09
272	603369	今世缘	2,600	117,598.00	0.09
273	601577	长沙银行	13,200	117,348.00	0.09

274	002129	TCL 中环	13,200	117,084.00	0.09
275	002500	山西证券	18,600	116,808.00	0.09
276	002436	兴森科技	10,500	116,655.00	0.09
277	000999	华润三九	2,630	116,614.20	0.09
278	000429	粤高速 A	7,900	116,130.00	0.09
279	300207	欣旺达	5,200	116,012.00	0.09
280	600096	云天化	5,200	115,960.00	0.09
281	600596	新安股份	13,200	115,896.00	0.09
282	688280	精进电动	26,385	115,830.15	0.09
283	688388	嘉元科技	7,851	115,645.23	0.09
284	601198	东兴证券	10,500	115,605.00	0.09
285	002273	水晶光电	5,200	115,544.00	0.09
286	600926	杭州银行	7,900	115,419.00	0.09
287	002839	张家港行	26,400	115,368.00	0.09
288	600285	羚锐制药	5,200	115,232.00	0.09
289	601956	东贝集团	23,800	114,954.00	0.09
290	600827	百联股份	10,500	114,765.00	0.09
291	600863	内蒙华电	26,500	114,745.00	0.09
292	300604	长川科技	2,600	114,738.00	0.09
293	603087	甘李药业	2,600	114,660.00	0.09
294	000935	四川双马	7,900	114,392.00	0.09
295	002001	新 和 成	5,200	114,244.00	0.09
296	600502	安徽建工	23,900	114,242.00	0.09
297	300001	特锐德	5,200	114,140.00	0.09
298	300009	安科生物	13,200	114,048.00	0.09
298	600143	金发科技	13,200	114,048.00	0.09
299	300433	蓝思科技	5,200	113,880.00	0.09
300	002961	瑞达期货	7,900	113,523.00	0.09
301	603658	安图生物	2,600	113,464.00	0.09
302	300373	扬杰科技	2,600	113,152.00	0.09
303	600522	中天科技	7,900	113,128.00	0.09
304	688681	科汇股份	10,494	113,020.38	0.09
305	002203	海亮股份	10,500	112,875.00	0.09
306	600141	兴发集团	5,200	112,840.00	0.09
307	002479	富春环保	23,800	112,812.00	0.09
308	600588	用友网络	10,500	112,665.00	0.09
309	000988	华工科技	2,600	112,580.00	0.09
310	600033	福建高速	29,000	112,520.00	0.09
311	600426	华鲁恒升	5,200	112,372.00	0.09
312	601825	沪农商行	13,200	112,332.00	0.09
313	300987	川网传媒	7,900	111,864.00	0.09
314	002507	涪陵榨菜	7,900	111,627.00	0.09
315	000060	中金岭南	23,800	111,622.00	0.09

316	002263	大东南	45,000	111,600.00	0.09
317	600170	上海建工	42,100	111,565.00	0.09
318	603179	新泉股份	2,611	111,489.70	0.09
319	002832	比音勒芬	5,200	111,332.00	0.09
320	002936	郑州银行	53,000	111,300.00	0.09
321	600137	浪莎股份	7,900	110,995.00	0.09
322	300017	网宿科技	10,500	110,985.00	0.09
323	600019	宝钢股份	15,800	110,600.00	0.09
324	002074	国轩高科	5,200	110,344.00	0.09
324	600111	北方稀土	5,200	110,344.00	0.09
325	600125	铁龙物流	18,600	110,298.00	0.09
326	002563	森马服饰	15,700	110,214.00	0.09
327	001965	招商公路	7,900	110,205.00	0.09
328	601901	方正证券	13,200	109,956.00	0.09
329	688558	国盛智科	5,139	109,717.65	0.09
330	002926	华西证券	13,200	109,692.00	0.09
331	000733	振华科技	2,600	109,642.00	0.09
332	601998	中信银行	15,700	109,586.00	0.09
333	300476	胜宏科技	2,600	109,434.00	0.09
334	601117	中国化学	13,200	109,428.00	0.09
335	301033	迈普医学	2,600	109,330.00	0.09
336	600208	新湖中宝	36,900	109,224.00	0.09
337	600559	老白干酒	5,200	109,148.00	0.09
338	300676	华大基因	2,600	109,122.00	0.09
339	688679	通源环境	10,390	109,095.00	0.09
340	600739	辽宁成大	10,500	108,675.00	0.09
340	601360	三六零	10,500	108,675.00	0.09
341	002459	晶澳科技	7,900	108,625.00	0.09
342	688021	奥福环保	10,390	108,471.60	0.09
343	002624	完美世界	10,500	108,465.00	0.09
344	301037	保立佳	10,500	108,255.00	0.09
345	600161	天坛生物	5,280	108,240.00	0.09
346	603885	吉祥航空	7,900	108,230.00	0.09
347	600352	浙江龙盛	10,500	108,045.00	0.09
348	600392	盛和资源	10,500	107,940.00	0.09
349	600893	航发动力	2,600	107,770.00	0.09
350	600963	岳阳林纸	21,200	107,696.00	0.09
351	300512	中亚股份	15,800	107,598.00	0.09
352	002252	上海莱士	14,900	107,578.00	0.09
353	001979	招商蛇口	10,500	107,520.00	0.09
354	002517	恺英网络	7,900	107,519.00	0.09
355	300459	汤姆猫	18,600	106,764.00	0.09
356	600548	深高速	7,900	106,492.00	0.08

357	600765	中航重机	5,200	106,444.00	0.08
358	002701	奥瑞金	18,700	106,029.00	0.08
359	002432	九安医疗	2,600	106,028.00	0.08
360	600415	小商品城	7,900	105,939.00	0.08
360	600512	腾达建设	44,700	105,939.00	0.08
361	688215	瑞晟智能	5,250	105,840.00	0.08
362	601860	紫金银行	37,100	105,735.00	0.08
363	600115	中国东航	26,400	105,600.00	0.08
363	600733	北汽蓝谷	13,200	105,600.00	0.08
364	603083	剑桥科技	2,600	105,560.00	0.08
365	600085	同仁堂	2,600	105,534.00	0.08
366	002400	省广集团	13,200	105,468.00	0.08
367	000968	蓝焰控股	15,800	105,070.00	0.08
368	002837	英维克	2,600	105,040.00	0.08
369	301098	金埔园林	13,200	104,940.00	0.08
370	300168	万达信息	13,200	104,808.00	0.08
371	300073	当升科技	2,600	104,728.00	0.08
372	300132	青松股份	21,200	104,516.00	0.08
373	600905	三峡能源	23,900	104,443.00	0.08
374	600269	赣粤高速	18,600	104,346.00	0.08
375	600383	金地集团	23,800	104,244.00	0.08
376	300450	先导智能	5,200	104,104.00	0.08
377	000997	新大陆	5,200	103,740.00	0.08
378	600060	海信视像	5,200	103,688.00	0.08
379	000887	中鼎股份	7,900	103,648.00	0.08
380	600497	驰宏锌锗	18,600	103,602.00	0.08
381	002346	柘中股份	10,500	103,530.00	0.08
381	600618	氯碱化工	10,500	103,530.00	0.08
382	600171	上海贝岭	2,600	103,168.00	0.08
383	601555	东吴证券	13,200	102,960.00	0.08
384	300535	达威股份	7,900	102,937.00	0.08
385	300834	星辉环材	5,200	102,752.00	0.08
386	002709	天赐材料	5,200	102,544.00	0.08
387	002271	东方雨虹	7,900	102,542.00	0.08
387	600029	南方航空	15,800	102,542.00	0.08
388	002948	青岛银行	26,400	102,432.00	0.08
388	600637	东方明珠	13,200	102,432.00	0.08
389	600481	双良节能	18,600	102,300.00	0.08
390	002179	中航光电	2,600	102,180.00	0.08
391	300568	星源材质	10,500	102,060.00	0.08
392	688101	三达膜	7,795	102,036.55	0.08
393	603589	口子窖	2,600	102,024.00	0.08
394	688599	天合光能	5,282	101,942.60	0.08

395	002128	电投能源	5,200	101,816.00	0.08
396	688098	申联生物	18,589	101,681.83	0.08
397	002706	良信股份	13,200	101,376.00	0.08
398	600020	中原高速	23,900	100,858.00	0.08
399	600745	闻泰科技	2,600	100,828.00	0.08
400	300458	全志科技	2,600	100,776.00	0.08
401	600515	海南机场	26,600	100,548.00	0.08
402	301256	华融化学	13,200	100,452.00	0.08
403	300628	亿联网络	2,600	100,360.00	0.08
404	300346	南大光电	2,600	100,334.00	0.08
405	002558	巨人网络	7,900	100,251.00	0.08
406	600549	厦门钨业	5,200	100,204.00	0.08
407	600783	鲁信创投	7,900	100,093.00	0.08
408	300418	昆仑万维	2,600	100,048.00	0.08
409	601000	唐山港	21,200	99,852.00	0.08
410	601615	明阳智能	7,900	99,619.00	0.08
411	300157	新锦动力	34,300	99,470.00	0.08
412	605006	山东玻纤	15,800	99,382.00	0.08
413	000818	航锦科技	5,200	99,320.00	0.08
414	600157	永泰能源	58,000	99,180.00	0.08
415	600373	中文传媒	7,900	99,145.00	0.08
416	300251	光线传媒	10,500	99,120.00	0.08
417	000021	深科技	5,200	99,112.00	0.08
418	000513	丽珠集团	2,600	98,800.00	0.08
419	600120	浙江东方	21,200	98,792.00	0.08
419	600572	康恩贝	21,200	98,792.00	0.08
420	600868	梅雁吉祥	39,800	98,704.00	0.08
421	002498	汉缆股份	29,100	98,649.00	0.08
422	002085	万丰奥威	5,200	98,540.00	0.08
423	300012	华测检测	7,900	98,197.00	0.08
424	000581	威孚高科	5,200	98,176.00	0.08
425	603197	保隆科技	2,600	98,150.00	0.08
426	002756	永兴材料	2,600	98,072.00	0.08
426	600771	广誉远	5,200	98,072.00	0.08
427	300470	中密控股	2,600	98,020.00	0.08
428	300395	菲利华	2,600	97,786.00	0.08
429	002648	卫星化学	5,200	97,708.00	0.08
429	300829	金丹科技	5,200	97,708.00	0.08
429	300886	华业香料	5,200	97,708.00	0.08
430	600155	华创阳安	13,200	97,680.00	0.08
431	300144	宋城演艺	10,500	97,545.00	0.08
432	301065	本立科技	5,200	97,500.00	0.08
433	002126	银轮股份	5,200	97,344.00	0.08

433	300037	新宙邦	2,600	97,344.00	0.08
434	002044	美年健康	21,200	97,308.00	0.08
435	601963	重庆银行	10,478	97,235.84	0.08
436	301059	金三江	7,900	97,170.00	0.08
437	002718	友邦吊顶	7,900	96,617.00	0.08
438	000878	云南铜业	7,900	96,301.00	0.08
439	600021	上海电力	10,500	96,285.00	0.08
440	002353	杰瑞股份	2,600	96,174.00	0.08
441	600917	重庆燃气	15,800	96,064.00	0.08
442	002841	视源股份	2,600	95,966.00	0.08
443	002739	万达电影	7,900	95,906.00	0.08
444	688126	沪硅产业	5,093	95,850.26	0.08
445	600705	中航产融	26,400	95,832.00	0.08
446	600909	华安证券	15,800	95,748.00	0.08
447	600500	中化国际	23,800	95,676.00	0.08
448	600928	西安银行	26,400	95,304.00	0.08
449	000528	柳 工	7,900	95,274.00	0.08
450	002261	拓维信息	5,200	95,212.00	0.08
451	301097	天益医疗	2,600	95,160.00	0.08
452	600998	九州通	18,585	95,155.20	0.08
453	600489	中金黄金	7,900	95,037.00	0.08
454	600820	隧道股份	13,200	94,908.00	0.08
455	002223	鱼跃医疗	2,600	94,874.00	0.08
456	002938	鹏鼎控股	2,600	94,848.00	0.08
457	000563	陕国投 A	26,600	94,696.00	0.08
458	600704	物产中大	18,700	94,622.00	0.08
459	300478	杭州高新	10,500	94,605.00	0.08
460	603535	嘉诚国际	7,884	94,529.16	0.08
461	000551	创元科技	7,900	94,484.00	0.08
462	603979	金诚信	2,600	94,380.00	0.08
463	000785	居然智家	26,400	94,248.00	0.08
464	601788	光大证券	5,200	94,172.00	0.08
465	603093	南华期货	7,900	94,010.00	0.07
466	002389	航天彩虹	5,200	93,860.00	0.07
467	600100	同方股份	13,200	93,852.00	0.07
468	601966	玲珑轮胎	5,200	93,808.00	0.07
469	600298	安琪酵母	2,600	93,730.00	0.07
470	600906	财达证券	13,200	93,720.00	0.07
471	688223	晶科能源	13,165	93,603.15	0.07
472	000157	中联重科	12,900	93,267.00	0.07
473	601609	金田股份	15,800	93,220.00	0.07
474	300748	金力永磁	5,200	92,976.00	0.07
474	603279	景津装备	5,200	92,976.00	0.07

475	600521	华海药业	5,200	92,924.00	0.07
476	002410	广联达	7,900	92,904.00	0.07
477	000830	鲁西化工	7,900	92,351.00	0.07
478	002738	中矿资源	2,600	92,300.00	0.07
479	002152	广电运通	7,900	92,114.00	0.07
480	002601	龙佰集团	5,200	91,884.00	0.07
481	002385	大北农	21,200	91,796.00	0.07
482	600012	皖通高速	5,200	91,780.00	0.07
483	300002	神州泰岳	7,900	91,561.00	0.07
484	300091	金通灵	44,500	91,225.00	0.07
485	000034	神州数码	2,600	91,130.00	0.07
486	002460	赣锋锂业	2,600	91,026.00	0.07
487	000531	穗恒运 A	15,800	91,008.00	0.07
488	601990	南京证券	10,500	90,930.00	0.07
489	688013	天臣医疗	5,139	90,497.79	0.07
490	001227	兰州银行	36,700	90,282.00	0.07
491	300699	光威复材	2,600	90,090.00	0.07
492	001333	光华股份	5,200	90,012.00	0.07
493	600176	中国巨石	7,900	89,981.00	0.07
494	000963	华东医药	2,600	89,960.00	0.07
495	002511	中顺洁柔	13,200	89,892.00	0.07
496	002607	中公教育	26,400	89,760.00	0.07
497	600197	伊力特	5,200	89,700.00	0.07
498	300003	乐普医疗	7,900	89,586.00	0.07
499	600580	卧龙电驱	5,200	89,388.00	0.07
500	600011	华能国际	13,200	89,364.00	0.07
501	600967	内蒙一机	10,500	89,250.00	0.07
502	688395	正弦电气	5,250	89,197.50	0.07
503	600416	湘电股份	7,900	89,191.00	0.07
503	600673	东阳光	7,900	89,191.00	0.07
504	300601	康泰生物	5,200	89,180.00	0.07
505	600511	国药股份	2,600	88,972.00	0.07
506	601528	瑞丰银行	15,800	88,954.00	0.07
507	600023	浙能电力	15,700	88,862.00	0.07
508	600256	广汇能源	13,200	88,836.00	0.07
509	000966	长源电力	18,700	88,825.00	0.07
510	600009	上海机场	2,600	88,790.00	0.07
511	300285	国瓷材料	5,200	88,608.00	0.07
512	300036	超图软件	5,200	88,296.00	0.07
513	300983	尤安设计	5,220	88,270.20	0.07
514	000998	隆平高科	7,900	88,243.00	0.07
515	605111	新洁能	2,600	88,166.00	0.07
516	601696	中银证券	7,900	88,164.00	0.07

517	300920	润阳科技	5,200	87,984.00	0.07
518	000933	神火股份	5,200	87,880.00	0.07
519	300618	寒锐钴业	2,600	87,802.00	0.07
520	002007	华兰生物	5,200	87,620.00	0.07
521	601995	中金公司	2,600	87,594.00	0.07
522	600989	宝丰能源	5,200	87,568.00	0.07
523	003816	中国广核	21,200	87,556.00	0.07
524	688132	邦彦技术	5,139	87,260.22	0.07
525	300315	掌趣科技	15,800	86,900.00	0.07
526	002465	海格通信	7,900	86,742.00	0.07
527	002466	天齐锂业	2,600	85,800.00	0.07
528	601108	财通证券	10,500	85,785.00	0.07
529	601669	中国电建	15,700	85,722.00	0.07
530	002226	江南化工	15,800	85,636.00	0.07
531	002673	西部证券	10,500	85,575.00	0.07
532	301196	唯科科技	2,600	85,462.00	0.07
533	600390	五矿资本	13,200	85,140.00	0.07
534	688655	迅捷兴	7,895	85,108.10	0.07
535	688251	井松智能	5,250	84,840.00	0.07
536	600933	爱柯迪	5,200	84,760.00	0.07
537	688701	卓锦股份	15,830	84,690.50	0.07
538	002157	正邦科技	29,000	84,680.00	0.07
539	600528	中铁工业	10,500	84,630.00	0.07
539	600867	通化东宝	10,500	84,630.00	0.07
540	688772	珠海冠宇	5,250	84,420.00	0.07
541	600338	西藏珠峰	7,900	84,293.00	0.07
542	601009	南京银行	7,900	84,135.00	0.07
543	002444	巨星科技	2,600	84,110.00	0.07
544	002600	领益智造	10,500	84,000.00	0.07
545	002646	天佑德酒	7,800	83,850.00	0.07
546	000629	钒钛股份	29,000	83,520.00	0.07
547	600316	洪都航空	2,600	83,512.00	0.07
548	600958	东方证券	7,900	83,424.00	0.07
549	000690	宝新能源	18,600	83,328.00	0.07
550	601975	招商南油	26,600	83,258.00	0.07
551	002236	大华股份	5,200	83,200.00	0.07
552	002812	恩捷股份	2,600	83,174.00	0.07
553	000875	吉电股份	15,800	83,108.00	0.07
554	601111	中国国航	10,500	83,055.00	0.07
555	300316	晶盛机电	2,600	82,940.00	0.07
556	603659	璞泰来	5,200	82,732.00	0.07
557	002532	天山铝业	10,500	82,635.00	0.07
558	600422	昆药集团	5,200	82,420.00	0.07

559	002439	启明星辰	5,200	82,264.00	0.07
560	301190	善水科技	5,200	82,108.00	0.07
561	300049	福瑞股份	2,600	82,004.00	0.07
562	002138	顺络电子	2,600	81,848.00	0.07
563	002155	湖南黄金	5,200	81,796.00	0.07
564	000766	通化金马	5,200	81,640.00	0.07
565	600699	均胜电子	5,200	81,484.00	0.06
566	600988	赤峰黄金	5,200	81,172.00	0.06
567	300034	钢研高纳	5,200	81,120.00	0.06
567	600499	科达制造	10,400	81,120.00	0.06
567	600903	贵州燃气	10,400	81,120.00	0.06
568	603077	和邦生物	39,500	80,580.00	0.06
569	002294	信立泰	2,600	80,418.00	0.06
570	600582	天地科技	13,000	80,340.00	0.06
571	300284	苏交科	7,900	80,185.00	0.06
572	600859	王府井	5,200	80,132.00	0.06
573	601567	三星医疗	2,600	79,976.00	0.06
574	000415	渤海租赁	21,200	79,924.00	0.06
574	000975	山金国际	5,200	79,924.00	0.06
575	300181	佐力药业	5,200	79,872.00	0.06
576	600166	福田汽车	31,600	79,316.00	0.06
577	600873	梅花生物	7,900	79,237.00	0.06
578	601881	中国银河	5,200	79,196.00	0.06
579	002373	千方科技	7,800	79,092.00	0.06
580	301365	矩阵股份	5,200	79,040.00	0.06
581	000598	兴蓉环境	10,400	78,936.00	0.06
582	688367	工大高科	5,139	78,935.04	0.06
583	000786	北新建材	2,600	78,806.00	0.06
584	600848	上海临港	7,800	78,780.00	0.06
585	688669	聚石化学	5,092	78,620.48	0.06
586	002661	克明食品	7,800	78,468.00	0.06
587	603806	福斯特	5,280	78,144.00	0.06
588	601098	中南传媒	5,200	78,052.00	0.06
589	600398	海澜之家	10,400	78,000.00	0.06
590	603311	金海高科	7,800	77,922.00	0.06
591	002422	科伦药业	2,600	77,818.00	0.06
592	600461	洪城环境	7,800	77,610.00	0.06
593	601218	吉鑫科技	23,800	77,588.00	0.06
594	002332	仙琚制药	7,800	77,532.00	0.06
595	002078	太阳纸业	5,200	77,324.00	0.06
596	000630	铜陵有色	23,800	76,874.00	0.06
597	002286	保龄宝	10,400	76,752.00	0.06
598	600598	北大荒	5,200	76,700.00	0.06

599	300633	开立医疗	2,600	76,414.00	0.06
600	601952	苏垦农发	7,800	76,362.00	0.06
601	002429	兆驰股份	13,200	76,296.00	0.06
601	603300	华铁应急	13,200	76,296.00	0.06
602	300529	健帆生物	2,600	76,284.00	0.06
602	600258	首旅酒店	5,200	76,284.00	0.06
603	600435	北方导航	7,800	76,128.00	0.06
604	600845	宝信软件	2,600	76,076.00	0.06
605	002136	安纳达	7,800	76,050.00	0.06
605	600729	重庆百货	2,600	76,050.00	0.06
606	600325	华发股份	13,200	76,032.00	0.06
607	600566	济川药业	2,600	75,608.00	0.06
608	002867	周大生	5,200	75,556.00	0.06
609	002557	洽洽食品	2,600	75,530.00	0.06
610	600516	方大炭素	15,600	75,348.00	0.06
611	002299	圣农发展	5,200	75,296.00	0.06
612	300332	天壕能源	13,000	75,270.00	0.06
613	600535	天士力	5,200	75,192.00	0.06
614	600378	昊华科技	2,600	75,166.00	0.06
615	000519	中兵红箭	5,200	75,140.00	0.06
615	000921	海信家电	2,600	75,140.00	0.06
616	600004	白云机场	7,800	74,880.00	0.06
617	603688	石英股份	2,600	74,698.00	0.06
618	601699	潞安环能	5,200	74,672.00	0.06
618	601918	新集能源	10,400	74,672.00	0.06
619	000636	风华高科	5,200	74,620.00	0.06
620	603056	德邦股份	5,200	74,516.00	0.06
621	300253	卫宁健康	10,400	74,464.00	0.06
622	600027	华电国际	13,200	74,052.00	0.06
622	601636	旗滨集团	13,200	74,052.00	0.06
623	600970	中材国际	7,800	73,944.00	0.06
624	600888	新疆众和	10,400	73,840.00	0.06
625	000683	远兴能源	13,200	73,788.00	0.06
625	600233	圆通速递	5,200	73,788.00	0.06
626	002003	伟星股份	5,200	73,684.00	0.06
626	600188	兖矿能源	5,200	73,684.00	0.06
627	300777	中简科技	2,600	73,554.00	0.06
628	000917	电广传媒	10,400	73,528.00	0.06
629	603005	晶方科技	2,600	73,450.00	0.06
630	600971	恒源煤电	7,800	73,398.00	0.06
631	603308	应流股份	5,200	73,320.00	0.06
632	002180	纳思达	2,600	73,242.00	0.06
633	600985	淮北矿业	5,200	73,164.00	0.06

634	000960	锡业股份	5,200	72,956.00	0.06
635	000831	中国稀土	2,600	72,930.00	0.06
636	002568	百润股份	2,600	72,826.00	0.06
637	301115	建科股份	5,200	72,748.00	0.06
638	600116	三峡水利	10,400	72,696.00	0.06
639	600929	雪天盐业	13,000	72,670.00	0.06
640	300717	华信新材	5,200	72,436.00	0.06
641	603968	醋化股份	7,800	72,306.00	0.06
642	301105	鸿铭股份	2,600	72,280.00	0.06
643	000408	藏格矿业	2,600	72,098.00	0.06
644	600201	生物股份	10,500	72,030.00	0.06
645	600271	航天信息	7,900	71,969.00	0.06
646	000567	海德股份	10,500	71,715.00	0.06
647	603816	顾家家居	2,600	71,708.00	0.06
648	000617	中油资本	10,400	71,656.00	0.06
648	002240	盛新锂能	5,200	71,656.00	0.06
649	000400	许继电气	2,600	71,578.00	0.06
649	603882	金域医学	2,600	71,578.00	0.06
650	600821	金开新能	13,200	71,280.00	0.06
651	300876	蒙泰高新	2,600	71,240.00	0.06
652	603456	九洲药业	5,200	71,136.00	0.06
653	601001	晋控煤业	5,200	71,084.00	0.06
654	600118	中国卫星	2,600	70,980.00	0.06
655	601006	大秦铁路	10,400	70,512.00	0.06
656	002831	裕同科技	2,600	70,460.00	0.06
657	000723	美锦能源	15,600	70,356.00	0.06
657	000807	云铝股份	5,200	70,356.00	0.06
658	601456	国联证券	5,200	70,304.00	0.06
659	301088	戎美股份	5,200	70,148.00	0.06
660	000876	新希望	7,800	70,044.00	0.06
661	300413	芒果超媒	2,600	69,914.00	0.06
662	600754	锦江酒店	2,600	69,836.00	0.06
663	000980	众泰汽车	29,200	69,788.00	0.06
664	000012	南玻A	13,200	69,696.00	0.06
665	600895	张江高科	2,600	69,680.00	0.06
666	301077	星华新材	2,600	69,498.00	0.06
667	600059	古越龙山	7,800	69,264.00	0.06
668	300765	新诺威	2,600	69,134.00	0.06
669	603613	国联股份	2,600	69,108.00	0.06
670	688728	格科微	5,139	69,068.16	0.06
671	002151	北斗星通	2,600	69,004.00	0.05
672	002327	富安娜	7,800	68,952.00	0.05
673	600927	永安期货	5,200	68,588.00	0.05

674	000099	中信海直	2,600	68,536.00	0.05
675	601633	长城汽车	2,600	68,458.00	0.05
676	300122	智飞生物	2,600	68,380.00	0.05
677	600916	中国黄金	7,900	68,098.00	0.05
678	600109	国金证券	7,800	68,094.00	0.05
679	002670	国盛金控	5,200	68,068.00	0.05
680	003039	顺控发展	5,200	68,016.00	0.05
681	300083	创世纪	10,400	67,704.00	0.05
682	001203	大中矿业	7,800	67,548.00	0.05
683	601717	郑煤机	5,200	67,496.00	0.05
684	002244	滨江集团	7,800	67,158.00	0.05
685	300298	三诺生物	2,600	67,106.00	0.05
686	300943	春晖智控	5,200	67,028.00	0.05
687	600529	山东药玻	2,600	67,002.00	0.05
688	300759	康龙化成	2,600	66,820.00	0.05
689	600123	兰花科创	7,800	66,768.00	0.05
690	601872	招商轮船	10,400	66,664.00	0.05
691	000589	贵州轮胎	13,200	66,396.00	0.05
692	601236	红塔证券	7,800	66,222.00	0.05
693	301373	凌玮科技	2,600	65,988.00	0.05
694	600388	ST 龙净	5,200	65,780.00	0.05
695	300677	英科医疗	2,600	65,728.00	0.05
696	002372	伟星新材	5,200	65,676.00	0.05
697	000422	湖北宜化	5,200	65,624.00	0.05
697	601020	华钰矿业	5,200	65,624.00	0.05
698	688178	万德斯	5,250	65,572.50	0.05
699	000703	恒逸石化	10,400	65,312.00	0.05
700	002360	同德化工	13,200	64,944.00	0.05
701	300775	三角防务	2,600	64,818.00	0.05
702	001696	宗申动力	2,600	64,740.00	0.05
703	605358	立昂微	2,600	64,402.00	0.05
704	000983	山西焦煤	7,800	64,272.00	0.05
704	600129	太极集团	2,600	64,272.00	0.05
705	000301	东方盛虹	7,800	64,038.00	0.05
706	300364	中文在线	2,600	63,778.00	0.05
707	603939	益丰药房	2,640	63,703.20	0.05
708	601878	浙商证券	5,200	63,648.00	0.05
709	300327	中颖电子	2,600	63,622.00	0.05
710	002675	东诚药业	5,200	63,544.00	0.05
711	688327	云从科技	5,250	63,525.00	0.05
712	002262	恩华药业	2,600	63,310.00	0.05
713	002317	众生药业	5,200	63,180.00	0.05
714	600801	华新水泥	5,200	62,920.00	0.05

715	000791	甘肃能源	10,400	62,712.00	0.05
716	300146	汤臣倍健	5,200	62,660.00	0.05
717	000729	燕京啤酒	5,200	62,608.00	0.05
718	601677	明泰铝业	5,200	62,556.00	0.05
719	301189	奥尼电子	2,600	62,530.00	0.05
720	301237	和顺科技	2,600	62,400.00	0.05
721	300118	东方日升	5,200	62,296.00	0.05
722	601155	新城控股	5,200	62,192.00	0.05
723	600282	南钢股份	13,200	61,908.00	0.05
724	000543	皖能电力	7,800	61,698.00	0.05
725	601916	浙商银行	21,200	61,692.00	0.05
726	603578	三星新材	5,200	61,620.00	0.05
727	600546	山煤国际	5,200	61,516.00	0.05
728	601233	桐昆股份	5,200	61,360.00	0.05
729	605589	圣泉集团	2,600	61,308.00	0.05
730	000039	中集集团	7,800	60,606.00	0.05
731	000990	诚志股份	7,800	60,450.00	0.05
732	600026	中远海能	5,200	60,320.00	0.05
732	600399	抚顺特钢	10,400	60,320.00	0.05
733	601179	中国西电	7,900	59,961.00	0.05
734	603182	嘉华股份	5,200	59,852.00	0.05
735	600331	宏达股份	7,800	59,436.00	0.05
736	603156	养元饮品	2,600	59,384.00	0.05
737	002154	报喜鸟	13,200	58,212.00	0.05
738	600884	杉杉股份	7,800	58,110.00	0.05
739	002414	高德红外	7,800	57,954.00	0.05
740	002556	辉隆股份	10,400	57,928.00	0.05
741	000426	兴业银锡	5,200	57,824.00	0.05
742	002176	江特电机	7,800	57,798.00	0.05
743	600732	爱旭股份	5,200	57,304.00	0.05
743	603000	人民网	2,600	57,304.00	0.05
744	600872	中炬高新	2,600	57,252.00	0.05
745	600750	江中药业	2,500	56,750.00	0.05
746	002430	杭氧股份	2,600	56,680.00	0.05
747	300078	思创医惠	18,600	56,544.00	0.05
748	300133	华策影视	7,800	56,316.00	0.04
749	002508	老板电器	2,600	55,718.00	0.04
750	002287	奇正藏药	2,600	55,640.00	0.04
751	000410	沈阳机床	7,800	55,458.00	0.04
752	600348	华阳股份	7,800	55,302.00	0.04
753	000403	派林生物	2,600	54,938.00	0.04
754	300762	上海瀚讯	2,600	54,678.00	0.04
755	300045	华力创通	2,600	54,314.00	0.04

756	600901	江苏租赁	10,400	54,288.00	0.04
757	600759	ST 洲际	23,900	54,253.00	0.04
758	601333	广深铁路	15,800	54,194.00	0.04
759	301212	联盛化学	2,600	53,742.00	0.04
760	603733	仙鹤股份	2,600	53,638.00	0.04
761	600193	创兴资源	15,800	53,562.00	0.04
762	000893	亚钾国际	2,600	52,416.00	0.04
763	601666	平煤股份	5,200	52,104.00	0.04
764	301317	鑫磊股份	2,600	51,714.00	0.04
765	688718	唯赛勃	5,139	51,390.00	0.04
766	601865	福莱特	2,600	51,194.00	0.04
767	300824	北鼎股份	5,200	50,856.00	0.04
768	603712	七一二	2,600	50,622.00	0.04
769	600312	平高电气	2,600	49,920.00	0.04
770	600131	国网信通	2,600	49,166.00	0.04
771	600133	东湖高新	5,200	48,620.00	0.04
772	003008	开普检测	2,650	47,488.00	0.04
773	002493	荣盛石化	5,200	47,060.00	0.04
774	603298	杭叉集团	2,600	46,514.00	0.04
775	600761	安徽合力	2,600	45,890.00	0.04
776	002270	华明装备	2,600	43,914.00	0.03
777	000932	华菱钢铁	10,400	43,472.00	0.03
778	002603	以岭药业	2,600	41,626.00	0.03
779	601059	信达证券	2,600	38,948.00	0.03
780	600611	大众交通	5,200	35,880.00	0.03

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	688605	先锋精科	590	31,671.20	0.03
2	688449	联芸科技	562	16,545.28	0.01
3	603072	天和磁材	1,206	14,833.80	0.01
4	688750	金天钛业	884	13,648.96	0.01
5	688708	佳驰科技	250	12,237.50	0.01
6	301622	英思特	187	8,400.04	0.01
7	001391	国货航	1,100	7,480.00	0.01
8	301585	蓝宇股份	162	5,807.70	0.00
9	301631	壹连科技	55	5,607.80	0.00
10	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
11	301617	博苑股份	137	5,451.23	0.00
12	603194	中力股份	120	3,375.60	0.00
13	603205	健尔康	120	3,282.00	0.00

14	603350	安乃达	67	2,423.39	0.00
15	835185	贝特瑞	100	1,961.00	0.00
16	603285	键邦股份	62	1,401.82	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,826,264.00	0.63
2	000333	美的集团	953,965.00	0.33
3	688047	龙芯中科	934,260.53	0.32
4	000858	五粮液	841,033.00	0.29
5	300760	迈瑞医疗	813,296.00	0.28
6	300308	中际旭创	788,866.00	0.27
7	688114	华大智造	776,252.07	0.27
8	000651	格力电器	741,564.00	0.25
9	300059	东方财富	671,517.00	0.23
10	002594	比亚迪	669,174.00	0.23
11	002475	立讯精密	560,815.08	0.19
12	300237	美晨科技	501,840.00	0.17
13	300274	阳光电源	489,525.00	0.17
14	301115	建科股份	473,213.00	0.16
15	688101	三达膜	455,065.64	0.16
16	002352	顺丰控股	451,735.00	0.16
17	688041	海光信息	449,933.54	0.15
18	300078	思创医惠	441,882.00	0.15
19	000725	京东方 A	435,883.00	0.15
20	000402	金融街	433,889.00	0.15

注：不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,346,579.60	1.49
2	000333	美的集团	2,398,324.00	0.82
3	000858	五粮液	2,133,926.00	0.73
4	300760	迈瑞医疗	2,131,399.00	0.73
5	002594	比亚迪	1,639,796.00	0.56
6	300059	东方财富	1,509,860.00	0.52
7	002475	立讯精密	1,463,218.00	0.50

8	000651	格力电器	1,335,782.00	0.46
9	300308	中际旭创	1,276,184.00	0.44
10	688012	中微公司	1,259,915.15	0.43
11	002415	海康威视	1,246,955.00	0.43
12	000725	京东方 A	1,228,722.00	0.42
13	600809	山西汾酒	1,215,777.00	0.42
14	000568	泸州老窖	1,204,226.00	0.41
15	300394	天孚通信	963,667.00	0.33
16	002714	牧原股份	921,902.00	0.32
17	300124	汇川技术	901,293.00	0.31
18	002142	宁波银行	868,973.00	0.30
19	300498	温氏股份	853,502.00	0.29
20	000063	中兴通讯	830,767.00	0.29

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	124,976,748.92
卖出股票收入（成交）总额	204,691,171.11

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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情形。

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	1,418,992.40
2	应收清算款	127,092.59
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	1,546,084.99

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	688605	先锋精科	31,671.20	0.03	新股锁定期内
2	688449	联芸科技	16,545.28	0.01	新股锁定期内

3	603072	天和磁材	13,345.50	0.01	新股未上市
3	603072	天和磁材	1,488.30	0.00	新股锁定期内
4	688750	金天钛业	13,648.96	0.01	新股锁定期内
5	688708	佳驰科技	12,237.50	0.01	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 (%)
1,505	25,621.68	28,041,799.00	72.72	10,518,822.00	27.28

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	6,675,340.00	17.31
2	中信建投证券有限责任公司	5,400,287.00	14.00
3	浙商证券股份有限公司	2,623,429.00	6.80
4	招商证券股份有限公司	2,246,368.00	5.83
5	国联证券股份有限公司	1,500,000.00	3.89
6	长安基金—中信银行—长安百宝象优选3号集合资产管理计划	1,301,597.00	3.38
7	广发证券股份有限公司	1,033,179.00	2.68
8	建信资本—建设银行—建信资本恒利 FOF3 号集合资产管理计划	854,800.00	2.22
9	中信证券股份有限公司	815,632.00	2.12
10	建信资本—建设银行—建信资本恒利 FOF1 号集合资产管理计划	804,800.00	2.09

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、基金投资和研究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）	635,421,000.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	299,421,000.00
本报告期基金总申购份额	74,201,025.00
减：本报告期基金总赎回份额	247,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-87,661,404.00
本报告期期末基金份额总额	38,560,621.00

§ 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

基金管理人重大人事变动：

2024 年 1 月 19 日，公司股东会书面决定尹雷先生担任公司独立董事，陆桢女士不再担任公司独立董事。

2024 年 7 月 2 日，经公司董事会审议通过，柳军先生、王文慧女士任公司副总经理。

2024 年 7 月 12 日，经公司董事会审议通过，李晓西先生不再担任公司副总经理。

2024 年 7 月 2 日，柳军先生任公司副总经理，根据法规要求，不再担任职工监事。

2024 年 7 月 11 日，公司全体员工投票推选赵景云女士担任公司职工监事。

2024 年 8 月 16 日，公司股东会书面决定卢龙威先生担任公司监事，卞时珍女士不再担任公司监事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 40,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

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

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到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(%)	
方正证券	4	123,017,225.50	37.50	19,597.17	14.24	-
广发证券	2	94,072,128.58	28.68	57,004.27	41.43	-
中信建投	2	51,179,841.52	15.60	48,411.88	35.19	-
招商证券	2	41,024,364.75	12.51	8,205.44	5.96	-
平安证券	2	17,926,109.98	5.46	3,585.87	2.61	-
银河证券	2	831,414.65	0.25	778.14	0.57	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-

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

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司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综合考虑下列因素：

(1) 具有相应的业务经营资格；

(2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时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，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；

(4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 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；

(6) 被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1) 公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

(2) 基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

(3) 如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

4、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(%)
广发证券	12,598.50	11.21	-	-	-	-
方正证券	49,720.00	44.25	-	-	-	-
中信建投	45,221.82	40.24	-	-	-	-
招商证券	4,827.42	4.30	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
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旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 19 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	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 05 日

	公告		
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期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 27 日
4	关于同意浙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	2024 年 11 月 20 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 18 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 02 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 14 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额合并及调整最小申购、赎回单位相关业务安排的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 08 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额合并及调整最小申购、赎回单位相关业务安排的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 01 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 27 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 19 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳前海财厚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 04 日
13	关于同意光大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一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 08 月 21 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 08 月 16 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 24 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 19 日

	优惠活动的公告		
17	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	2024 年 07 月 13 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止喜鹊财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	2024 年 07 月 06 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	2024 年 07 月 03 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 24 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 21 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
28	关于同意海通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	2024 年 01 月 29 日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20240520-20240521;20240528-20240528; 20240613-20240619;20241022-20241029; 20241031-20241031;	25,088,400.00	99,431,828.00	117,844,888.00	6,675,340.00	17.31
产品特有风险							
本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回,可能导致巨额赎回,从而引发流动性风险,可能对基金产生如下影响:(1)延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时,投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。(2)基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现,这将对基金资产净值产生不利影响,同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题,这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。(3)基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小,基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形,从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。(4)基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向,审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响,同时将完善流动性风险管控机制,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。							

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

2025 年 3 月 31 日