

华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券
投资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

§ 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。

基金托管人兴业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。

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 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	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	70
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.....	70
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.....	70
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.....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 本报告期投资基金情况.....	70
8.13 投资组合报告附注.....	71
§9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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的情况.....	73
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	73
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	73
§10 开放式基金份额变动	74
§11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	74
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	75
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.9 其他重大事件.....	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	79
13.3 查阅方式.....	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	华泰紫金中证 500 指数增强发起	
基金主代码	016865	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 22 日	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,589,266.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	016865	016866
报告期末下属分级基金的份额总额	10,731,101.55 份	6,858,164.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在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% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	1、股票投资策略本基金为指数增强型基金，以中证 500 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争控制本基金与业绩比较基准之间的跟踪偏离度。2、存托凭证投资策略 3、债券投资策略 4、可转债和可交债投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、衍生品投资策略 7、融资、转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基

	金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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	华泰证券（上海）资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	白海燕
	联系电话	4008895597
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com
客户服务电话	4008895597	95561
传真	021-28972120	021-62159217
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区 基隆路6号1222室	福建省福州市台江区江滨中 大道398号兴业银行大厦
办公地址	上海市浦东新区东方路18号 21楼	上海市浦东新区银城路167 号4楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	崔春	吕家进

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	https://htamc.htsc.com.cn/
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	华泰证券(上海)资产管理有限公司	上海市浦东新区东方路 18 号 21 楼

§ 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 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	华泰紫金中 证 500 指数增强发 起 A	华泰紫金中 证 500 指数增强发 起 C	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C
本期已 实现收益	1,057,700.15	714,843.79	-1,175,501.70	-996,606.13
本期利 润	1,052,809.70	893,007.31	-1,456,503.90	-1,310,819.64
加权平 均基金份 额 本期利润	0.0959	0.1152	-0.1320	-0.1288
本期加 权平均净值 利润率	10.93%	13.24%	-14.15%	-13.69%
本期基 金份额净值 增长率	10.97%	10.53%	-13.22%	-13.52%
3.1.2 期末数据	2024 年末		2023 年末	

和指标	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C
期末可供分配利润	-396,555.85	-302,450.69	-1,469,616.66	-885,732.09
期末可供分配基金份额利润	-0.0370	-0.0441	-0.1322	-0.1352
期末基金资产净值	10,334,545.70	6,555,714.30	9,649,996.93	5,667,569.34
期末基金份额净值	0.9630	0.9559	0.8678	0.8648
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C
基金份额累计净值增长率	-3.70%	-4.41%	-13.22%	-13.52%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），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、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

华泰紫金中证 500 指数增强发起 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	0.09%	1.81%	-0.23%	1.93%	0.32%	-0.12%
过去六个月	12.68%	1.80%	15.13%	1.91%	-2.45%	-0.11%
过去一年	10.97%	1.61%	5.40%	1.73%	5.57%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-3.70%	1.28%	-9.58%	1.37%	5.88%	-0.09%

华泰紫金中证 500 指数增强发起 C

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	0.00%	1.81%	-0.23%	1.93%	0.23%	-0.12%
过去六个月	12.46%	1.80%	15.13%	1.91%	-2.67%	-0.11%
过去一年	10.53%	1.61%	5.40%	1.73%	5.13%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-4.41%	1.28%	-9.58%	1.37%	5.17%	-0.09%

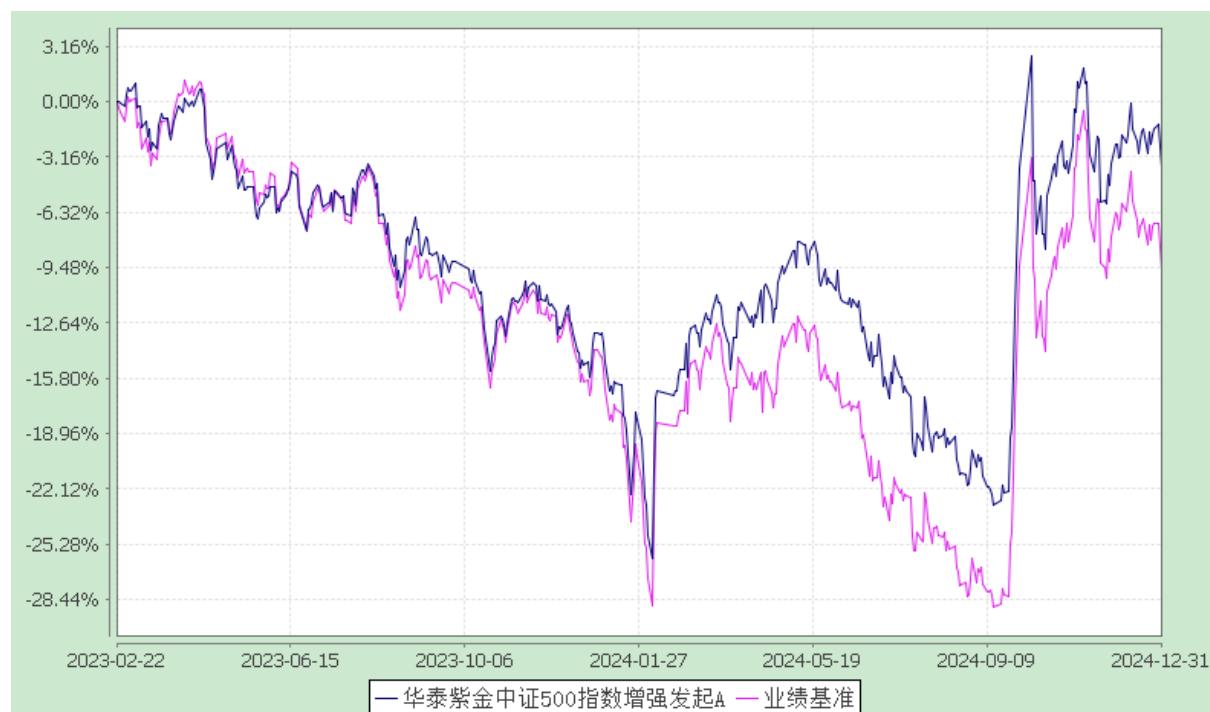
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

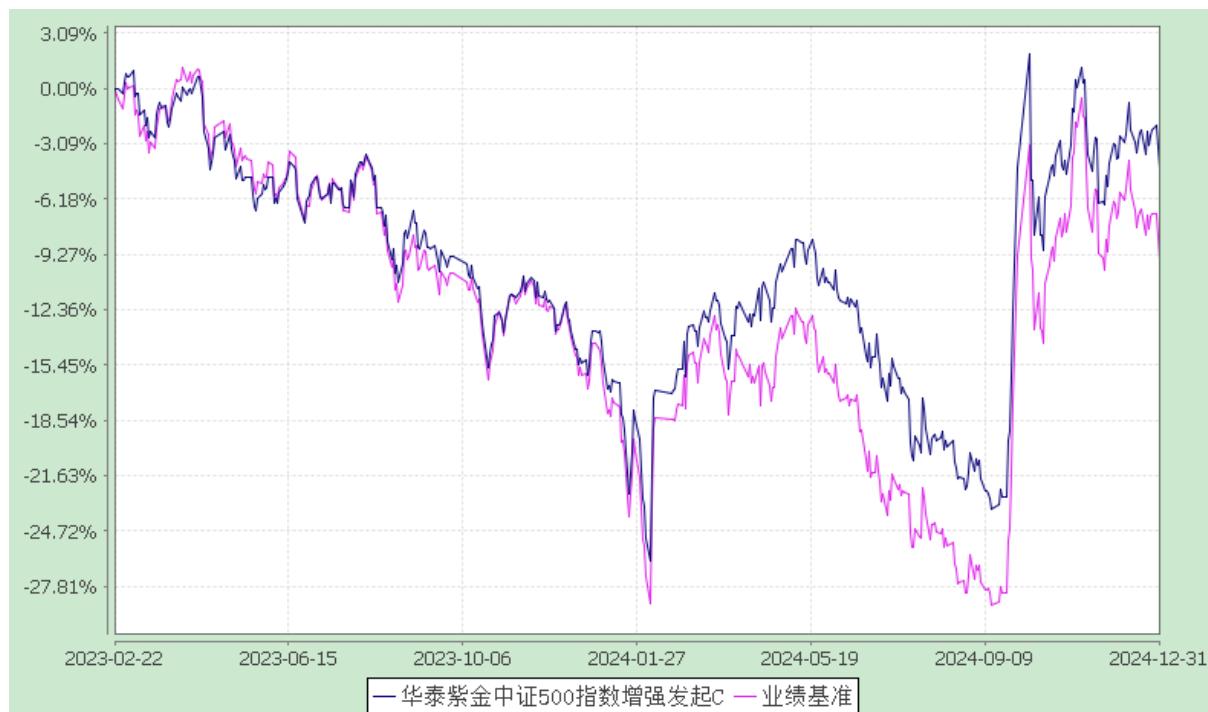
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 2 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)

华泰紫金中证 500 指数增强发起 A



华泰紫金中证 500 指数增强发起 C



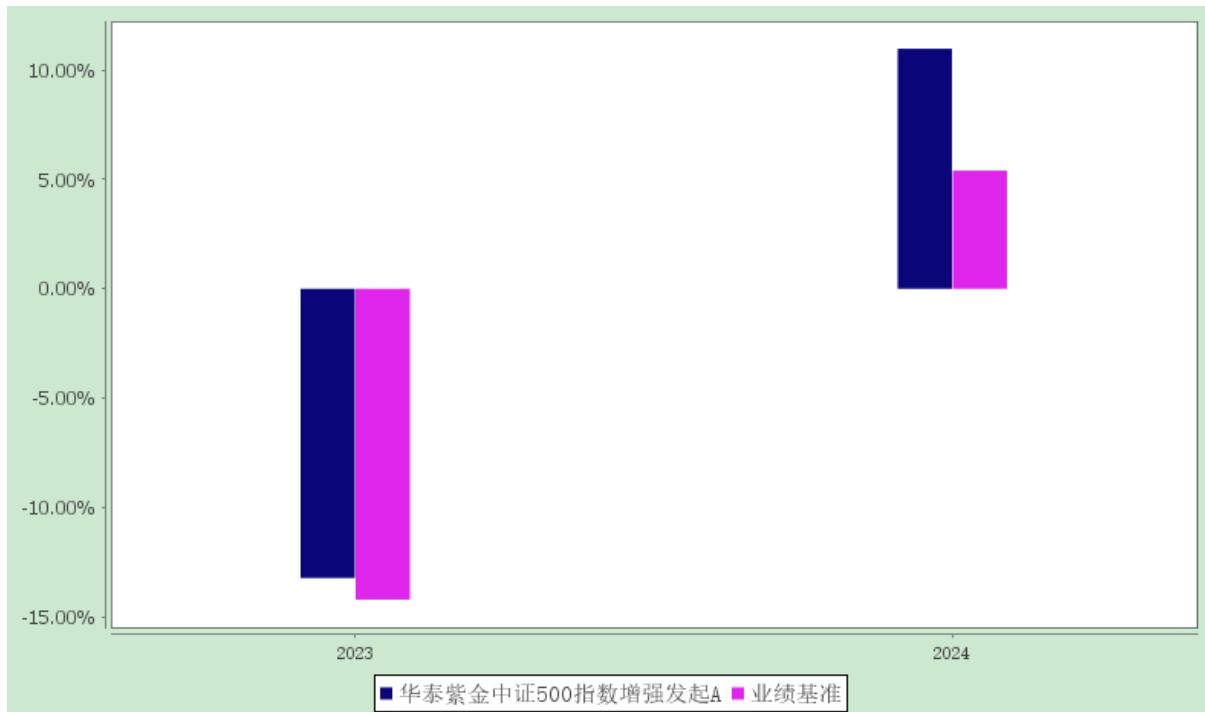
注：1、本基金运作业绩比较基准收益率=中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5%。

2、本基金合同于 2023 年 2 月 22 日生效，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

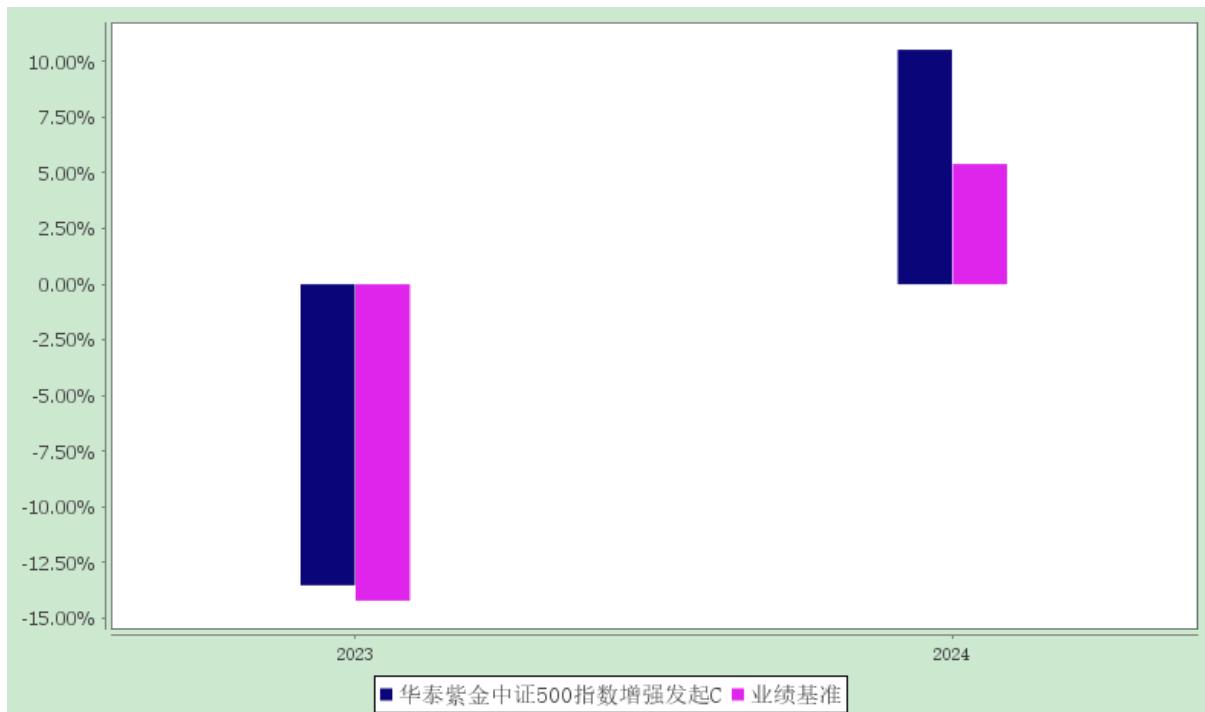
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金
基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

华泰紫金中证 500 指数增强发起 A



华泰紫金中证 500 指数增强发起 C



注: 1、本基金运作业绩比较基准收益率=中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5%。

2、本基金合同于 2023 年 2 月 22 日生效，合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

华泰证券（上海）资产管理有限公司是经中国证监会证监许可〔2014〕679 号文批准，由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司。2014 年 10 月成立时，注册资本 3 亿元人民币。2015 年 10 月增加注册资本至 10 亿元人民币。2016 年 7 月增加注册资本至 26 亿元人民币。2016 年 7 月，公司经中国证监会证监许可〔2016〕1682 号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。公司主要业务为证券资产管理业务、公开募集证券投资基金管理业务及中国证监会批准的其它业务。公司注册地位于上海，在北京、南京、深圳等地设办公地点。公司前身为华泰证券资产管理总部，自 1999 年开展客户资产管理业务以来，持续打造从资产创设到资金募集对接全业务链协同下的差异化核心竞争力，致力于为客户提供多层次全方位高质量的产品投资、资产配置和整体金融服务解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

名 称	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		
毛甜	本基金的基金经理	2023-02-22	-	14	武汉大学金融工程学士、硕士。2010-2012 年曾任国信证券经济研究所金融工程部助理分析师；2012-2017 年任职光大富尊投资有限公司，历任研究员、投资经理。2017 年 7 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现担任基金经理。
姚石	本基金的基金经理	2023-03-14	-	9	北京大学应用数学学士、硕士。2014 年 7 月至 2015 年 8 月曾任中国

				金融期货交易所股份有限公司助理经理；2015 年 8 月至 2021 年 8 月曾任海通证券研究所金融工程高级分析师。2021 年 9 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，擅长量化选股、量化择时、资产配置与 CTA 策略，历任研究员、基金经理助理，现担任基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

3、姚石先生于 2025 年 3 月 18 日卸任该基金的基金经理。

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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

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》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易控制制度，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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，A 股走势一波三折。1 月至 2 月初，在基本面和资金面等因素扰动下，市场快速调整，小微盘股爆发流动性危机。春节前后，一系列积极政策密集出台，提振了市场情绪，各大指数快速反弹。二季度，宏观经济仍在筑底，市场预期偏弱，A 股震荡下行。新“国九条”出台后，市场监管趋严，风险警示及退市个股数量上升，从长期来看有利于市场的健康发展，但短期加剧了投资者对小微盘股与低价股退市风险的担忧，小微盘指数大幅下跌。三季度，宏观经济仍在筑底，7 月初至 9 月中旬，A 股市场单边走低。9 月中旬，美联储超预期降息 50 个基点，全球流动性拐点出现。9 月下旬，政府出台了一系列提振经济及资本市场的政策，投资者风险偏好大幅改善，A 股市场在季末发生惊人反转。四季度初，宏观政策明显转向，投资者信心修复，A 股市场以亢奋状态开局。随着政策的陆续落地，情绪有所降温，但场内流动性十分宽裕，题材炒作精彩纷呈。进入 12 月，题材轮动达到极致，流动性出现退潮，年报业绩预告期临近，避险情绪升温，小盘、成长板块遭到资金抛

售，大盘、红利板块再度受到追捧。截至本报告期末，上证综指上涨 12.67%，深证成指上涨 9.34%，沪深 300 指数上涨 14.68%，中证 500 指数上涨 5.46%。风格因子方面，市值、非线性市值、beta 等因子在 2 月初、9 月底至 10 月初这两个市场转折点发生巨幅波动；残余波动因子全年表现较好；动量因子与盈利性因子上半年表现出色，下半年明显回撤；其他风格因子没有明显趋势。对高波动风格的风险管理成为了决定指数增强产品超额收益的关键因素。在操作上，本基金作为指数增强型基金，严格遵守基金合同，在保持相对中证 500 指数较小跟踪误差情况下，以量化多因子模型为核心策略，AI 模型和 SmartBeta 策略作为卫星策略，多维度精选个股，追求长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 10.97%，同期业绩比较基准收益率为 5.40%；本基金 C 类份额净值增长率为 10.53%，同期业绩比较基准收益率为 5.40%。

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，全球不确定性因素增加，特朗普政策将成为影响全球经济增长的关键变量。为了应对外部不利环境，政策有望加码扩大内需，消费、顺周期板块或将迎来转机。另一方面，AI、机器人等新兴产业蓬勃发展，或将引领成长风格走强。我们将严格控制风险敞口，通过量化模型精选个股，追求长期稳健的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司规范运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金运作安全，保障份额持有人利益，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 公司持续加强现有内部控制制度体系的梳理建设，促进公司业务合法合规；进一步强化合规风险管理，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理，防范各类合规风险；公司通过开展新规宣导及员工培训工作，不断提升员工的合规守法意识。

(2) 公司坚持全面风险管理的理念，认真贯彻落实相关法规政策要求，围绕业务风险点建立和完善风险控制措施，通过系统与人工相结合的方式对各类业务进行全流程风险管理，在对日常投资运作进行持续监督管理的基础上，建立健全相关制度流程，持续加强投资准入管理、交易对手管理、风控指标和限额管理，综合运用压力测试、量化分析等方式进行风险评估，并对业务风险进行定期跟踪与排查，完善风险处置机制，加快风险资产处置。同时，公司高度重视风险管理信息系统建设，逐步提升风险管理数字化、智能化水平。

(3) 公司按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用常规检查与专项检查、定期检查和不定期检查有机结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、

执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，推动公司合规、内控体系的健全完善。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，投资研究部门、运营部、交易部、风险管理部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金的基金合同生效未满三年，暂不适用。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2502353 号

华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“该基金”）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，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 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。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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，我们独立于该基金，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。

6.3 其他信息

该基金管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 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) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(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。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

张楠 李博

中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2025 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	上年度末
		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7	131,064.22	1,216,373.30

	.1		
结算备付金		84,699.89	82,502.21
存出保证金		7,293.26	7,358.23
交易性金融资产	7.4.7.2	16,725,087.27	14,379,853.34
其中：股票投资		15,808,534.88	14,379,853.34
基金投资		-	-
债券投资		916,552.39	-
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		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,162.41	-
应收股利		-	-
应收申购款		11.00	386.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		16,949,318.05	15,686,473.22
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		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,077.72	324,039.93
应付赎回款		-	1,924.43
应付管理人报酬		11,687.45	10,392.05
应付托管费		2,191.38	1,948.51
应付销售服务费		2,278.60	1,926.54
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	7.4.7.7	29,822.90	28,675.49
负债合计		59,058.05	368,906.95
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	17,589,266.54	17,672,915.02
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	-699,006.54	-2,355,348.75
净资产合计		16,890,260.00	15,317,566.27
负债和净资产总计		16,949,318.05	15,686,473.22

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 17,589,266.54 份，其中 A 类基金份额净值 0.9630 元，基金份额总额 10,731,101.55 份；C 类基金份额净值 0.9559 元，基金份额总额 6,858,164.99 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至	2023 年 2 月 22 日（基

		2024 年 12 月 31 日	金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,144,612.21	-2,572,431.06
1.利息收入		3,458.84	8,902.23
其中：存款利息收入	7.4.7.10	3,458.84	6,753.47
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		-	2,148.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,967,481.17	-1,986,355.11
其中：股票投资收益	7.4.7.11	1,609,304.26	-2,312,515.49
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	10,717.44	1,703.61
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	347,459.47	324,456.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	173,273.07	-595,215.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	399.13	237.53
减：二、营业总支出		198,795.20	194,892.48
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	131,155.29	135,540.04
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	24,591.58	25,413.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	27,018.42	32,580.88
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	7.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		-	6.45
8. 其他费用	7.4.7.22	16,029.91	1,351.43
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,945,817.01	-2,767,323.54
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,945,817.01	-2,767,323.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,945,817.01	-2,767,323.54

7.3 净资产变动表

会计主体: 华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末 净资产	17,672,915.02	-2,355,348.75	15,317,56 6.27
二、本期期初 净资产	17,672,915.02	-2,355,348.75	15,317,56 6.27
三、本期增减 变动额(减少以“-” 号填列)	-83,648.48	1,656,342.21	1,572,693 .73
(一)、综合 收益总额	-	1,945,817.01	1,945,817 .01
(二)、本期 基金份额交易产 生的净资产变动 数(净资产减少以	-83,648.48	-289,474.80	-373,123. 28

“-”号填列)			
其中： 1.基金申购款	5,898,491.33	-803,237.45	5,095,253.88
2.基金赎回款	-5,982,139.81	513,762.65	-5,468,377.16
(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、本期期末净资产	17,589,266.54	-699,006.54	16,890,260.00
项目	上年度可比期间		
	2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	27,632,032.67	-	27,632,032.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,959,117.65	-2,355,348.75	-12,314,466.40
(一)、综合收益总额	-	-2,767,323.54	-2,767,323.54
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以	-9,959,117.65	411,974.79	-9,547,142.86

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	989,565.39	-61,346.40	928,218.99
2.基金赎回款	-10,948,683.04	473,321.19	-10,475,361.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	17,672,915.02	-2,355,348.75	15,317,566.27

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：

基金管理人负责人：江晓阳，主管会计工作负责人：江晓阳，会计机构负责人：白海燕

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(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”)《关于准予华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2022]1512 号)批准，由华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2023 年 2 月 22 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 27,632,032.67 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管，托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)和《华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》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（包括创业板股票、存托凭证以及其他中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）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的相关规定）。

本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券、买入返售金融资产等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b)金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

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

(a)金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b)后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；

- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债或其一部分的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债或该部分金融负债。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量：

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报：

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销：

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下列原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负
第 29 页共 80 页

债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占

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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入：

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益：

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益：

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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（如有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。同一类别内每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有

规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税

以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
活期存款	131,064.22	1,216,373.30
等于： 本金	131,045.56	1,216,270.92
加： 应计利息	18.66	102.38
定期存款	-	-
等于： 本金	-	-
加： 应计利息	-	-
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	-	-
合计	131,064.22	1,216,373.30

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	变动
股票	16,229,920.3 8	-	15,808,534. 88	-421,385.5 0
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易 所 市场	901,367.14	15,742.39	916,552.39 -557.14

	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	901,367.14	15,742.39	916,552.39	-557.14
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	17,131,287.5 2	15,742.39	16,725,087. 27	-421,942.6 4
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	14,975,069.0 5	-	14,379,853. 34	-595,215.7 1	
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	14,975,069.0 5	-	14,379,853. 34	-595,215.7 1	

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 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	14,822.90	28,675.49
其中：交易所市场	14,822.90	28,675.49
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	15,000.00	-
合计	29,822.90	28,675.49

7.4.7.8 实收基金

华泰紫金中证 500 指数增强发起 A

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	账面金额
基金份额 (份)		

上年度末	11,119,613.59	11,119,613.59
本期申购	221,289.95	221,289.95
本期赎回（以“-”号填列）	-609,801.99	-609,801.99
本期末	10,731,101.55	10,731,101.55

华泰紫金中证 500 指数增强发起 C

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	6,553,301.43	6,553,301.43
本期申购	5,677,201.38	5,677,201.38
本期赎回（以“-”号填列）	-5,372,337.82	-5,372,337.82
本期末	6,858,164.99	6,858,164.99

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

华泰紫金中证 500 指数增强发起 A

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	-1,189,565.04	-280,051.62	-1,469,616.66
本期期初	-1,189,565.04	-280,051.62	-1,469,616.66
本期利润	1,057,700.15	-4,890.45	1,052,809.70
本期基金份额交易产生的变动数	37,045.16	-16,794.05	20,251.11
其中：基金申购款	-30,047.79	1,006.69	-29,041.10
基金赎回款	67,092.95	-17,800.74	49,292.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-94,819.73	-301,736.12	-396,555.85

华泰紫金中证 500 指数增强发起 C

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	-720,679.69	-165,052.40	-885,732.09
本期期初	-720,679.69	-165,052.40	-885,732.09
本期利润	714,843.79	178,163.52	893,007.31
本期基金份额交易产生的变动数	-104,511.49	-205,214.42	-309,725.91
其中：基金申购款	-764,173.55	-10,022.80	-774,196.35
基金赎回款	659,662.06	-195,191.62	464,470.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-110,347.39	-192,103.30	-302,450.69

7.4.7.10 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 2 月 22 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,172.03	5,439.53
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	1,189.69	1,196.44
其他	97.12	117.50
合计	3,458.84	6,753.47

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 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 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,609,304.26	-2,312,515.49
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	1,609,304.26	-2,312,515.49

7.4.7.11.2 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 2 月 22 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	110,241,882.64	91,532,155.08
减：卖出股票成本总额	108,486,434.28	93,648,635.30
减：交易费用	146,144.10	196,035.27
买卖股票差价收入	1,609,304.26	-2,312,515.49

7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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2月22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	11,082.30	1.95
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收入	-364.86	1,701.66
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	10,717.44	1,703.61

7.4.7.13.2 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2月22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	1,216,123.44	9,704.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,201,916.86	8,000.00
减：应计利息总额	14,571.44	1.95
减：交易费用	-	0.39
买卖债券差价收入	-364.86	1,701.66

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.17 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 31日	上年度可比期间 2023年2月22日(基金合同生 效日)至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	347,459.47	324,456.77
证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	347,459.47	324,456.77

7.4.7.18 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2月22日(基金合同生 效日)至2023年12月31日
1.交易性金融资产	173,273.07	-595,215.71
——股票投资	173,830.21	-595,215.71
——债券投资	-557.14	-
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	173,273.07	-595,215.71

7.4.7.19 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2月22日（基金合同生效日） 至2023年12月31日
基金赎回费收入	399.13	237.53
合计	399.13	237.53

7.4.7.20 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无持有基金产生的费用。

7.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.22 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2月22日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
审计费用	15,000.00	-
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行手续费	1,018.70	951.43

存托服务费	11.21	-
开户费	-	400.00
合计	16,029.91	1,351.43

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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，并以一般交易价格为定价基础。

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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年2月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
华泰证券	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

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方的交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日	占当期债券成交总额的比例	2023年2月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日	占当期债券成交总额的比例
成交金额		成交金额		
华泰证券	-	-	9,701.57	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日	占当期债券回购成交总额的比例	2023年2月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日	占当期债券回购成交总额的比例
成交金额		成交金额		
华泰证券	-	-	21,600,000.00	100.00%

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			
	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2月22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	77,528.07	72.23%	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2、该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》(中国证监会监督管理委员会公告(2024)3号)相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后,被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用,其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年2月22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	131,155.29	135,540.04
其中: 应支付销售机构的客户维护 费	29,986.67	35,623.18
应支付基金管理人的净管理费	101,168.62	99,916.86

注: 本基金的基金管理费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。计算公式为: 日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/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2月22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	24,591.58	25,413.68

注: 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为: 日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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	本期 2024年1月1日至2024年12月31日
---------	-----------------------------

的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金中证 500 指数 增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增 强发起 C	合计
华泰证券股份有限公 司	-	9,041.49	9,041.49
兴业银行股份有限公 司	-	15,625.31	15,625.31
合计	-	24,666.80	24,666.80
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 2023年2月22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销售服务费		
	华泰紫金中证500指数 增强发起A	华泰紫金中证500指数增 强发起C	合计
兴业银行股份有限公 司	-	20,555.51	20,555.51
华泰证券股份有限公 司	-	10,335.78	10,335.78
合计	-	30,891.29	30,891.29

注：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 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.4% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C 类基金份额每日基金销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值 \times 0.4%/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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与转融通证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与转融通证券出借业务。

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

份额单位：份

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2月22日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
		上年度可比期间 2023年2月22日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	

	华泰紫金中证 500指数增强发起 A	华泰紫金中证 500指数增强发起C	华泰紫金中证 500指数增强发起A	华泰紫金中证 500指数增强发起C
基金合同生效日 (2023年2月22日)	-	-	10,009,695.14	-
持有的基金份额				
报告期初持有的基 金份额	10,009,695. 14	-	-	-
报告期间申购/ 买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆 分变动份额	-	-	-	-
减: 报告期间赎 回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有 的基金份额	10,009,695. 14	-	10,009,695.14	-
报告期末持有 的基金份额占基金 总份额比例	93.28%	-	90.02%	-

注：期末持有的基金份额占基金总份额比例为期末持有份额占基金同类份额的比例。

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

本期及上年度末，本基金未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31 日	当期利息 收入	2023年2月22日(基金合同生效 日)至2023年12月31日	当期利息 收入
期末余额	当期利息 收入	期末余额	当期利息 收入	
兴业银行股份有限公	131,064.22	2,172.03	1,216,373.30	5,439.53

司				
---	--	--	--	--

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金未投资基金。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系。公司全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效风险管理应对机制以及良好的风险管理文化。

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：公司董事会及合规与风险控制委员会，监事，公司管理层及合规和风险管理委员会，风险管理部及各专业风险管理部门、各业务部门/职能部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，下设合规与风险控制委员会。董事会承担公司全面风险管理的最终责任，主要负责审议批准公司全面风险管理的总体目标、基本政策和基本制度、公司年度风险管理报告、公司风险管理机构设置及其职责，监督和评估公司风险控制制度的执行情况，对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估审议等。

公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责对董事和高级管理人员在风险管理方面的履职尽责情况进行监督。

公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制定并完善公司风险管理制度，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制，制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等基本政策的具体执行方案，确保其有效落实，定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系，建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制等。

公司管理层下设合规和风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险及合规管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险及合规评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险及合规稽核报告，指导风险管理及合规稽核部门工作，初步审议公司全面风险管理的基本制度，初步审议公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等。

公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理，包括推动公司全面风险管理体系建设，牵头领导公司风险管理，监测、评估、报告公司整体风险水平，推进公司创新业务风险管理审查和评估，培育公司良好的风险管理文化，负责风险管理政策和理念的宣导，推进实施先进的风险

管理方法和工具，提高风险管理的有效性等。公司保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权，同时保障首席风险官的独立性。

公司指定风险管理部履行全面风险管理职责，包括牵头建立完善公司全面风险管理体系，分解落实全面风险管理的各项要求，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和投资合规性风险，构建专业风险管理体系，并制定相应的风险管理政策，分解管理和执行责任，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用，对重点风险领域和重点业务环节进行风险监控、评估和审查，对所识别的重要风险进行预警、提示，牵头应对和处置公司层面重大风险事件，负责对新业务和重大风险业务或项目组织进行独立风险审核及评估，统筹管理公司风险管理培训，促进公司形成良好的风险文化等。

公司专业风险管理部门包括信息技术部、战略发展部、合规稽核部。其中，信息技术部负责牵头管理公司的信息技术风险；战略发展部负责牵头管理公司的声誉风险；合规稽核部负责牵头管理公司的合规风险（除投资合规性风险）、法律风险和洗钱风险。

公司其他各部门对各自条线的风险管理工作负责，负责落实公司及风险管理部制定的各项政策、流程和措施，接受风险管理部的指导以及对各类风险管理、执行责任的分解。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在商业信誉良好的股份制银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2024年12月31日	2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	916,552.39	-
合计	916,552.39	-

注：1、持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示，下同。

2、上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。未评级部分为利率债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，均能及时变现。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资产的公允价值。

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，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，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。

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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施, 本基金在本报告期内的流动性情况良好。

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。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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	131,064.22	-	-	-	131,064.22
结算备付金	84,699.89	-	-	-	84,699.89
存出保证金	7,293.26	-	-	-	7,293.26
交易性金融资产	916,552.39	-	-	15,808,534.88	16,725,087.27
应收申购款	-	-	-	11.00	11.00
应收证券清算款	-	-	-	1,162.41	1,162.41
资产总计	1,139,609.76	-	-	15,809,708.29	16,949,318.05

负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	11,687.45	11,687.45
应付托管费	-	-	-	2,191.38	2,191.38
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	2,278.60	2,278.60
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	13,077.72	13,077.72
其他负债	-	-	-	29,822.90	29,822.90
负债总计	-	-	-	59,058.05	59,058.05
利率敏感度缺口	1,139,609.76	-	-	15,750,650.24	16,890,260.00
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,216,373.30	-	-	-	1,216,373.30
结算备付金	82,502.21	-	-	-	82,502.21
存出保证金	7,358.23	-	-	-	7,358.23
交易性金融资产	-	-	-	14,379,853.34	14,379,853.34
应收申购款	-	-	-	386.14	386.14
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	1,306,233.74	-	-	14,380,239.48	15,686,473.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,924.43	1,924.43
应付管理人报酬	-	-	-	10,392.05	10,392.05
应付托管费	-	-	-	1,948.51	1,948.51
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	1,926.54	1,926.54
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	324,039.93	324,039.93

其他负债	-	-	-	28,675.49	28,675.49
负债总计	-	-	-	368,906.95	368,906.95
利率敏感度缺口	1,306,233.74	-	-	14,011,332.53	15,317,566.27

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4.银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。		
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
分析	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25BP	230.28	-
	市场利率上升 25BP	-230.10	-

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

基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	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	15,808,534.8 8	93.6 0	14,379,853.34	93.8 8
交易性金融资产—基金投 资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投 资	916,552.39	5.43	-	-
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	16,725,087.2 7	99.0 2	14,379,853.34	93.8 8

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日 后短期内保持不变；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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%	948,036.93	702,300.00
	业绩比较基准下降 5%	-948,036.93	-702,300.00

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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	15,808,534.88	14,379,853.34
第二层次	916,552.39	-
第三层次	-	-
合计	16,725,087.27	14,379,853.34

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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金持有的金融工具无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金无公允价值计量结果所属层次为第三层次的金融工具。

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

本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的金融工具。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

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工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	15,808,534.88	93.27
	其中：股票	15,808,534.88	93.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	916,552.39	5.41
	其中：债券	916,552.39	5.41
	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	215,764.11	1.27

7	其他各项资产	8,466.67	0.05
8	合计	16,949,318.05	100.00

注：1、本基金报告期末未持有港股通股票。

2、本基金报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	824,363.00	4.88
C	制造业	8,400,948.80	49.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	524,049.00	3.10
E	建筑业	213,932.00	1.27
F	批发和零售业	482,224.00	2.86
G	交通运输、仓储和邮政业	270,139.00	1.60
H	住宿和餐饮业	84,569.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	981,437.00	5.81
J	金融业	1,411,199.00	8.36
K	房地产业	177,559.00	1.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	67,389.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	108,576.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	108,528.00	0.64
R	文化、体育和娱乐业	1,501.00	0.01

S	综合	-	-
	合计	13,656,413.80	80.85

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	29,718.00	0.18
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,296,119.08	7.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,744.00	0.16
E	建筑业	64,350.00	0.38
F	批发和零售业	93,368.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	539,786.00	3.20
J	金融业	-	-
K	房地产业	40,848.00	0.24
L	租赁和商务服务业	60,188.00	0.36
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	2,152,121.08	12.74

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	占基金资产净值比例(%)
1	600418	江淮汽车	4,700.00	176,250.00	1.04
2	300207	欣旺达	7,500.00	167,325.00	0.99
3	600096	云天化	7,500.00	167,250.00	0.99
4	002273	水晶光电	7,500.00	166,650.00	0.99
5	601555	东吴证券	21,000.00	163,800.00	0.97
6	601168	西部矿业	10,100.00	162,307.00	0.96
7	689009	九号公司	3,400.00	161,500.00	0.96
8	601108	财通证券	19,200.00	156,864.00	0.93
9	600352	浙江龙盛	15,100.00	155,379.00	0.92
10	002078	太阳纸业	10,400.00	154,648.00	0.92
11	600879	航天电子	17,000.00	152,320.00	0.90
12	600862	中航高科	6,000.00	151,560.00	0.90
13	002517	恺英网络	11,100.00	151,071.00	0.89
14	000783	长江证券	22,000.00	150,040.00	0.89
15	002202	金风科技	14,500.00	149,785.00	0.89
16	002532	天山铝业	18,900.00	148,743.00	0.88
17	600109	国金证券	17,000.00	148,410.00	0.88
18	688122	西部超导	3,400.00	145,588.00	0.86
19	002128	电投能源	7,400.00	144,892.00	0.86
20	600143	金发科技	16,700.00	144,288.00	0.85
21	000738	航发控制	6,300.00	140,112.00	0.83
22	601179	中国西电	18,300.00	138,897.00	0.82
23	600141	兴发集团	6,400.00	138,880.00	0.82
24	002507	涪陵榨菜	9,700.00	137,061.00	0.81
25	002939	长城证券	16,700.00	136,940.00	0.81
26	300002	神州泰岳	11,800.00	136,762.00	0.81
27	601997	贵阳银行	22,700.00	136,200.00	0.81
28	300001	特锐德	6,200.00	136,090.00	0.81
29	300558	贝达药业	2,500.00	134,825.00	0.80
30	000728	国元证券	16,000.00	133,760.00	0.79
31	601717	郑煤机	10,210.00	132,525.80	0.78
32	688002	睿创微纳	2,800.00	131,628.00	0.78
33	600038	中直股份	3,400.00	131,104.00	0.78
34	600487	亨通光电	7,600.00	130,872.00	0.77

35	688120	华海清科	800.00	130,392.00	0.77
36	300529	健帆生物	4,400.00	129,096.00	0.76
37	600348	华阳股份	18,200.00	129,038.00	0.76
38	002850	科达利	1,300.00	126,984.00	0.75
39	300724	捷佳伟创	2,000.00	126,420.00	0.75
40	601666	平煤股份	12,600.00	126,252.00	0.75
41	300373	扬杰科技	2,900.00	126,208.00	0.75
42	603606	东方电缆	2,400.00	126,120.00	0.75
43	000997	新大陆	6,300.00	125,685.00	0.74
44	600655	豫园股份	19,400.00	124,742.00	0.74
45	002508	老板电器	5,800.00	124,294.00	0.74
46	300601	康泰生物	7,200.00	123,480.00	0.73
47	601866	中远海发	47,200.00	123,192.00	0.73
48	002152	广电运通	10,500.00	122,430.00	0.72
49	600968	海油发展	28,600.00	122,122.00	0.72
50	600583	海油工程	22,300.00	121,981.00	0.72
51	002409	雅克科技	2,100.00	121,695.00	0.72
52	000878	云南铜业	9,900.00	120,681.00	0.71
53	300054	鼎龙股份	4,600.00	119,692.00	0.71
54	600021	上海电力	13,000.00	119,210.00	0.71
55	688772	珠海冠宇	7,400.00	118,992.00	0.70
56	600563	法拉电子	1,000.00	118,920.00	0.70
57	600062	华润双鹤	6,000.00	118,800.00	0.70
58	600380	健康元	10,500.00	118,335.00	0.70
59	601966	玲珑轮胎	6,500.00	117,260.00	0.69
60	002262	恩华药业	4,700.00	114,445.00	0.68
61	600995	南网储能	11,300.00	114,356.00	0.68
62	002368	太极股份	4,800.00	113,664.00	0.67
63	002120	韵达股份	15,100.00	113,552.00	0.67
64	600131	国网信通	6,000.00	113,460.00	0.67
65	002430	杭氧股份	5,200.00	113,360.00	0.67
66	002653	海思科	3,400.00	113,050.00	0.67
67	603927	中科软	5,200.00	112,840.00	0.67
68	600582	天地科技	18,200.00	112,476.00	0.67
69	000032	深桑达 A	6,200.00	109,368.00	0.65
70	002385	大北农	25,100.00	108,683.00	0.64
71	002266	浙富控股	34,800.00	108,576.00	0.64
72	301267	华夏眼科	5,700.00	108,528.00	0.64
73	601061	中信金属	14,900.00	108,174.00	0.64
74	001227	兰州银行	43,700.00	107,502.00	0.64
75	002500	山西证券	17,000.00	106,760.00	0.63
76	600685	中船防务	4,500.00	106,650.00	0.63
77	002432	九安医疗	2,600.00	106,028.00	0.63

78	603000	人民网	4,700.00	103,588.00	0.61
79	600008	首创环保	31,300.00	102,664.00	0.61
80	600739	辽宁成大	9,700.00	100,395.00	0.59
81	600663	陆家嘴	10,200.00	100,368.00	0.59
82	002019	亿帆医药	9,300.00	99,696.00	0.59
83	000830	鲁西化工	8,500.00	99,365.00	0.59
84	603596	伯特利	2,200.00	98,098.00	0.58
85	000039	中集集团	12,200.00	94,794.00	0.56
86	601991	大唐发电	33,100.00	94,335.00	0.56
87	003031	中瓷电子	1,800.00	94,302.00	0.56
88	000400	许继电气	3,400.00	93,602.00	0.55
89	301301	川宁生物	7,800.00	92,508.00	0.55
90	600872	中炬高新	4,200.00	92,484.00	0.55
91	688072	拓荆科技	600.00	92,202.00	0.55
92	600170	上海建工	34,000.00	90,100.00	0.53
93	603179	新泉股份	2,100.00	89,670.00	0.53
94	002984	森麒麟	3,600.00	88,776.00	0.53
95	600801	华新水泥	6,900.00	83,490.00	0.49
96	600885	宏发股份	2,600.00	82,732.00	0.49
97	688234	天岳先进	1,600.00	81,920.00	0.49
98	600704	物产中大	15,600.00	78,936.00	0.47
99	600295	鄂尔多斯	7,300.00	71,248.00	0.42
100	600316	洪都航空	2,200.00	70,664.00	0.42
101	603939	益丰药房	2,900.00	69,977.00	0.41
102	688248	南网科技	2,100.00	67,389.00	0.40
103	000883	湖北能源	13,400.00	66,732.00	0.40
104	603087	甘李药业	1,500.00	66,150.00	0.39
105	000932	华菱钢铁	15,200.00	63,536.00	0.38
106	600258	首旅酒店	4,300.00	63,081.00	0.37
107	002841	视源股份	1,700.00	62,747.00	0.37
108	688777	中控技术	1,100.00	54,637.00	0.32
109	000060	中金岭南	11,400.00	53,466.00	0.32
110	000987	越秀资本	7,600.00	53,352.00	0.32
111	688099	晶晨股份	750.00	51,510.00	0.30
112	600848	上海临港	5,000.00	50,500.00	0.30
113	002625	光启技术	1,000.00	47,800.00	0.28
114	603129	春风动力	300.00	47,121.00	0.28
115	688249	晶合集成	2,000.00	46,680.00	0.28
116	300136	信维通信	1,700.00	43,248.00	0.26
117	600901	江苏金租	8,000.00	41,760.00	0.25
118	300699	光威复材	1,200.00	41,580.00	0.25
119	600060	海信视像	2,000.00	39,880.00	0.24
120	600177	雅戈尔	4,100.00	36,490.00	0.22

121	600928	西安银行	8,600.00	31,046.00	0.18
122	601577	长沙银行	3,300.00	29,337.00	0.17
123	600578	京能电力	7,600.00	26,752.00	0.16
124	002244	滨江集团	3,100.00	26,691.00	0.16
125	688047	龙芯中科	200.00	26,456.00	0.16
126	002138	顺络电子	800.00	25,184.00	0.15
127	000401	冀东水泥	4,800.00	25,104.00	0.15
128	600004	白云机场	2,600.00	24,960.00	0.15
129	600754	锦江酒店	800.00	21,488.00	0.13
130	603298	杭叉集团	1,200.00	21,468.00	0.13
131	688005	容百科技	600.00	18,930.00	0.11
132	600271	航天信息	2,000.00	18,220.00	0.11
133	601001	晋控煤业	1,300.00	17,771.00	0.11
134	603605	珀莱雅	200.00	16,940.00	0.10
135	600517	国网英大	2,800.00	15,428.00	0.09
136	601611	中国核建	1,600.00	14,464.00	0.09
137	300604	长川科技	300.00	13,239.00	0.08
138	600528	中铁工业	1,400.00	11,284.00	0.07
139	601156	东航物流	500.00	8,435.00	0.05
140	600535	天士力	500.00	7,230.00	0.04
141	002294	信立泰	100.00	3,093.00	0.02
142	601098	中南传媒	100.00	1,501.00	0.01

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	000725	京东方A	23,800.00	104,482.00	0.62
2	600219	南山铝业	23,400.00	91,494.00	0.54
3	688200	华峰测控	800.00	83,600.00	0.49
4	600419	天润乳业	8,900.00	82,859.00	0.49
5	603799	华友钴业	2,800.00	81,928.00	0.49
6	688568	中科星图	1,600.00	81,648.00	0.48
7	688379	华光新材	3,974.00	81,149.08	0.48
8	600448	华纺股份	29,900.00	79,235.00	0.47
9	688692	达梦数据	200.00	72,888.00	0.43
10	688251	井松智能	4,400.00	71,104.00	0.42
11	688051	佳华科技	3,400.00	70,788.00	0.42
12	688013	天臣医疗	4,000.00	70,440.00	0.42
13	300666	江丰电子	1,000.00	69,450.00	0.41

14	300710	万隆光电	3,800.00	67,868.00	0.40
15	688296	和达科技	5,900.00	66,198.00	0.39
16	688109	品茗科技	2,700.00	66,177.00	0.39
17	601618	中国中冶	19,500.00	64,350.00	0.38
18	688026	洁特生物	4,800.00	61,584.00	0.36
19	603729	龙韵股份	4,100.00	60,188.00	0.36
20	688004	博汇科技	3,600.00	54,504.00	0.32
21	600128	苏豪弘业	6,400.00	51,968.00	0.31
22	301033	迈普医学	1,200.00	50,460.00	0.30
23	300634	彩讯股份	2,100.00	45,780.00	0.27
24	000708	中信特钢	4,000.00	45,640.00	0.27
25	301022	海泰科	2,100.00	42,630.00	0.25
26	300051	琏升科技	6,300.00	42,147.00	0.25
27	300650	太龙股份	3,600.00	41,400.00	0.25
28	603506	南都物业	4,800.00	40,848.00	0.24
29	002371	北方华创	100.00	39,100.00	0.23
30	688012	中微公司	200.00	37,832.00	0.22
31	603337	杰克股份	1,200.00	36,552.00	0.22
32	002825	纳尔股份	3,900.00	30,498.00	0.18
33	300498	温氏股份	1,800.00	29,718.00	0.18
34	600149	廊坊发展	6,800.00	27,744.00	0.16
35	600779	水井坊	500.00	26,760.00	0.16
36	688316	青云科技	766.00	25,661.00	0.15
37	688659	元琛科技	3,800.00	25,650.00	0.15
38	300069	金利华电	1,200.00	15,804.00	0.09
39	600570	恒生电子	500.00	13,995.00	0.08

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	601666	平煤股份	678,769.00	4.43
2	300207	欣旺达	674,405.00	4.40
3	300866	安克创新	587,989.00	3.84
4	000933	神火股份	582,364.00	3.80
5	601665	齐鲁银行	575,370.00	3.76
6	300002	神州泰岳	574,873.00	3.75
7	000400	许继电气	564,235.00	3.68
8	600765	中航重机	551,238.00	3.60

9	688188	柏楚电子	546,710.00	3.57
10	002444	巨星科技	535,833.00	3.50
11	600062	华润双鹤	520,956.00	3.40
12	600879	航天电子	516,949.00	3.37
13	600642	申能股份	512,438.00	3.35
14	002273	水晶光电	511,403.00	3.34
15	600985	淮北矿业	502,031.00	3.28
16	002025	航天电器	486,151.00	3.17
17	300373	扬杰科技	484,689.00	3.16
18	600295	鄂尔多斯	474,273.00	3.10
19	000683	远兴能源	466,189.00	3.04
20	000423	东阿阿胶	461,520.70	3.01
21	002608	江苏国信	461,005.00	3.01
22	600885	宏发股份	458,941.00	3.00
23	002850	科达利	456,641.00	2.98
24	601168	西部矿业	452,763.00	2.96
25	300114	中航电测	451,900.00	2.95
26	600373	中文传媒	450,940.00	2.94
27	300699	光威复材	448,024.00	2.92
28	688153	唯捷创芯	447,061.88	2.92
29	601019	山东出版	441,763.00	2.88
30	300017	网宿科技	440,377.00	2.87
31	600066	宇通客车	438,592.00	2.86
32	300558	贝达药业	438,466.00	2.86
33	002653	海思科	435,484.00	2.84
34	600008	首创环保	434,847.00	2.84
35	688002	睿创微纳	434,044.00	2.83
36	600131	国网信通	426,565.00	2.78
37	688234	天岳先进	418,422.50	2.73
38	600038	中直股份	417,970.00	2.73
39	300601	康泰生物	417,652.00	2.73
40	002266	浙富控股	417,503.00	2.73
41	688099	晶晨股份	417,357.90	2.72
42	688169	石头科技	417,248.00	2.72
43	603893	瑞芯微	417,157.00	2.72
44	601991	大唐发电	405,682.00	2.65
45	002595	豪迈科技	405,358.00	2.65
46	600282	南钢股份	404,705.00	2.64
47	002056	横店东磁	400,203.00	2.61
48	002078	太阳纸业	395,710.00	2.58
49	300054	鼎龙股份	394,834.00	2.58
50	002517	恺英网络	394,068.00	2.57
51	601098	中南传媒	387,940.00	2.53

52	688777	中控技术	384,158.29	2.51
53	601866	中远海发	383,535.00	2.50
54	601611	中国核建	382,919.00	2.50
55	601058	赛轮轮胎	382,141.00	2.49
56	688120	华海清科	381,718.13	2.49
57	600968	海油发展	379,928.00	2.48
58	000729	燕京啤酒	370,961.00	2.42
59	688617	惠泰医疗	370,192.00	2.42
60	600535	天士力	367,931.00	2.40
61	000997	新大陆	367,193.00	2.40
62	601928	凤凰传媒	361,701.00	2.36
63	601966	玲珑轮胎	361,002.00	2.36
64	601216	君正集团	358,390.00	2.34
65	603298	杭叉集团	357,469.00	2.33
66	000032	深桑达 A	354,033.00	2.31
67	688349	三一重能	353,996.00	2.31
68	002465	海格通信	351,658.00	2.30
69	600329	达仁堂	349,221.00	2.28
70	002156	通富微电	348,274.00	2.27
71	600271	航天信息	346,386.00	2.26
72	300136	信维通信	343,638.00	2.24
73	600141	兴发集团	343,188.00	2.24
74	600170	上海建工	341,656.00	2.23
75	002945	华林证券	333,339.00	2.18
76	688122	西部超导	331,995.00	2.17
77	002244	滨江集团	330,907.00	2.16
78	600177	雅戈尔	330,602.00	2.16
79	601198	东兴证券	328,282.00	2.14
80	300502	新易盛	326,978.00	2.13
81	603650	彤程新材	326,501.00	2.13
82	688213	思特威	326,096.00	2.13
83	601179	中国西电	323,461.00	2.11
84	300604	长川科技	322,958.00	2.11
85	002262	恩华药业	322,526.00	2.11
86	600704	物产中大	319,339.00	2.08
87	600517	国网英大	317,443.00	2.07
88	000878	云南铜业	317,261.00	2.07
89	000783	长江证券	316,613.00	2.07
90	002831	裕同科技	315,943.00	2.06
91	600096	云天化	309,697.00	2.02
92	688180	君实生物	309,466.76	2.02
93	688516	奥特维	308,599.28	2.01
94	002984	森麒麟	307,338.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交量）填列，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	300866	安克创新	721,884.00	4.71
2	000933	神火股份	687,166.00	4.49
3	601665	齐鲁银行	676,037.00	4.41
4	600066	宇通客车	644,043.00	4.20
5	300207	欣旺达	641,828.00	4.19
6	601666	平煤股份	635,946.00	4.15
7	600765	中航重机	631,506.00	4.12
8	002025	航天电器	603,489.00	3.94
9	000400	许继电气	588,935.00	3.84
10	000683	远兴能源	584,898.00	3.82
11	002444	巨星科技	572,788.00	3.74
12	002273	水晶光电	568,520.32	3.71
13	603893	瑞芯微	566,537.00	3.70
14	000423	东阿阿胶	564,857.00	3.69
15	688169	石头科技	555,538.00	3.63
16	300114	中航电测	551,051.00	3.60
17	600642	申能股份	543,763.00	3.55
18	688188	柏楚电子	543,745.00	3.55
19	600282	南钢股份	527,148.00	3.44
20	600985	淮北矿业	518,824.00	3.39
21	002056	横店东磁	515,459.00	3.37
22	600879	航天电子	506,090.00	3.30
23	300017	网宿科技	484,101.00	3.16
24	300002	神州泰岳	476,581.00	3.11
25	600873	梅花生物	469,503.00	3.07
26	601058	赛轮轮胎	461,548.00	3.01
27	601098	中南传媒	461,295.00	3.01
28	002608	江苏国信	458,973.00	3.00
29	601019	山东出版	453,020.00	2.96
30	002653	海思科	446,901.00	2.92
31	002244	滨江集团	441,433.00	2.88
32	688234	天岳先进	439,072.48	2.87
33	688153	唯捷创芯	438,570.90	2.86
34	002595	豪迈科技	438,180.00	2.86

35	600373	中文传媒	437,619.00	2.86
36	000729	燕京啤酒	435,807.00	2.85
37	300136	信维通信	433,293.00	2.83
38	601958	金钼股份	423,264.00	2.76
39	600295	鄂尔多斯	419,368.00	2.74
40	601077	渝农商行	414,976.00	2.71
41	300699	光威复材	408,595.00	2.67
42	601168	西部矿业	408,111.00	2.66
43	300558	贝达药业	407,997.00	2.66
44	600517	国网英大	405,742.00	2.65
45	300502	新易盛	402,558.00	2.63
46	603228	景旺电子	402,117.00	2.63
47	688099	晶晨股份	401,838.88	2.62
48	601928	凤凰传媒	400,705.00	2.62
49	603338	浙江鼎力	400,695.00	2.62
50	002945	华林证券	400,243.00	2.61
51	688180	君实生物	396,988.45	2.59
52	600062	华润双鹤	395,335.00	2.58
53	600885	宏发股份	391,683.00	2.56
54	600970	中材国际	391,410.00	2.56
55	300373	扬杰科技	390,749.00	2.55
56	601991	大唐发电	386,180.00	2.52
57	601611	中国核建	378,929.00	2.47
58	600038	中直股份	378,758.00	2.47
59	688617	惠泰医疗	374,539.00	2.45
60	603650	彤程新材	373,839.00	2.44
61	688213	思特威	372,126.50	2.43
62	600008	首创环保	366,401.00	2.39
63	601216	君正集团	363,970.00	2.38
64	002429	兆驰股份	363,148.00	2.37
65	002156	通富微电	361,804.00	2.36
66	688349	三一重能	361,556.21	2.36
67	600699	均胜电子	355,337.00	2.32
68	600329	达仁堂	352,426.00	2.30
69	601198	东兴证券	351,681.00	2.30
70	002850	科达利	351,482.00	2.29
71	000932	华菱钢铁	350,555.00	2.29
72	600535	天士力	349,621.00	2.28
73	002064	华峰化学	346,214.00	2.26
74	002465	海格通信	343,541.00	2.24
75	002831	裕同科技	343,143.00	2.24
76	600998	九州通	341,768.40	2.23
77	001872	招商港口	341,247.00	2.23

78	600141	兴发集团	339,275.00	2.21
79	601128	常熟银行	337,084.00	2.20
80	600271	航天信息	333,275.00	2.18
81	601966	玲珑轮胎	328,899.00	2.15
82	600704	物产中大	327,308.00	2.14
83	688819	天能股份	324,203.45	2.12
84	300474	景嘉微	324,015.00	2.12
85	000937	冀中能源	321,881.00	2.10
86	300604	长川科技	320,151.00	2.09
87	600177	雅戈尔	320,013.00	2.09
88	688516	奥特维	316,582.41	2.07
89	000960	锡业股份	314,861.00	2.06
90	600131	国网信通	313,266.00	2.05
91	600521	华海药业	312,788.00	2.04
92	002138	顺络电子	312,785.00	2.04
93	603298	杭叉集团	310,072.00	2.02
94	600598	北大荒	309,526.00	2.02
95	601866	中远海发	307,305.00	2.01
96	300054	鼎龙股份	306,665.00	2.00

注： "卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，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	109,741,285.61
卖出股票收入（成交）总额	110,241,882.64

注： "买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	916,552.39	5.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	916,552.39	5.43

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	8,000.00	815,288.99	4.83
2	019740	24 国债 09	1,000.00	101,263.40	0.60

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期末未投资基金。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东吴证券在报告编制日前一年内曾受到中国证监会处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

8.13.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 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	7,293.26
2	应收清算款	1,162.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,466.67

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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的情况。

8.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
华泰紫金中 证 500 指数增强 发起 A	107	100,29 0.67	10,009,69 5.14	93. 28%	721,406.4 1	6.7 2%
华泰紫金中 证 500 指数增强 发起 C	93	73,743. 71	0.00	0.0 0%	6,858,164. 99	100 .00%
合计	200	87,946. 33	10,009,69 5.14	56. 91%	7,579,571. 40	43. 09%

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	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	221,654.76	2.07%
	华泰紫金中证 500	0.00	0.00%

	指数增强发起 C		
	合计	221,654.76	1.26%

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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	0~10
	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	10~50
	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C	0
	合计	10~50

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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,695.14	56.91%	10,000,000.00	56.85%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,009,695.14	56.91%	10,000,000.00	56.85%	3 年

注：1、持有份额总数部分包含利息结转的份额。

2、占基金总份额比例为持有基金份额与各类基金份额合计数的比例。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金中证 500 指数增强发起 A	华泰紫金中证 500 指数增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 22 日）基金份额总额	11,275,937.81	16,356,094.86
本报告期期初基金份额总额	11,119,613.59	6,553,301.43
本报告期基金总申购份额	221,289.95	5,677,201.38
减：本报告期基金总赎回份额	609,801.99	5,372,337.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,731,101.55	6,858,164.99

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动；聂挺进先生不再担任本基金管理人总经理职务，江晓阳先生新任本基金管理人总经理职务，刘玉生先生不再担任本基金管理人副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期的投资策略无改变。

11.5 本报告期持有的基金发生重大影响事件

无。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 15,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效日起至本报告期末。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-05-17
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	基金管理人被采取出具警示函的行政监管措施，相关高级管理人员被采取出具警示函的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	管理人存在支持民营企业发展资产管理计划投向纾困用途的资金未达到规定比例、对交易对手方尽职调查不充分等问题
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	管理人高度重视、诚恳接受，已整改完毕并报送整改报告
其他	无

11.7.1 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽核或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	2	219,983,168.25	100.00%	76,915.81	100.00%	-

注：1、管理人选择证券公司的标准：

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉。
- (2) 内控管理规范、制度健全，包括但不限于：有健全的业务管理制度和风险管理制度；有规范的运营管理制度和业务操作流程；合规管理制度体系健全、合规管理组织架构完整清晰、合规管理人员配备充足。
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- (4) 具有较强的全方位服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据管理人的特定要求，提供专门研究报告，积极协助安排上市公司调研；能积极为

管理人投资及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、管理人选择证券公司的程序：

(1) 公司研究、投资、交易、合规、风控、运营等部门根据上述评价标准确定合作券商名单，提请公募投决会、督察长审议通过后形成白名单库，提供证券交易服务的证券公司需从白名单中确定。

(2) 公司和被选中的证券公司签订协议，并通知基金托管人。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更。

11.8.2 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		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
野村东方国际证券	3,304,836.00	100.00%	-	-	-	-

11.9 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	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-15
2	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-19
3	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2023 年 4 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-19
4	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-30
5	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份信息资料的提示	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-02-02
6	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投	基金管理人网站、中国	2024-02-08

	资基金基金产品资料概要更新(202402)	证监会基金电子披露网站、规定报刊等	
7	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新 202402	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-02-08
8	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-02-29
9	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-03-28
10	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-03-28
11	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-01
12	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下部分基金 2024 年 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-08
13	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-19
14	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下部分基金 2024 年 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-19
15	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新(202406)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-06-24
16	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-07-08
17	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-07-18
18	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下全部基金 2024 年 2 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-07-18
19	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-08-29
20	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下全部基金 2024 年中期报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-08-29

21	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-09-06
22	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票估值调整的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-09-30
23	华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-10-24
24	关于防范和识别不法分子假冒华泰证券(上海)资产管理有限公司名义从事非法证券活动的严正声明	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-10-24
25	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下全部基金 2024 年 3 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-10-24

§ 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	2024-01-01 至 2024-12-31	10,009,695.14	0.00	0.00	10,009,695.14	56.91%

产品特有风险

- 本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；
- 大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；
- 单一投资者的大额赎回时容易造成基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- 发起式基金在成立三年后继续存续的，若本基金连续50个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，其他投资者存在终止基金合同的风险；
- 大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- 大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人根据监管规定要求于 2024 年 1 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2024 年 1 月 29 日起，聂挺进先生因个人原因离职，不再担任公司总经理职务。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2024 年 2 月 29 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2024 年 2 月 28 日起，江晓阳先生新任本基金管理人总经理。

3、本基金管理人根据监管规定要求于 2024 年 4 月 1 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2024 年 3 月 31 日起，刘玉生先生因个人原因离职，不再担任公司副总经理职务。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、《关于申请募集注册华泰紫金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金之法律意见书》；
- 8、基金产品资料概要；
- 9、中国证监会规定的其他备查文件。

13.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话：4008895597；公司网址：<https://htamc.htsc.com.cn/>。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二五年三月三十一日