

华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 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，德勤华永会计师事务所（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 12 日（基金合同生效日）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	6
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	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	50

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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	69
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	69
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	69
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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	71
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	71
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强	
基金主代码	019923	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 12 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	146,324,238.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019923	019924
报告期末下属分级基金的份额总额	42,723,975.54 份	103,600,262.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	<p>1、股票投资策略 本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。</p> <p>2、债券投资策略 本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>4、衍生品投资策略 为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。</p> <p>5、存托凭证投资策略 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>6、融资及转融通证券出借业务的投资策略 本基金在参与融资及转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资及转融</p>

	通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95599
传真	021-38601799	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200135	100031
法定代表人	贾波	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 21 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 弄证大五道口广场 1 号楼 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	2024 年 1 月 12 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	2,553,833.01	5,724,807.05
本期利润	1,672,443.12	-2,655,189.28
加权平均基金份额本期利润	0.0144	-0.0220
本期加权平均	1.54%	-2.33%

净值利润率		
本期基金份额净值增长率	16.73%	16.29%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	
期末可供分配利润	7,148,260.05	16,871,429.13
期末可供分配基金份额利润	0.1673	0.1629
期末基金资产净值	49,872,235.59	120,471,692.09
期末基金份额净值	1.1673	1.1629
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	
基金份额累计净值增长率	16.73%	16.29%

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。

4、本基金成立于 2024 年 01 月 12 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.19%	2.51%	8.08%	2.53%	6.11%	-0.02%
过去六个月	35.57%	2.24%	26.23%	2.27%	9.34%	-0.03%
自基金合同生效之日起至今	16.73%	1.81%	1.54%	2.35%	15.19%	-0.54%

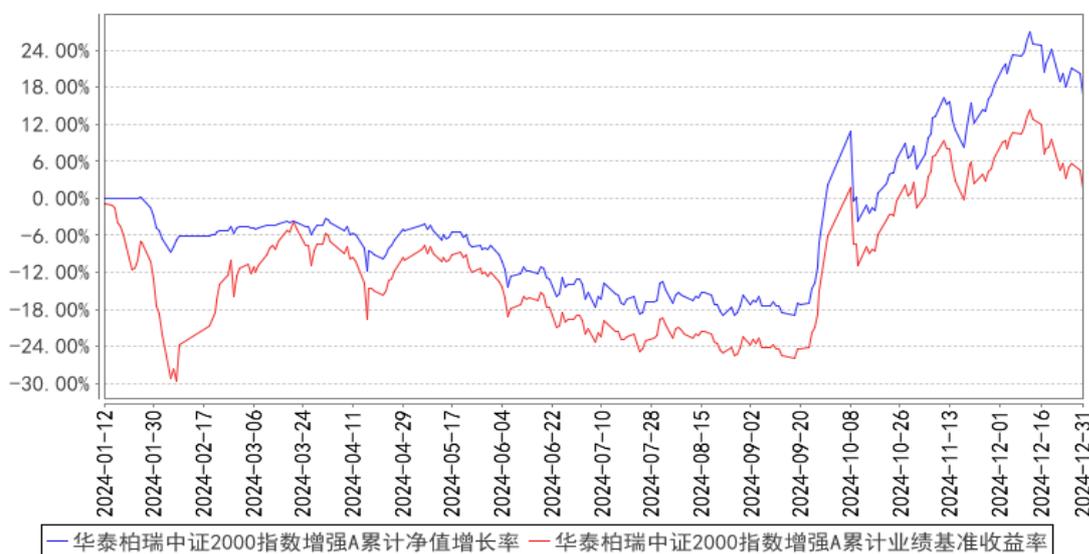
华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

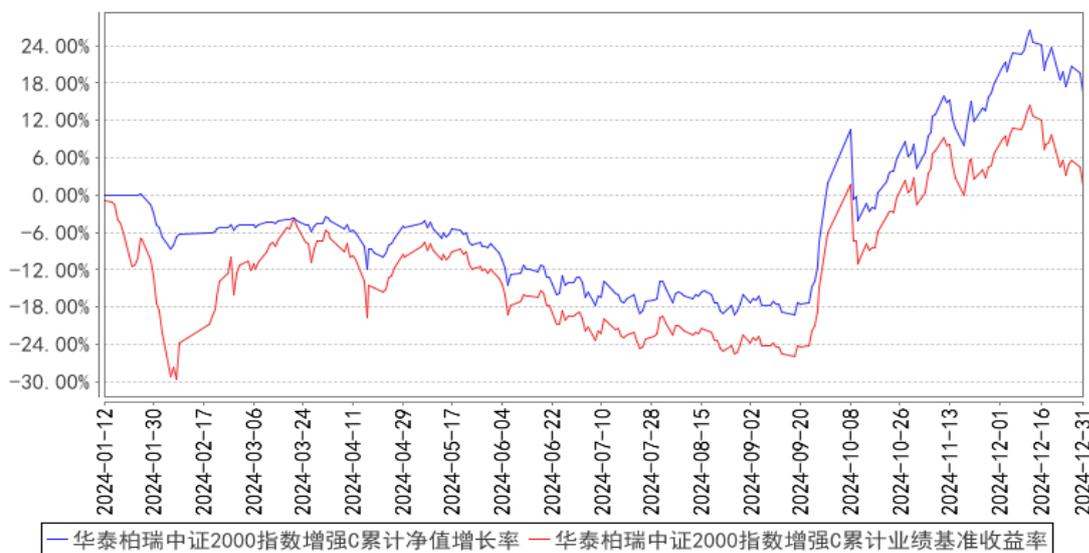
	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	14.09%	2.51%	8.08%	2.53%	6.01%	-0.02%
过去六个月	35.32%	2.24%	26.23%	2.27%	9.09%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	16.29%	1.81%	1.54%	2.35%	14.75%	-0.54%

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2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞中证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、A类图示日期为2024年1月12日（基金合同生效日）至2024年12月31日。C类图示日

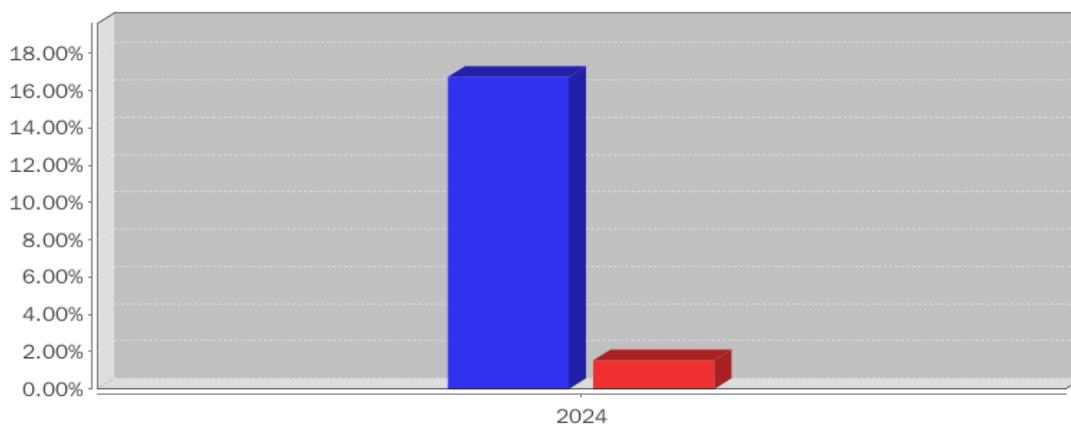
期为 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日。

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、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

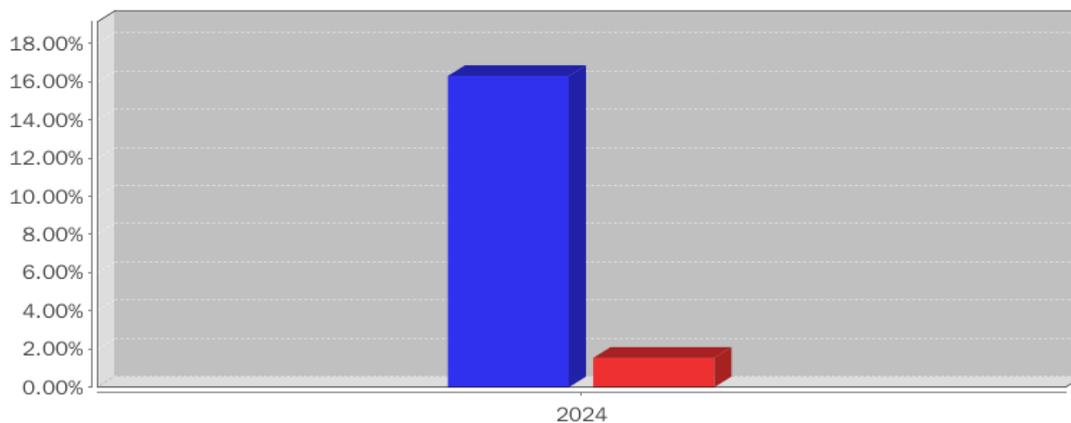
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞中证2000指数增强A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



■ 华泰柏瑞中证2000指数增强A净值增长率
■ 华泰柏瑞中证2000指数增强A业绩基准收益率

华泰柏瑞中证2000指数增强C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



■ 华泰柏瑞中证2000指数增强C净值增长率
■ 华泰柏瑞中证2000指数增强C业绩基准收益率

注：本基金合同自 2024 年 1 月 12 日起生效，2024 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		
雷文渊	本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	6 年	复旦大学数学学院本科、金融专业硕士。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2022 年 8 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
孔令焯	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	9 年	英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份公司高级分析师。2017 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
盛豪	量化与海外投资部总监、本基金的基金经理	2024 年 1 月 12 日	-	17 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。现任量化与海外投资部总监。2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金。2015 年 10 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞量化驱动灵活

				配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 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。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2024 年 10 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 11 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金和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的基金经理。2023 年 3 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
盛豪	公募基金	5	1,643,918,024.88	2015 年 10 月 13 日
	私募资产管理计划	3	404,592,501.69	2024 年 11 月 8 日

	其他组合	-	-	-
	合计	8	2,048,510,526.57	-

注：本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，盛豪离任产品情况：

- ① 产品类型：公募，离任数量：3 只，离任时间：2024-9-19、2024-10-11；
- ② 产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1 只；离任时间：2024-12-24。

4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩不直接与兼任基金经理薪酬激励挂钩，公司会根据实际情况对兼任基金经理的公募产品及所管理的私募资产管理计划分别进行考核，并依据考核结果对薪酬激励进行评定和调整。

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

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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合投资交易行为加强管理、监控和分析，防范不公平交易。包括：原则上采取“多基金指令”下达投资指令，以实现“同时同价”，因产品策略、头寸变化等原因导致无法“同时同价”的，公司每日分析交易流水，并定期通过公平交易系统进行价差监控管理，以加强事后分析。兼任的不同组合间原则上不得进行同日反向交易，遇到特殊情况需要提出申请。风险管理部每日对兼任组合间多个时间窗口下同向及反向交易价差进行监控，强化控制和监测。风险管理部定期对不同投资组合的公平交易情况进行监控和分析，相关投资组合经理对异常交易情况进行说明，风险管理部进行严格复核与独立评估，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，合规法律部对兼任公平交易制度以及其它交易相关规定的贯彻情况进行不定期监察稽核。

本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

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 全年，A 股一波三折，整体呈现先震荡下行，后反弹并维持高位震荡的走势。年初市场从短期资金流造成的剧烈波动中恢复，但数据显示经济基本面复苏依然缓慢，市场震荡下行。9 月底政府出台的一系列刺激政策大超市场预期，叠加外资空头回补，A 股迎来剧烈反弹。市场主

要宽基指数创出年内新高之后，股市活跃度维持在高位，主题行情持续到年底。全年看，A 股市场中银行、能源、公用事业等高股息相关行业整体表现较稳健，而以人工智能创新链为主的 TMT 相关行业，尤其是半导体产业链在后半程跑赢市场。

本报告期，代表大市值公司的上证 50、沪深 300 分别上涨 15.42%和 14.68%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数上涨 18.76%；代表小市值公司的中证 1000 和中证 2000 指数同期涨幅分别为 1.20%和-2.14%。横向比较来看，代表核心资产的大市值公司和的高股息类上市公司，在全年来看跑赢中小市值公司。

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，在风格急剧切换的行情下，我们严控风险，力求减小组合超额的波动。由于我们始终保持高仓位运作，基本不做仓位择时，因而在本轮市场出现的急剧反弹中，超额收益虽受到仓位和份额申赎的拖累，但横向相比，影响相对较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1673 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.73%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1629 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.29%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，A 股市场主要受国内国外两方面因素影响。四季度，国内宏观经济数据已显示出止跌企稳迹象。随着地方政府“化债”问题提上日程表，以及央行实行适度宽松的货币政策，政府和企业的融资成本有望进一步降低，居民的还贷压力还将进一步减轻。同时我们预期财政将进一步发力，促消费扩内需的一系列增量政策仍将延续。海外，美国新一届政府即将上台，其贸易政策短期对中国的出口产业带来一定的不确定性，中长期我们仍然看好中国产业链的国际竞争力。年初以来，我们认为最大的变化在于，一系列突破性的科技成果及其转化已经扭转了市场之前对于国内科技产业链的担忧，在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的上升区间。考虑到外部仍有一定的不确定因素，在不出现极端情况的前提下，我们认为 A 股市场短期风险可控，对于中长期表现则更为乐观。

量化策略方面，在经历短期剧烈的反弹后，市场将会重新回到轮动的行情，绩优和有主题热度的股票更容易受到资金的关注，有利于技术面因子通过捕捉资金流特征，获取超额。另一方面，基本面因子挑选出绩优低估，且具有不错成长性的股票，增加模型的稳定性。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值仍有吸引力，经济基本面向好。我们在坚持控

制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的超额收益。

4.6 管理人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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华泰柏瑞基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华泰柏瑞基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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	德师报(审)字(25)第 P02893 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	-	
审计意见	-	
形成审计意见的基础	-	
强调事项	-	
其他事项	-	
其他信息	-	
管理层和治理层对财务报表的责任	-	
注册会计师对财务报表审计的责任	-	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	胡小骏	冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
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 2000 指数增强型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	7.4.7.1	15,334,554.82
结算备付金		545,899.21
存出保证金		571,756.80
交易性金融资产	7.4.7.2	155,190,907.75
其中：股票投资		155,190,907.75
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	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		4,891,784.31
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		176,534,902.89
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日
负债:		
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		-
应付清算款		-
应付赎回款		5,903,688.87
应付管理人报酬		97,495.15
应付托管费		12,186.90
应付销售服务费		32,257.04
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	145,347.25
负债合计		6,190,975.21
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	146,324,238.50
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	24,019,689.18
净资产合计		170,343,927.68
负债和净资产总计		176,534,902.89

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额为 146,324,238.50 份，其中华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金 A 类份额净值 1.1673 元，基金份额总额 42,723,975.54 份；华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金 C 类份额净值 1.1629 元，基金份额总额 103,600,262.96 份。

2、本基金合同生效日为 2024 年 01 月 12 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 01 月 12 日至 2024 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同 生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,577,822.77
1. 利息收入		1,036,653.16
其中：存款利息收入	7.4.7.13	671,164.26
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		365,488.90
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,851,448.17
其中：股票投资收益	7.4.7.14	7,916,340.93
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-362,434.04
股利收益	7.4.7.19	1,297,541.28
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	-9,261,386.22
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	951,107.66
减：二、营业总支出		2,560,568.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,748,668.84
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	218,583.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	447,006.47
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		-
8. 其他费用	7.4.7.23	146,310.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		-982,746.16

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-982,746.16
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-982,746.16

注：本基金合同生效日为 2024 年 01 月 12 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 01 月 12 日至 2024 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	433,027,203.26	-	-	433,027,203.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-286,702,964.76	-	24,019,689.18	-262,683,275.58
（一）、综合收益总额	-	-	-982,746.16	-982,746.16
（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）	-286,702,964.76	-	25,002,435.34	-261,700,529.42
其中：1. 基金申购款	191,806,163.03	-	28,138,158.93	219,944,321.96
2. 基金赎回款	-478,509,127.79	-	-3,135,723.59	-481,644,851.38
（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	146,324,238.50	-	24,019,689.18	170,343,927.68

注：本基金合同生效日为 2024 年 01 月 12 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 01 月 12 日至 2024 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2362 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 432,911,777.68 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(2024)第 0017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 433,027,203.26 份基金份额，其中认购资金利息折合 115,425.58 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时

不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)、货币市场工具(含同业存单)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率 \times 95%+人民币活期存款税后利率 \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2025 年 03 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 01 月 12 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 01 月 12 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 01 月 12 日(基金合同生效日)至 2024 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。

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。

(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。

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

本基金同一类别的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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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日前取得的基金、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基金份额净值、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
活期存款	15,334,554.82
等于：本金	15,333,096.65
加：应计利息	1,458.17
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	15,334,554.82

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	164,144,187.31	-	155,190,907.75	-8,953,279.56
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	164,144,187.31	-	155,190,907.75	-8,953,279.56

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	5,072,746.66	-	-	
其中： 股指期货投资	5,072,746.66	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	5,072,746.66	-	-	

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
IM2501	中证1000股指期货 2501	4.00	4,764,640.00	-308,106.66
合计				-308,106.66
减：可抵销期货暂收款				-308,106.66

净额					0.00
----	--	--	--	--	------

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
----	-------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	347.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	145,000.00
合计	145,347.25

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	218,645,473.34	218,645,473.34
本期申购	30,583,511.43	30,583,511.43
本期赎回（以“-”号填列）	-206,505,009.23	-206,505,009.23
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	42,723,975.54	42,723,975.54

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	214,381,729.92	214,381,729.92
本期申购	161,222,651.60	161,222,651.60
本期赎回（以“-”号填列）	-272,004,118.56	-272,004,118.56
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	103,600,262.96	103,600,262.96

注：1、申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2023 年 12 月 20 日至 2024 年 1 月 10 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 432,911,777.68 元，折合为 432,911,777.68 份基金份额（其中 A 类基金份额 218,563,551.66 份，C 类基金份额 214,348,226.02 份）。根据《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币

115,425.58 元在本基金成立后,折合为 115,425.58 份基金份额(其中 A 类基金份额 81,921.68 份, C 类基金份额 33,503.90 份),划入基金份额持有人账户。

3、根据《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》及《华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回(转换、定期定额投资)业务公告》的相关规定,本基金于 2024 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2024 年 3 月 24 日止期间暂不向投资人开放基金交易,申购、转换和定期定额投资业务自 2024 年 3 月 25 日起开始办理。

7.4.7.11 其他综合收益

注:本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位:人民币元

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,553,833.01	-881,389.89	1,672,443.12
本期基金份额交易产生的变动数	11,489,833.34	-6,014,016.41	5,475,816.93
其中:基金申购款	4,860,512.87	-785,480.84	4,075,032.03
基金赎回款	6,629,320.47	-5,228,535.57	1,400,784.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,043,666.35	-6,895,406.30	7,148,260.05

华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	5,724,807.05	-8,379,996.33	-2,655,189.28
本期基金份额交易产生的变动数	27,806,142.06	-8,279,523.65	19,526,618.41
其中:基金申购款	31,402,325.75	-7,339,198.85	24,063,126.90
基金赎回款	-3,596,183.69	-940,324.80	-4,536,508.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,530,949.11	-16,659,519.98	16,871,429.13

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	232,962.73
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	438,196.71
其他	4.82
合计	671,164.26

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,916,340.93
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,916,340.93

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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,506,252,220.02
减：卖出股票成本总额	2,495,586,563.44
减：交易费用	2,749,315.65
买卖股票差价收入	7,916,340.93

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期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：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

股指期货投资收益	-362,434.04
----------	-------------

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,297,541.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,297,541.28

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 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-8,953,279.56
股票投资	-8,953,279.56
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	-308,106.66
权证投资	-
期货投资	-308,106.66
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,261,386.22

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	919,409.28
基金转换费收入	31,698.38
合计	951,107.66

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	25,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
银行划款手续费	910.00
合计	146,310.00

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	5,164,927,745.74	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月12日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华泰证券	3,406,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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12日（基金合同生效日）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 (%)
华泰证券	1,165,929.91	100.00	-	-

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 2024年1月12日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,748,668.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	779,778.50

应支付基金管理人的净管理费	968,890.34
---------------	------------

注：自 2024 年 1 月 12 日(基金合同生效日)起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	218,583.62

注：自 2024 年 1 月 12 日(基金合同生效日)起支付基金托管人中国农业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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2024 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 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	合计
中国农业银行股份有限公司	0.00	203,486.82	203,486.82
华泰证券股份有限公司	0.00	177,717.45	177,717.45
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	497.77	497.77
合计	0.00	381,702.04	381,702.04

注：自 2024 年 1 月 12 日起，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，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：本基金本期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，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，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12日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	4,592,994.75	171,811.49
华泰证券	10,741,560.07	61,151.24

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金的券商保证金为存放在华泰证券基金专用账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

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12日（基金合同生效日）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	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

华泰联合证券	301606	绿联科技	网下申购	2,193	46,513.53
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	1,126	25,177.36

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。本基金成立于 2024 年 01 月 12 日，无上年可比期间数据。

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
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	2.30	6.80	795	1,828.50	5,406.00	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	6.88	24.84	665	4,575.20	16,518.60	-
301551	无线传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科	2024 年 8 月	6 个月	新股锁定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-

	天成	14 日		期内						
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	23.95	35.85	117	2,802.15	4,194.45	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	26.50	41.98	170	4,505.00	7,136.60	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	21.21	36.49	220	4,666.20	8,027.80	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	44.50	65.38	107	4,761.50	6,995.66	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	8.00	56.10	605	4,840.00	33,940.50	-
301613	新铝时代	2024 年 10 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	27.70	41.77	152	4,210.40	6,349.04	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	27.76	39.79	87	2,415.12	3,461.73	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	22.36	44.92	113	2,526.68	5,075.96	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	21.23	65.78	742	15,752.66	48,808.76	-

301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股锁定期内	72.99	101.96	41	2,992.59	4,180.36	-
--------	------	-------------	-----	--------	-------	--------	----	----------	----------	---

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
000777	中核科技	2024年12月30日	重大事项停牌	18.07	2025年01月14日	19.88	8,500	144,953.00	153,595.00	-

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现超越标的指数的投资收益，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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

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。

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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 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	15,334,554.82	-	-	-	-	-	15,334,554.82
结算备付金	545,899.21	-	-	-	-	-	545,899.21
存出保证金	571,756.80	-	-	-	-	-	571,756.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	155,190,907.75	155,190,907.75
应收申购款	-	-	-	-	-	4,891,784.31	4,891,784.31
资产总计	16,452,210.83	-	-	-	-	160,082,692.06	176,534,902.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,903,688.87	5,903,688.87

应付管理人报酬	-	-	-	-	97,495.15	97,495.15
应付托管费	-	-	-	-	12,186.90	12,186.90
应付销售服务费	-	-	-	-	32,257.04	32,257.04
其他负债	-	-	-	-	145,347.25	145,347.25
负债总计	-	-	-	-	6,190,975.21	6,190,975.21
利率敏感度缺口	16,452,210.83	-	-	-	-153,891,716.85	170,343,927.68

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	155,190,907.75	91.10
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	155,190,907.75	91.10

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）
	业绩比较基准上升5%	5,099,747.48
	业绩比较基准下降5%	-5,099,747.48

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
第一层次	154,792,732.84
第二层次	153,595.00
第三层次	244,579.91
合计	155,190,907.75

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12日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	116,265.62	116,265.62
转出第三层次	-	66,621.11	66,621.11
当期利得或损失总额	-	194,935.40	194,935.40
其中：计入损益的利得或损失	-	194,935.40	194,935.40
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	244,579.91	244,579.91
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	-	160,462.06	160,462.06

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	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	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	244,579.91	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.4607~5.7444	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。

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	155,190,907.75	87.91
	其中：股票	155,190,907.75	87.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,880,454.03	9.00
8	其他各项资产	5,463,541.11	3.09
9	合计	176,534,902.89	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	793,866.00	0.47
B	采矿业	1,421,761.00	0.83

C	制造业	114,047,736.64	66.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,378,421.00	2.57
E	建筑业	2,197,837.00	1.29
F	批发和零售业	4,621,706.00	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	2,184,393.00	1.28
H	住宿和餐饮业	132,480.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,437,329.10	8.48
J	金融业	1,369,165.00	0.80
K	房地产业	2,586,351.00	1.52
L	租赁和商务服务业	536,466.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	3,762,871.02	2.21
N	水利、环境和公共设施管理业	962,973.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	221,184.00	0.13
Q	卫生和社会工作	238,420.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	1,113,216.99	0.65
S	综合	184,731.00	0.11
	合计	155,190,907.75	91.10

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

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	002164	宁波东力	241,400	1,209,414.00	0.71
2	002565	顺灏股份	316,500	962,160.00	0.56
3	300429	强力新材	76,300	914,837.00	0.54
4	300241	瑞丰光电	162,500	892,125.00	0.52
5	002546	新联电子	176,900	765,977.00	0.45
6	300507	苏奥传感	114,200	765,140.00	0.45
7	600525	长园集团	153,700	750,056.00	0.44
8	000965	天保基建	248,300	744,900.00	0.44
9	002338	奥普光电	19,700	743,084.00	0.44
10	300247	融捷健康	207,100	741,418.00	0.44
11	002476	宝莫股份	174,600	736,812.00	0.43
12	002376	新北洋	111,000	723,720.00	0.42
13	300066	三川智慧	178,200	702,108.00	0.41
14	300279	和晶科技	115,400	699,324.00	0.41
15	000790	华神科技	177,500	692,250.00	0.41
16	300088	长信科技	104,300	682,122.00	0.40

17	002522	浙江众成	173,600	678,776.00	0.40
18	002589	瑞康医药	224,400	666,468.00	0.39
19	603936	博敏电子	78,800	663,496.00	0.39
20	002442	龙星化工	109,100	655,691.00	0.38
21	300227	光韵达	77,400	644,742.00	0.38
22	002063	远光软件	108,800	626,688.00	0.37
23	000948	南天信息	37,200	622,356.00	0.37
24	000850	华茂股份	148,400	612,892.00	0.36
25	603618	杭电股份	112,600	611,418.00	0.36
26	300160	秀强股份	111,900	608,736.00	0.36
27	300400	劲拓股份	36,800	596,896.00	0.35
28	300184	力源信息	63,800	595,254.00	0.35
29	300460	惠伦晶体	49,000	594,860.00	0.35
30	300200	高盟新材	71,300	590,364.00	0.35
31	301338	凯格精机	18,800	586,560.00	0.34
32	601700	风范股份	130,200	585,900.00	0.34
33	300402	宝色股份	39,700	585,575.00	0.34
34	603687	大胜达	80,200	584,658.00	0.34
35	002224	三力士	135,200	584,064.00	0.34
36	000404	长虹华意	78,600	581,640.00	0.34
37	002375	亚厦股份	150,200	579,772.00	0.34
38	002454	松芝股份	86,900	577,885.00	0.34
39	002057	中钢天源	79,900	576,878.00	0.34
40	002909	集泰股份	114,700	570,059.00	0.33
41	600495	晋西车轴	146,700	557,460.00	0.33
42	000533	顺钠股份	91,800	556,308.00	0.33
43	002671	龙泉股份	122,400	554,472.00	0.33
44	002451	摩恩电气	88,100	553,268.00	0.32
45	300019	硅宝科技	37,700	551,928.00	0.32
46	603538	美诺华	43,400	551,614.00	0.32
47	002196	方正电机	102,700	550,472.00	0.32
48	300011	鼎汉技术	75,600	550,368.00	0.32
49	000551	创元科技	46,000	550,160.00	0.32
50	002686	亿利达	102,500	549,400.00	0.32
51	002562	兄弟科技	129,100	548,675.00	0.32
52	600268	国电南自	81,600	548,352.00	0.32
53	688202	美迪西	18,000	543,060.00	0.32
54	002455	百川股份	71,800	536,346.00	0.31
55	002735	王子新材	56,900	526,894.00	0.31
56	600468	百利电气	112,000	526,400.00	0.31
57	002845	同兴达	34,500	523,020.00	0.31
58	300259	新天科技	149,100	521,850.00	0.31
59	300317	珈伟新能	140,200	514,534.00	0.30

60	000839	中信国安	165,600	510,048.00	0.30
61	600758	辽宁能源	147,800	508,432.00	0.30
62	603386	骏亚科技	45,300	503,736.00	0.30
63	000514	渝开发	122,400	503,064.00	0.30
64	002342	巨力索具	155,000	500,650.00	0.29
65	002406	远东传动	77,000	496,650.00	0.29
66	002642	荣联科技	68,200	487,630.00	0.29
67	300194	福安药业	108,900	485,694.00	0.29
68	002106	莱宝高科	43,900	478,949.00	0.28
69	000017	深中华 A	82,500	478,500.00	0.28
70	300283	温州宏丰	86,900	477,081.00	0.28
71	000652	泰达股份	114,700	474,858.00	0.28
72	300466	赛摩智能	63,600	473,820.00	0.28
73	300120	经纬辉开	50,900	473,370.00	0.28
74	688025	杰普特	9,960	473,100.00	0.28
75	301277	新天地	34,200	472,986.00	0.28
76	002284	亚太股份	60,600	469,044.00	0.28
77	600727	鲁北化工	62,300	461,643.00	0.27
78	300510	金冠股份	108,800	461,312.00	0.27
79	300320	海达股份	47,800	458,880.00	0.27
80	300161	华中数控	17,400	458,316.00	0.27
81	002300	太阳电缆	85,200	454,968.00	0.27
82	002615	哈尔斯	57,200	454,740.00	0.27
83	000700	模塑科技	64,000	449,280.00	0.26
84	002579	中京电子	56,700	447,930.00	0.26
85	002636	金安国纪	57,100	441,954.00	0.26
86	002703	浙江世宝	38,800	441,156.00	0.26
87	300304	云意电气	55,000	440,000.00	0.26
88	002961	瑞达期货	30,400	436,848.00	0.26
89	300523	辰安科技	22,000	435,380.00	0.26
90	600617	国新能源	160,900	434,430.00	0.26
91	002380	科远智慧	23,500	434,280.00	0.25
92	300248	新开普	44,800	434,112.00	0.25
93	002483	润邦股份	82,800	431,388.00	0.25
94	001208	华菱线缆	47,500	431,300.00	0.25
95	301369	联动科技	8,200	429,516.00	0.25
96	002479	富春环保	90,500	428,970.00	0.25
97	300221	银禧科技	73,400	428,656.00	0.25
98	300730	科创信息	35,200	428,384.00	0.25
99	600523	贵航股份	35,900	427,928.00	0.25
100	000837	秦川机床	47,700	427,869.00	0.25
101	300322	硕贝德	32,500	426,075.00	0.25
102	300401	花园生物	28,700	420,742.00	0.25

103	300369	绿盟科技	58,000	417,020.00	0.24
104	300812	易天股份	18,900	416,556.00	0.24
105	300047	天源迪科	35,300	414,775.00	0.24
106	603011	合锻智能	60,400	413,740.00	0.24
107	300341	麦克奥迪	23,600	413,236.00	0.24
108	000931	中关村	86,800	413,168.00	0.24
109	002023	海特高新	40,700	413,105.00	0.24
110	600644	乐山电力	67,000	410,040.00	0.24
110	603111	康尼机电	68,000	410,040.00	0.24
111	300758	七彩化学	34,200	409,716.00	0.24
112	002538	司尔特	72,200	405,764.00	0.24
113	002116	中国海诚	40,300	402,194.00	0.24
114	600756	浪潮软件	28,000	401,240.00	0.24
115	300375	鹏翎股份	86,200	397,382.00	0.23
116	002666	德联集团	91,100	397,196.00	0.23
117	600834	申通地铁	48,500	393,820.00	0.23
118	300016	北陆药业	62,900	389,980.00	0.23
119	002590	万安科技	31,900	389,818.00	0.23
120	600351	亚宝药业	63,900	389,151.00	0.23
121	300645	正元智慧	26,300	386,347.00	0.23
122	600592	龙溪股份	39,100	386,308.00	0.23
123	002452	长高电新	52,000	385,840.00	0.23
124	300228	富瑞特装	54,600	384,930.00	0.23
125	300410	正业科技	71,200	383,056.00	0.22
126	688201	信安世纪	43,000	379,690.00	0.22
127	603628	清源股份	30,400	379,392.00	0.22
128	600558	大西洋	93,100	378,917.00	0.22
129	002104	恒宝股份	55,900	377,884.00	0.22
130	603052	可川科技	10,600	377,466.00	0.22
131	002662	京威股份	96,300	372,681.00	0.22
132	300261	雅本化学	54,300	371,955.00	0.22
133	301389	隆扬电子	22,100	369,512.00	0.22
134	300650	太龙股份	32,100	369,150.00	0.22
135	301025	读客文化	38,700	368,811.00	0.22
136	301282	金禄电子	17,600	368,720.00	0.22
137	002420	毅昌科技	69,700	368,016.00	0.22
138	603357	设计总院	40,400	366,024.00	0.21
139	300447	全信股份	25,800	365,586.00	0.21
140	300480	光力科技	28,200	365,190.00	0.21
141	300342	天银机电	22,500	365,175.00	0.21
142	688509	正元地信	91,546	363,437.62	0.21
143	600159	大龙地产	151,400	363,360.00	0.21
144	600101	明星电力	41,200	362,560.00	0.21

145	300292	吴通控股	74,400	360,840.00	0.21
146	300471	厚普股份	38,000	359,480.00	0.21
147	688711	宏微科技	20,800	359,424.00	0.21
148	000510	新金路	99,700	358,920.00	0.21
149	002093	国脉科技	46,000	358,800.00	0.21
150	688233	神工股份	15,280	358,316.00	0.21
151	002255	海陆重工	64,400	358,064.00	0.21
152	600067	冠城大通	134,500	356,425.00	0.21
153	300950	德固特	22,000	355,300.00	0.21
154	002849	威星智能	19,900	354,618.00	0.21
155	002361	神剑股份	64,500	351,525.00	0.21
156	300121	阳谷华泰	29,000	350,610.00	0.21
157	002102	能特科技	133,400	349,508.00	0.21
158	601199	江南水务	62,800	347,284.00	0.20
159	600664	哈药股份	83,800	346,094.00	0.20
160	300647	超频三	56,200	345,630.00	0.20
161	300353	东土科技	30,100	345,548.00	0.20
162	601968	宝钢包装	69,100	342,045.00	0.20
163	000153	丰原药业	55,700	341,441.00	0.20
164	603168	莎普爱思	50,900	341,030.00	0.20
165	300656	民德电子	13,700	340,856.00	0.20
166	600108	亚盛集团	116,300	340,759.00	0.20
167	300236	上海新阳	9,100	340,067.00	0.20
168	600353	旭光电子	47,100	340,062.00	0.20
169	300158	振东制药	78,300	338,256.00	0.20
170	600551	时代出版	39,259	338,019.99	0.20
171	300164	通源石油	78,900	336,114.00	0.20
172	600207	安彩高科	75,300	335,838.00	0.20
173	002967	广电计量	20,400	334,560.00	0.20
174	300745	欣锐科技	21,000	334,320.00	0.20
175	300172	中电环保	66,100	333,805.00	0.20
176	300383	光环新网	22,700	331,193.00	0.19
177	000505	京粮控股	53,700	330,792.00	0.19
178	300053	航宇微	25,200	329,868.00	0.19
179	300032	金龙机电	72,800	328,328.00	0.19
180	600218	全柴动力	41,500	327,850.00	0.19
181	600517	国网英大	59,500	327,845.00	0.19
182	603222	济民医疗	48,200	327,278.00	0.19
183	300099	尤洛卡	54,200	325,200.00	0.19
184	300335	迪森股份	67,400	324,868.00	0.19
185	600686	金龙汽车	23,000	323,380.00	0.19
186	300486	东杰智能	47,200	322,848.00	0.19
187	002414	高德红外	43,400	322,462.00	0.19

188	002550	千红制药	52,000	322,400.00	0.19
189	603266	天龙股份	20,000	322,000.00	0.19
190	301215	中汽股份	53,700	319,515.00	0.19
191	600962	国投中鲁	24,000	315,600.00	0.19
192	000862	银星能源	63,700	314,678.00	0.18
193	601616	广电电气	71,600	314,324.00	0.18
194	002367	康力电梯	45,700	313,959.00	0.18
195	000045	深纺织 A	29,500	313,585.00	0.18
196	002846	英联股份	38,000	312,360.00	0.18
197	600237	铜峰电子	47,500	311,125.00	0.18
198	603660	苏州科达	46,200	310,002.00	0.18
199	002111	威海广泰	27,900	307,458.00	0.18
200	600284	浦东建设	49,000	307,230.00	0.18
201	603066	音飞储存	28,800	306,144.00	0.18
202	301370	国科恒泰	28,100	303,480.00	0.18
203	600168	武汉控股	68,500	303,455.00	0.18
204	300909	汇创达	12,600	300,510.00	0.18
205	002970	锐明技术	6,300	300,069.00	0.18
206	000677	恒天海龙	73,000	299,300.00	0.18
207	603823	百合花	32,000	297,600.00	0.17
208	300663	科蓝软件	17,100	296,856.00	0.17
209	600526	菲达环保	65,700	294,993.00	0.17
210	603158	腾龙股份	36,500	294,920.00	0.17
211	600379	宝光股份	31,100	294,517.00	0.17
212	002549	凯美特气	47,900	293,627.00	0.17
213	300271	华宇软件	41,800	293,436.00	0.17
214	003025	思进智能	20,800	293,072.00	0.17
215	603336	宏辉果蔬	68,400	292,068.00	0.17
216	600478	科力远	70,600	291,578.00	0.17
217	600310	广西能源	63,800	290,928.00	0.17
218	688508	芯朋微	6,707	288,199.79	0.17
219	002206	海利得	67,100	287,859.00	0.17
220	601579	会稽山	25,500	282,030.00	0.17
221	002863	今飞凯达	60,400	280,256.00	0.16
222	603098	森特股份	29,100	279,360.00	0.16
223	300139	晓程科技	19,000	277,210.00	0.16
224	603601	再升科技	82,400	276,864.00	0.16
225	300964	本川智能	7,700	276,430.00	0.16
226	002900	哈三联	28,000	275,800.00	0.16
227	300545	联得装备	8,800	275,704.00	0.16
228	300110	华仁药业	78,300	275,616.00	0.16
229	002437	誉衡药业	110,500	275,145.00	0.16
230	300281	金明精机	49,000	273,910.00	0.16

231	300439	美康生物	26,100	272,745.00	0.16
232	000993	闽东电力	32,600	272,210.00	0.16
233	688496	清越科技	31,737	271,986.09	0.16
234	600531	豫光金铅	42,000	269,640.00	0.16
235	002912	中新赛克	10,500	268,695.00	0.16
236	002551	尚荣医疗	87,200	268,576.00	0.16
237	600469	风神股份	43,400	267,344.00	0.16
238	600222	太龙药业	52,400	266,716.00	0.16
239	000797	中国武夷	96,200	266,474.00	0.16
240	300922	天秦装备	18,500	265,475.00	0.16
241	002446	盛路通信	40,500	265,275.00	0.16
242	600939	重庆建工	88,100	265,181.00	0.16
243	000957	中通客车	24,100	265,100.00	0.16
244	300797	钢研纳克	22,400	264,544.00	0.16
245	300943	春晖智控	20,500	264,245.00	0.16
246	300587	天铁科技	59,900	262,961.00	0.15
247	300404	博济医药	30,000	261,900.00	0.15
248	600496	精工钢构	86,000	259,720.00	0.15
249	002969	嘉美包装	83,100	258,441.00	0.15
250	600980	北矿科技	16,900	258,232.00	0.15
251	002869	金溢科技	9,700	258,020.00	0.15
252	002645	华宏科技	37,800	257,796.00	0.15
253	300505	川金诺	17,900	257,760.00	0.15
254	000612	焦作万方	40,100	257,442.00	0.15
255	000751	锌业股份	91,500	257,115.00	0.15
256	300360	炬华科技	15,300	256,581.00	0.15
257	002358	森源电气	55,500	255,300.00	0.15
258	300607	拓斯达	10,000	254,900.00	0.15
259	600439	瑞贝卡	75,400	254,098.00	0.15
260	603739	蔚蓝生物	21,100	252,989.00	0.15
261	300513	恒实科技	27,600	251,988.00	0.15
262	688588	凌志软件	18,200	251,160.00	0.15
263	002153	石基信息	34,900	249,186.00	0.15
264	000062	深圳华强	11,100	248,640.00	0.15
265	603758	秦安股份	30,100	248,626.00	0.15
266	600053	九鼎投资	17,900	248,273.00	0.15
267	600798	宁波海运	81,800	247,854.00	0.15
268	001359	平安电工	9,500	246,145.00	0.14
269	000917	电广传媒	34,800	246,036.00	0.14
270	300546	雄帝科技	14,600	245,572.00	0.14
271	000068	华控赛格	73,200	245,220.00	0.14
272	300508	维宏股份	9,000	243,450.00	0.14
273	300219	鸿利智汇	32,400	242,676.00	0.14

274	601068	中铝国际	55,000	242,550.00	0.14
275	002524	光正眼科	65,500	238,420.00	0.14
276	300265	通光线缆	29,000	238,380.00	0.14
277	300366	创意信息	25,600	238,080.00	0.14
278	300792	壹网壹创	9,900	237,600.00	0.14
279	300636	同和药业	29,400	234,318.00	0.14
280	002349	精华制药	30,500	233,325.00	0.14
281	300345	华民股份	41,300	232,932.00	0.14
282	002008	大族激光	9,300	232,500.00	0.14
283	300560	中富通	14,900	230,652.00	0.14
284	300123	亚光科技	39,700	230,260.00	0.14
285	300891	惠云钛业	27,800	227,126.00	0.13
286	300722	新余国科	8,400	226,968.00	0.13
287	300531	优博讯	16,200	225,990.00	0.13
288	603703	盛洋科技	20,500	225,705.00	0.13
289	300021	大禹节水	54,900	223,443.00	0.13
290	301507	民生健康	17,600	223,344.00	0.13
291	002017	东信和平	21,500	222,955.00	0.13
292	000955	欣龙控股	53,800	222,732.00	0.13
293	002827	高争民爆	8,800	222,728.00	0.13
294	301175	中科环保	40,900	220,860.00	0.13
295	688478	晶升股份	7,800	220,038.00	0.13
296	601999	出版传媒	34,800	218,196.00	0.13
297	300195	长荣股份	38,700	217,881.00	0.13
298	000037	深南电 A	27,300	217,308.00	0.13
299	002457	青龙管业	18,700	216,920.00	0.13
300	600537	亿晶光电	70,600	216,742.00	0.13
301	688138	清溢光电	9,400	215,260.00	0.13
302	601218	吉鑫科技	65,900	214,834.00	0.13
303	300987	川网传媒	15,100	213,816.00	0.13
304	300434	金石亚药	25,900	213,675.00	0.13
304	300806	斯迪克	16,500	213,675.00	0.13
305	603018	华设集团	25,800	211,818.00	0.12
306	002983	芯瑞达	10,700	210,148.00	0.12
307	000025	特力 A	12,700	209,804.00	0.12
308	300250	初灵信息	14,800	208,680.00	0.12
309	300423	昇辉科技	30,100	208,292.00	0.12
310	300975	商络电子	18,500	208,125.00	0.12
311	000920	沃顿科技	23,300	207,836.00	0.12
312	301132	满坤科技	7,500	206,250.00	0.12
313	300018	中元股份	30,400	205,808.00	0.12
314	002889	东方嘉盛	10,100	202,909.00	0.12
315	301083	百胜智能	14,300	201,201.00	0.12

316	000798	中水渔业	27,100	200,811.00	0.12
317	300381	溢多利	28,500	200,070.00	0.12
318	300940	南极光	14,800	199,800.00	0.12
319	600106	重庆路桥	35,400	197,886.00	0.12
320	301218	华是科技	9,100	197,743.00	0.12
321	688312	燕麦科技	6,420	197,736.00	0.12
322	002606	大连电瓷	21,400	197,308.00	0.12
323	688352	颀中科技	16,200	196,506.00	0.12
324	603960	克来机电	9,700	193,030.00	0.11
325	301332	德尔玛	19,200	192,384.00	0.11
326	300719	安达维尔	10,700	191,637.00	0.11
327	300490	华自科技	24,300	191,484.00	0.11
328	300539	横河精密	17,900	190,098.00	0.11
329	600229	城市传媒	27,000	188,190.00	0.11
330	301172	君逸数码	7,000	187,880.00	0.11
331	600661	昂立教育	16,000	187,520.00	0.11
332	600262	北方股份	10,200	186,762.00	0.11
333	300306	远方信息	16,100	186,760.00	0.11
334	000897	津滨发展	78,700	186,519.00	0.11
335	600217	中再资环	35,100	186,030.00	0.11
336	600189	泉阳泉	25,700	185,297.00	0.11
337	600805	悦达投资	41,700	184,731.00	0.11
338	600818	中路股份	15,900	183,804.00	0.11
339	300111	向日葵	56,700	183,708.00	0.11
340	300569	天能重工	36,700	182,766.00	0.11
341	300581	晨曦航空	16,300	182,723.00	0.11
342	603998	方盛制药	17,300	180,266.00	0.11
343	300752	隆利科技	10,600	180,200.00	0.11
344	600380	健康元	15,800	178,066.00	0.10
345	688173	希荻微	16,000	177,280.00	0.10
346	002825	纳尔股份	22,600	176,732.00	0.10
347	000655	金岭矿业	28,700	176,505.00	0.10
348	600367	红星发展	15,200	175,408.00	0.10
349	301368	丰立智能	3,800	175,370.00	0.10
350	002443	金洲管道	29,600	174,048.00	0.10
351	300344	立方数科	39,100	173,995.00	0.10
352	300057	万顺新材	35,800	172,556.00	0.10
353	000409	云鼎科技	19,300	171,963.00	0.10
354	002401	中远海科	10,800	171,504.00	0.10
355	603017	中衡设计	21,200	170,236.00	0.10
356	300176	鸿特科技	24,500	169,540.00	0.10
357	002733	雄韬股份	12,200	168,848.00	0.10
358	300643	万通智控	14,000	167,440.00	0.10

359	002191	劲嘉股份	39,700	166,740.00	0.10
360	600200	江苏吴中	17,800	165,896.00	0.10
361	600251	冠农股份	22,600	164,754.00	0.10
362	002782	可立克	13,000	164,450.00	0.10
363	002852	道道全	19,900	164,374.00	0.10
364	300004	南风股份	26,600	163,590.00	0.10
364	301112	信邦智能	7,000	163,590.00	0.10
365	002676	顺威股份	27,400	163,304.00	0.10
366	003043	华亚智能	3,900	161,460.00	0.09
367	688235	百济神州	1,000	161,020.00	0.09
368	301078	孩子王	14,100	160,458.00	0.09
369	002692	远程股份	40,400	158,368.00	0.09
370	601100	恒立液压	3,000	158,310.00	0.09
371	300124	汇川技术	2,700	158,166.00	0.09
372	600721	百花医药	24,000	158,160.00	0.09
373	688699	明微电子	4,400	158,136.00	0.09
374	301311	昆船智能	8,700	157,383.00	0.09
375	605286	同力日升	5,200	156,832.00	0.09
376	603885	吉祥航空	11,400	156,180.00	0.09
377	002548	金新农	39,300	156,021.00	0.09
378	300846	首都在线	11,200	155,792.00	0.09
379	300748	金力永磁	8,700	155,556.00	0.09
380	300747	锐科激光	8,100	155,196.00	0.09
381	000705	浙江震元	19,600	155,036.00	0.09
382	000100	TCL 科技	30,800	154,924.00	0.09
383	002957	科瑞技术	9,800	153,762.00	0.09
384	000777	中核科技	8,500	153,595.00	0.09
385	688385	复旦微电	3,980	152,792.20	0.09
386	688579	山大地纬	16,600	152,554.00	0.09
387	002766	索菱股份	26,500	152,375.00	0.09
388	000782	恒申新材	33,400	152,304.00	0.09
389	000529	广弘控股	25,700	151,630.00	0.09
390	002786	银宝山新	16,300	150,775.00	0.09
391	300683	海特生物	6,300	150,192.00	0.09
392	300215	电科院	25,200	149,436.00	0.09
393	002445	中南文化	60,900	149,205.00	0.09
394	300365	恒华科技	24,300	149,202.00	0.09
395	300674	宇信科技	7,600	148,352.00	0.09
396	002286	保龄宝	20,000	147,600.00	0.09
397	601188	龙江交通	40,700	146,520.00	0.09
398	002183	怡亚通	32,600	146,374.00	0.09
399	301013	利和兴	12,400	145,700.00	0.09
400	603738	泰晶科技	9,700	145,306.00	0.09

401	003010	若羽臣	5,200	145,080.00	0.09
402	002160	常铝股份	38,700	143,964.00	0.08
403	300142	沃森生物	11,800	142,544.00	0.08
404	688589	力合微	5,200	142,324.00	0.08
405	300039	上海凯宝	23,000	142,140.00	0.08
406	301136	招标股份	12,000	142,080.00	0.08
407	000554	泰山石油	23,900	141,966.00	0.08
408	300314	戴维医疗	12,600	141,876.00	0.08
409	000593	德龙汇能	25,900	141,155.00	0.08
410	000078	海王生物	55,300	141,015.00	0.08
411	002394	联发股份	18,600	139,872.00	0.08
412	600683	京投发展	36,700	139,460.00	0.08
413	688007	光峰科技	9,400	139,026.00	0.08
414	002428	云南锗业	7,300	137,970.00	0.08
415	300379	东方通	9,100	137,319.00	0.08
416	002537	海联金汇	23,800	136,850.00	0.08
417	300542	新晨科技	6,600	135,564.00	0.08
418	301126	达嘉维康	12,900	134,676.00	0.08
419	000701	厦门信达	29,300	133,901.00	0.08
420	300092	科新机电	11,500	132,710.00	0.08
421	301135	瑞德智能	5,700	132,696.00	0.08
422	300500	启迪设计	12,500	132,625.00	0.08
423	000428	华天酒店	41,400	132,480.00	0.08
424	601866	中远海发	49,900	130,239.00	0.08
425	600722	金牛化工	27,800	130,104.00	0.08
426	688182	灿勤科技	7,200	128,736.00	0.08
427	002584	西陇科学	17,800	127,982.00	0.08
428	600802	福建水泥	33,500	126,965.00	0.07
429	301379	天山电子	6,200	125,240.00	0.07
430	300606	金太阳	6,500	124,735.00	0.07
431	000926	福星股份	48,600	123,930.00	0.07
432	600784	鲁银投资	21,000	123,690.00	0.07
433	600879	航天电子	13,800	123,648.00	0.07
434	000758	中色股份	25,000	123,500.00	0.07
435	300721	怡达股份	10,100	123,018.00	0.07
436	300414	中光防雷	15,300	121,788.00	0.07
437	002838	道恩股份	10,300	121,643.00	0.07
438	600133	东湖高新	13,000	121,550.00	0.07
439	600359	新农开发	19,000	121,410.00	0.07
440	300532	今天国际	10,600	121,052.00	0.07
441	002679	福建金森	14,800	120,176.00	0.07
442	600996	贵广网络	14,000	119,700.00	0.07
443	300217	东方电热	26,500	119,515.00	0.07

444	603989	艾华集团	7,900	119,132.00	0.07
445	300045	华力创通	5,700	119,073.00	0.07
446	600326	西藏天路	18,400	118,864.00	0.07
446	603818	曲美家居	43,700	118,864.00	0.07
447	603396	金辰股份	4,400	118,360.00	0.07
448	300187	永清环保	23,400	118,170.00	0.07
449	600135	乐凯胶片	17,800	117,302.00	0.07
450	600742	一汽富维	13,100	115,935.00	0.07
451	300337	银邦股份	10,400	115,648.00	0.07
452	002427	尤夫股份	33,200	115,536.00	0.07
453	300201	海伦哲	21,800	114,668.00	0.07
454	301260	格力博	8,600	113,950.00	0.07
455	002184	海得控制	9,600	112,128.00	0.07
456	300149	睿智医药	17,300	111,066.00	0.07
457	603078	江化微	6,600	110,484.00	0.06
458	002712	思美传媒	21,500	109,650.00	0.06
459	300403	汉宇集团	10,800	107,460.00	0.06
460	000544	中原环保	12,300	107,379.00	0.06
461	601008	连云港	28,000	107,240.00	0.06
462	600610	中毅达	25,200	106,596.00	0.06
463	601096	宏盛华源	24,300	105,705.00	0.06
464	300516	久之洋	3,100	104,873.00	0.06
465	000559	万向钱潮	16,900	103,935.00	0.06
466	002634	棒杰股份	27,500	103,400.00	0.06
467	600959	江苏有线	30,700	102,845.00	0.06
468	000633	合金投资	23,100	102,333.00	0.06
469	002578	闽发铝业	34,200	102,258.00	0.06
470	688562	航天软件	6,400	101,824.00	0.06
471	300213	佳讯飞鸿	13,200	101,508.00	0.06
472	300773	拉卡拉	5,700	100,890.00	0.06
473	002729	好利科技	8,000	100,480.00	0.06
474	300771	智莱科技	9,300	97,836.00	0.06
475	605588	冠石科技	2,400	97,824.00	0.06
476	300702	天宇股份	5,800	96,628.00	0.06
477	600636	国新文化	10,400	96,512.00	0.06
478	301321	翰博高新	6,700	96,480.00	0.06
479	000698	沈阳化工	28,500	96,045.00	0.06
480	301320	豪江智能	6,400	95,424.00	0.06
481	601996	丰林集团	44,300	94,802.00	0.06
482	603127	昭衍新药	5,700	94,791.00	0.06
483	301318	维海德	3,200	94,464.00	0.06
484	300601	康泰生物	5,500	94,325.00	0.06
485	002166	莱茵生物	12,600	94,122.00	0.06

486	603788	宁波高发	6,800	94,044.00	0.06
487	300534	陇神戎发	10,700	93,090.00	0.05
488	300951	博硕科技	3,100	92,597.00	0.05
489	002073	软控股份	11,200	92,512.00	0.05
490	002823	凯中精密	6,500	92,105.00	0.05
491	000930	中粮科技	16,500	91,575.00	0.05
492	301307	美利信	4,500	91,485.00	0.05
493	000922	佳电股份	8,100	91,449.00	0.05
494	603697	有友食品	8,900	90,602.00	0.05
495	301337	亚华电子	3,100	90,210.00	0.05
496	600684	珠江股份	27,300	90,090.00	0.05
497	002363	隆基机械	13,400	88,038.00	0.05
498	000563	陕国投 A	24,400	86,864.00	0.05
499	688428	诺诚健华	7,000	85,960.00	0.05
500	603967	中创物流	8,700	85,347.00	0.05
501	002734	利民股份	10,600	84,482.00	0.05
502	600130	波导股份	17,800	84,016.00	0.05
503	300821	东岳硅材	10,800	83,808.00	0.05
504	603258	电魂网络	4,200	83,538.00	0.05
505	300095	华伍股份	12,300	83,517.00	0.05
506	301060	兰卫医学	9,100	82,901.00	0.05
507	605376	博迁新材	2,800	81,060.00	0.05
508	301281	科源制药	2,700	80,757.00	0.05
509	600739	辽宁成大	7,800	80,730.00	0.05
510	001339	智微智能	2,200	80,498.00	0.05
511	600215	派斯林	11,700	80,028.00	0.05
512	300477	合纵科技	28,100	79,804.00	0.05
513	000783	长江证券	11,600	79,112.00	0.05
514	600180	瑞茂通	18,300	78,690.00	0.05
515	002170	芭田股份	8,900	77,697.00	0.05
516	300783	三只松鼠	2,100	77,427.00	0.05
517	600510	黑牡丹	16,100	76,797.00	0.05
518	603138	海量数据	5,300	76,161.00	0.04
519	600872	中炬高新	3,400	74,868.00	0.04
520	000901	航天科技	6,800	74,596.00	0.04
521	300637	扬帆新材	8,100	74,520.00	0.04
522	300732	设研院	11,100	74,148.00	0.04
523	600637	东方明珠	9,400	72,944.00	0.04
524	600110	诺德股份	18,200	72,800.00	0.04
525	300584	海辰药业	3,600	72,576.00	0.04
526	300615	欣天科技	6,300	72,387.00	0.04
527	002873	新天药业	7,600	71,972.00	0.04
528	002035	华帝股份	9,800	71,932.00	0.04

529	300618	寒锐钴业	2,100	70,917.00	0.04
530	002903	宇环数控	4,300	69,875.00	0.04
531	000776	广发证券	4,300	69,703.00	0.04
532	002806	华锋股份	6,000	67,680.00	0.04
533	600866	星湖科技	10,400	67,288.00	0.04
534	301339	通行宝	3,300	67,122.00	0.04
535	002263	大东南	26,200	64,976.00	0.04
536	600770	综艺股份	15,400	64,526.00	0.04
537	000541	佛山照明	10,300	63,860.00	0.04
538	603698	航天工程	4,100	63,796.00	0.04
539	600063	皖维高新	15,700	62,800.00	0.04
540	688148	芳源股份	12,600	62,370.00	0.04
541	002787	华源控股	7,900	62,252.00	0.04
542	603006	黎明股份	5,900	61,537.00	0.04
543	300631	久吾高科	2,900	61,190.00	0.04
544	300350	华鹏飞	11,200	60,480.00	0.04
545	002382	蓝帆医疗	11,700	60,021.00	0.04
546	603327	福蓉科技	4,800	58,272.00	0.03
547	002947	恒铭达	1,700	56,661.00	0.03
548	000821	京山轻机	4,500	56,025.00	0.03
549	603888	新华网	2,500	55,850.00	0.03
550	600749	西藏旅游	5,200	55,744.00	0.03
551	301226	祥明智能	2,400	55,728.00	0.03
552	002167	东方锆业	7,400	54,316.00	0.03
553	300988	津荣天宇	3,000	54,120.00	0.03
554	301511	德福科技	4,300	54,008.00	0.03
555	600643	爱建集团	10,400	53,768.00	0.03
556	000151	中成股份	3,800	53,618.00	0.03
557	300437	清水源	5,900	52,982.00	0.03
558	600854	春兰股份	11,500	52,670.00	0.03
559	603508	思维列控	2,200	52,316.00	0.03
560	000726	鲁泰 A	8,000	52,160.00	0.03
561	688432	有研硅	4,600	51,980.00	0.03
562	002412	汉森制药	8,600	51,686.00	0.03
563	300230	永利股份	11,600	51,620.00	0.03
564	000885	城发环境	3,900	51,129.00	0.03
565	600572	康恩贝	10,800	50,328.00	0.03
566	002559	亚威股份	5,600	50,232.00	0.03
567	688543	国科军工	1,000	50,120.00	0.03
568	002246	北化股份	4,900	49,735.00	0.03
569	301626	苏州天脉	742	48,808.76	0.03
570	002268	电科网安	3,000	48,750.00	0.03
571	300589	江龙船艇	3,900	48,555.00	0.03

572	300626	华瑞股份	5,300	48,336.00	0.03
573	605305	中际联合	1,700	48,161.00	0.03
574	603966	法兰泰克	6,100	47,092.00	0.03
575	603032	德新科技	3,500	47,075.00	0.03
576	002448	中原内配	7,500	46,950.00	0.03
577	002500	山西证券	7,400	46,472.00	0.03
578	603663	三祥新材	2,900	46,255.00	0.03
579	600776	东方通信	4,100	45,879.00	0.03
580	600249	两面针	8,800	44,792.00	0.03
581	300768	迪普科技	2,500	43,750.00	0.03
582	300825	阿尔特	3,700	41,810.00	0.02
583	000676	智度股份	4,900	41,454.00	0.02
584	603626	科森科技	5,200	40,560.00	0.02
585	601599	浙文影业	10,800	38,664.00	0.02
586	300978	东箭科技	3,500	38,115.00	0.02
587	600267	海正药业	4,500	37,350.00	0.02
588	600791	京能置业	9,000	36,900.00	0.02
589	300079	数码视讯	6,600	35,706.00	0.02
590	300985	致远新能	1,900	34,979.00	0.02
591	301611	珂玛科技	605	33,940.50	0.02
592	603082	北自科技	1,000	33,900.00	0.02
593	300359	全通教育	6,400	33,664.00	0.02
594	300185	通裕重工	13,000	33,410.00	0.02
595	300515	三德科技	2,800	33,348.00	0.02
596	605166	聚合顺	2,700	32,319.00	0.02
597	002150	通润装备	2,600	32,240.00	0.02
598	688033	天宜上佳	5,600	32,200.00	0.02
599	600731	湖南海利	5,600	31,920.00	0.02
600	000650	仁和药业	5,500	31,680.00	0.02
601	002439	启明星辰	2,000	31,640.00	0.02
602	600501	航天晨光	1,700	30,838.00	0.02
603	000058	深赛格	3,800	30,514.00	0.02
604	002626	金达威	2,000	30,200.00	0.02
605	688535	华海诚科	405	30,111.75	0.02
606	600230	沧州大化	2,800	30,016.00	0.02
607	605333	沪光股份	900	29,367.00	0.02
608	603069	海汽集团	1,600	29,216.00	0.02
609	002536	飞龙股份	2,500	28,950.00	0.02
610	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.02
611	000725	京东方 A	6,400	28,096.00	0.02
612	300963	中洲特材	3,200	28,064.00	0.02
613	000029	深深房 A	1,800	27,108.00	0.02
614	000623	吉林敖东	1,500	25,905.00	0.02

615	601518	吉林高速	9,200	25,576.00	0.02
616	688023	安恒信息	600	24,480.00	0.01
617	300272	开能健康	3,900	23,985.00	0.01
618	002556	辉隆股份	4,300	23,951.00	0.01
619	301185	鸥玛软件	1,400	23,912.00	0.01
620	001298	好上好	900	22,545.00	0.01
621	300682	朗新集团	1,800	21,960.00	0.01
622	300996	普联软件	1,200	21,744.00	0.01
623	301150	中一科技	1,000	21,440.00	0.01
624	002907	华森制药	1,600	20,800.00	0.01
625	601956	东贝集团	4,200	20,286.00	0.01
626	601555	东吴证券	2,600	20,280.00	0.01
627	300455	航天智装	1,500	19,440.00	0.01
628	600769	祥龙电业	2,000	19,220.00	0.01
629	002125	湘潭电化	1,900	19,152.00	0.01
630	600552	凯盛科技	1,600	18,256.00	0.01
631	603267	鸿远电子	500	18,115.00	0.01
632	688238	和元生物	3,660	18,080.40	0.01
633	603600	永艺股份	1,500	17,835.00	0.01
634	688373	盟科药业	3,600	17,784.00	0.01
635	605208	永茂泰	2,300	17,733.00	0.01
636	000557	西部创业	3,300	17,127.00	0.01
637	002613	北玻股份	4,100	16,564.00	0.01
638	301522	上大股份	665	16,518.60	0.01
639	600619	海立股份	1,300	15,860.00	0.01
640	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
641	600094	大名城	4,100	14,924.00	0.01
642	601399	国机重装	4,700	14,476.00	0.01
643	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
644	300573	兴齐眼药	200	13,956.00	0.01
645	603196	日播时尚	1,000	13,450.00	0.01
646	600278	东方创业	1,900	13,281.00	0.01
647	603186	华正新材	500	12,045.00	0.01
648	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
649	002982	湘佳股份	600	10,710.00	0.01
650	688152	麒麟信安	200	10,408.00	0.01
651	300481	濮阳惠成	700	10,374.00	0.01
652	600665	天地源	3,300	10,329.00	0.01
653	300598	诚迈科技	200	9,680.00	0.01
654	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
655	000707	双环科技	1,200	8,856.00	0.01
656	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
657	301606	绿联科技	220	8,027.80	0.00

658	002723	小崧股份	1,100	7,645.00	0.00
659	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
660	301603	乔锋智能	170	7,136.60	0.00
661	301608	博实结	107	6,995.66	0.00
662	002866	传艺科技	400	6,472.00	0.00
663	600990	四创电子	300	6,384.00	0.00
664	301613	新铝时代	152	6,349.04	0.00
665	300778	新城市	500	5,580.00	0.00
666	000607	华媒控股	1,500	5,565.00	0.00
667	001391	国货航	795	5,406.00	0.00
668	301622	英思特	113	5,075.96	0.00
669	000958	电投产融	700	4,361.00	0.00
670	301585	蓝宇股份	117	4,194.45	0.00
671	301631	壹连科技	41	4,180.36	0.00
672	300503	吴志机电	200	3,784.00	0.00
673	301617	博苑股份	87	3,461.73	0.00
674	600162	香江控股	1,300	2,496.00	0.00
675	002438	江苏神通	200	2,440.00	0.00
676	600744	华银电力	400	1,244.00	0.00
677	000523	红棉股份	400	1,220.00	0.00
678	000919	金陵药业	100	658.00	0.00
679	600998	九州通	100	512.00	0.00
680	002489	浙江永强	100	324.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002437	誉衡药业	4,118,239.00	2.42
2	301013	利和兴	4,084,286.00	2.40
3	002043	兔宝宝	3,881,401.50	2.28
4	605228	神通科技	3,872,168.00	2.27
5	300752	隆利科技	3,714,437.00	2.18
6	300608	思特奇	3,651,683.80	2.14
7	000404	长虹华意	3,511,607.00	2.06
8	002712	思美传媒	3,502,124.00	2.06
9	002174	游族网络	3,422,477.00	2.01
10	000544	中原环保	3,278,754.00	1.92
11	300484	蓝海华腾	3,272,993.00	1.92
12	002192	融捷股份	3,227,128.98	1.89
13	300153	科泰电源	3,212,444.00	1.89
14	601058	赛轮轮胎	3,195,051.00	1.88
15	300440	运达科技	3,147,815.00	1.85

16	300547	川环科技	3,140,846.00	1.84
17	002662	京威股份	3,137,770.00	1.84
18	300566	激智科技	3,136,344.70	1.84
19	300706	阿石创	3,110,102.00	1.83
20	002255	海陆重工	3,104,580.00	1.82

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	605228	神通科技	3,989,631.16	2.34
2	002043	兔宝宝	3,968,728.00	2.33
3	301013	利和兴	3,909,990.00	2.30
4	002437	誉衡药业	3,885,062.00	2.28
5	300752	隆利科技	3,712,304.00	2.18
6	300484	蓝海华腾	3,653,849.00	2.14
7	300608	思特奇	3,550,017.80	2.08
8	002712	思美传媒	3,543,752.00	2.08
9	601058	赛轮轮胎	3,403,080.67	2.00
10	002174	游族网络	3,381,262.00	1.98
11	002192	融捷股份	3,336,181.00	1.96
12	300440	运达科技	3,323,578.00	1.95
13	300566	激智科技	3,278,963.00	1.92
14	300153	科泰电源	3,268,750.50	1.92
15	300547	川环科技	3,249,367.00	1.91
16	300706	阿石创	3,247,741.00	1.91
17	300710	万隆光电	3,215,585.15	1.89
18	300731	科创新源	3,098,840.00	1.82
19	300966	共同药业	3,086,784.00	1.81
20	000404	长虹华意	3,079,945.33	1.81

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	2,659,730,750.75
卖出股票收入（成交）总额	2,506,252,220.02

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

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

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	571,756.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,891,784.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	5,463,541.11
---	----	--------------

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	2,993	14,274.63	0.00	0.00	42,723,975.54	100.00
华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	9,223	11,232.82	1,595,911.46	1.54	102,004,351.50	98.46
合计	11,406	12,828.71	1,595,911.46	1.09	144,728,327.04	98.91

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	40,593.80	0.0950
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	10,432.60	0.0101
	合计	51,026.40	0.0349

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	0~10
	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C	0
	合计	0~10

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产份额总量的数量区间（万份）
盛豪	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2024 年 1 月 12 日) 基金份额总额	218,645,473.34	214,381,729.92
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	30,583,511.43	161,222,651.60
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	206,505,009.23	272,004,118.56
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	42,723,975.54	103,600,262.96

§ 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，陆楨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)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金本年度支付给审计机构德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 25,000.00 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：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 (%)	
华泰证券	2	5,164,927,745.74	100.00	1,164,449.91	100.00	-

注：本报告期内：

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，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、本报告期内本基金新增华泰证券的交易单元。

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 (%)
华泰证券	-	-	3,406,000.00	100.00	-	-

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公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 27 日
3	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
4	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
5	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	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 27 日

	公告		
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 19 日
11	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 07 月 18 日
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 21 日
19	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
20	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
21	华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 13 日

	投资基金基金合同生效公告		
22	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日