

# 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 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	53

7.7 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 .....	53
7.8 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 .....	53
7.9 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 .....	53
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	53
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.13 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.3 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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
10.2 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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
11.1 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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接	
基金主代码	460300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 5 月 29 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,914,604,850.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	460300	006131
报告期末下属分级基金的份额总额	1,718,109,439.60 份	1,196,495,411.36 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为沪深 300ETF 的联接基金。沪深 300ETF 是主要采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。
业绩比较基准	沪深 300 指数 × 95% + 银行活期存款税后收益率 × 5%
风险收益特征	本基金为沪深 300ETF 的联接基金，采用主要投资于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与沪深 300 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200135	100140
法定代表人		贾波	廖林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
------------	-------------------------------------

和指标	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C
本期已实现收益	-50,357,832.21	-41,716,473.87
本期利润	25,252,443.36	23,636,874.22
加权平均基金份额本期利润	0.0152	0.0180
本期加权平均净值利润率	1.78%	2.15%
本期基金份额净值增长率	1.68%	1.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-251,820,725.34	-191,863,013.20
期末可供分配基金份额利润	-0.1466	-0.1604
期末基金资产净值	1,466,288,714.26	1,004,632,398.16
期末基金份额净值	0.8534	0.8396
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	71.95%	7.77%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④

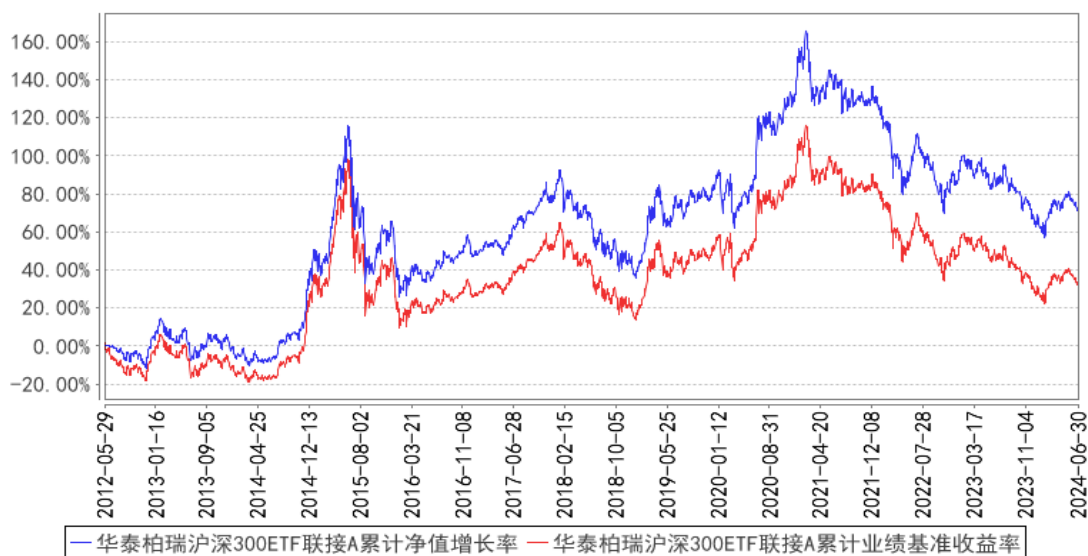
	率①	准差②		④		
过去一个月	-2.40%	0.45%	-3.14%	0.46%	0.74%	-0.01%
过去三个月	-1.02%	0.71%	-2.03%	0.72%	1.01%	-0.01%
过去六个月	1.68%	0.84%	0.88%	0.85%	0.80%	-0.01%
过去一年	-7.61%	0.82%	-9.38%	0.83%	1.77%	-0.01%
过去三年	-28.88%	0.98%	-32.19%	0.99%	3.31%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	71.95%	1.25%	32.56%	1.29%	39.39%	-0.04%

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 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
过去一个月	-2.42%	0.45%	-3.14%	0.46%	0.72%	-0.01%
过去三个月	-1.08%	0.71%	-2.03%	0.72%	0.95%	-0.01%
过去六个月	1.55%	0.84%	0.88%	0.85%	0.67%	-0.01%
过去一年	-7.84%	0.82%	-9.38%	0.83%	1.54%	-0.01%
过去三年	-29.42%	0.98%	-32.19%	0.99%	2.77%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	7.77%	1.14%	-0.72%	1.16%	8.49%	-0.02%

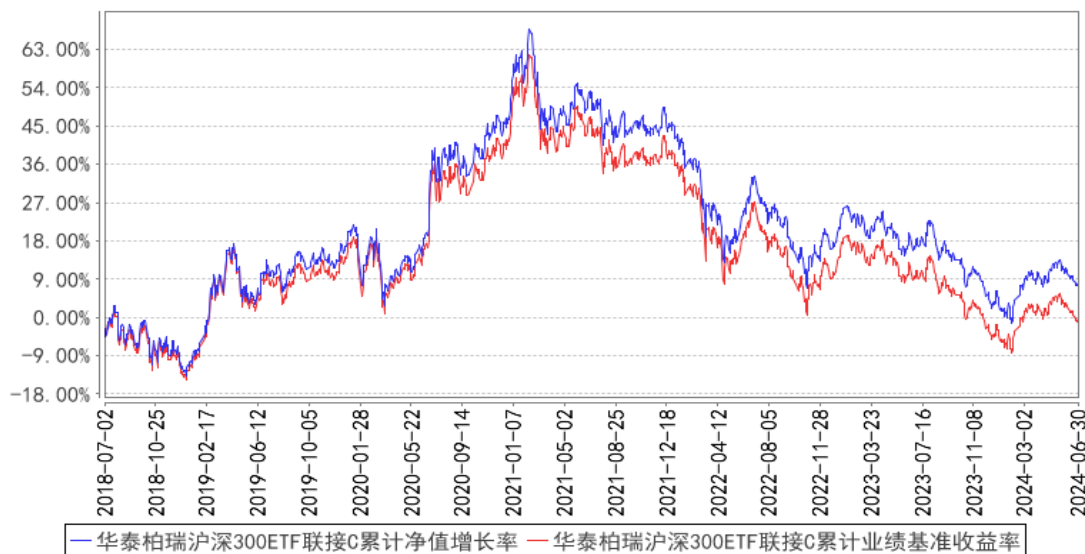
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞沪深300ETF联接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





华泰柏瑞沪深300ETF联接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：A类图示日期为2012年5月29日至2024年6月30日。C类图示日期为2018年7月2日至2024年6月30日。

## § 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6月30日，公司旗下管理156只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII基金、基金中基金等。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024年4月22日	-	6年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018年12月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基	2012年5月29日	-	23年	复旦大学财务管理硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞

	<p>金的基金经理</p>			<p>基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏</p>
--	---------------	--	--	--

					瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 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 3 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年市场以结构性机会为主，其中银行、煤炭、公用事业、家用电器的表现相对较好，涨跌幅分别为 17.02%、11.96%、11.76% 和 8.48%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为 0.89%、-8.96%、-16.84% 和 -10.99%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为 12.54% 和 -7.00%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

2024 年一季度指数先抑后扬，二季度区间振荡，上半年总体来看大盘蓝筹相关指数普遍实现了正收益。随着积极政策的陆续出台，比如 517 房地产“组合拳”、超长期国债的发行等，投资者情绪有望逐步修复。5 月下旬开始，A 股有所调整但调整节奏相较年初明显放缓，市场已逐渐从过度悲观的预期中走出。基本面方面，4-5 月的经济增长数据显示修复过程仍面临诸多挑战，包括有效需求不足、企业经营压力较大等，但外需和设备更新等对经济数据有所支撑，工业生产稳定增长，制造业增速维持韧性。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪业绩基准、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.020%，期间日跟踪误差为 0.031%，较好地实现了本基金的投资目标。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A 的基金份额净值为 0.8534 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.68%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%，截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C 的基金份额净值为 0.8396 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观范式转变下中外金融周期分化，结合积极的稳增长政策及中长期改革，经济动能有望继续温和改善，大盘风格或将持续具有相对收益，建议寻找结构性机会。中期来看，随着中国经济迎来新一轮盈利周期、中美经济周期错位进入下半场等利好因素下，A 股市场的估

值比较具吸引力，性价比突出，配置机会大于风险。

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

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次；每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	126,657,689.05	174,930,725.21
结算备付金		6,473,016.85	7,296,085.43
存出保证金		2,146,888.25	189,781.98
交易性金融资产	6.4.7.2	2,335,651,291.30	2,649,208,433.88
其中：股票投资		81,961,382.74	82,256,252.65
基金投资		2,243,533,757.87	2,566,952,181.23
债券投资		10,156,150.69	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	209,701,631.48
应收股利		-	-
应收申购款		3,203,472.21	5,815,006.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	384,859.50	-
资产总计		2,474,517,217.16	3,047,141,664.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,165.65	-
应付赎回款		3,007,410.53	238,067,079.25

应付管理人报酬		96,538.11	108,761.51
应付托管费		19,307.64	21,752.30
应付销售服务费		202,670.79	366,250.85
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	6.4.7.9	266,012.02	233,070.23
负债合计		3,596,104.74	238,796,914.14
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,914,604,850.96	3,372,638,105.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-443,683,738.54	-564,293,354.98
净资产合计		2,470,921,112.42	2,808,344,750.54
负债和净资产总计		2,474,517,217.16	3,047,141,664.68

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,914,604,850.96 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8534 元，基金份额总额 1,718,109,439.60 份；下属 C 类基金份额净值 0.8396 元，基金份额总额 1,196,495,411.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		51,085,867.89	101,373,052.71
1. 利息收入		329,134.46	531,741.57
其中：存款利息收入	6.4.7.13	329,134.46	531,741.57
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-90,354,325.76	-47,891,068.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,804,251.37	6,750,928.28
基金投资收益	6.4.7.15	-138,051,555.12	-141,807,646.57
债券投资收益	6.4.7.16	64,869.86	66,605.49
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
投资收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	1,524,824.23	-
股利收益	6.4.7.20	47,911,786.64	87,099,044.24
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）	6.4.7.21	140,963,623.66	148,684,304.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	147,435.53	48,075.65
<b>减：二、营业总支出</b>		2,196,550.31	4,495,743.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	581,906.99	893,481.67
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	116,381.45	178,696.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,378,457.67	3,312,728.58
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	119,804.20	110,836.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		48,889,317.58	96,877,309.24
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		48,889,317.58	96,877,309.24
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		48,889,317.58	96,877,309.24

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	3,372,638,105.	-	-564,293,354.9	2,808,344,750.5



	52		8	4
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,372,638,105.52	-	-564,293,354.98	2,808,344,750.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-458,033,254.56	-	120,609,616.44	-337,423,638.12
(一)、综合收益总额	-	-	48,889,317.58	48,889,317.58
(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)	-458,033,254.56	-	71,720,298.86	-386,312,955.70
其中：1. 基金申购款	1,835,365,526.01	-	-294,359,876.00	1,541,005,650.01
2. 基金赎回款	-2,293,398,780.57	-	366,080,174.86	-1,927,318,605.71
(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	2,914,604,850.96	-	-443,683,738.54	2,470,921,112.42
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	5,392,016,186.47	-	-451,910,458.83	4,940,105,727.64

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,392,016,186.47	-	-451,910,458.83	4,940,105,727.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,593,088,499.39	-	221,278,596.82	-2,371,809,902.57
(一)、综合收益总额	-	-	96,877,309.24	96,877,309.24
(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)	-2,593,088,499.39	-	124,401,287.58	-2,468,687,211.81
其中：1. 基金申购款	1,854,907,154.71	-	-128,564,191.42	1,726,342,963.29
2. 基金赎回款	-4,447,995,654.10	-	252,965,479.00	-4,195,030,175.10
(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	2,798,927,687.08	-	-230,631,862.01	2,568,295,825.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,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《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 366,989,094.83 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 171 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2012 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 367,019,682.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 30,587.52 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 6 月 29 日发布的《关于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2018 年 7 月 2 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。在投资者申购时收取申购费用而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者申购时不收取申购费用,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代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括目标 ETF、沪深 300 指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股(一级市场初次发行和增发)、权证、股指期货、货币市场工具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。正常情况下,本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;股指期货以套期保值为目的,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的

规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数  $\times$  95% + 银行活期存款税后收益率  $\times$  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 2024 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 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 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间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 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明

确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	126,657,689.05
等于：本金	126,645,212.03
加：应计利息	12,477.02
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	126,657,689.05

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	89,458,176.92	-	81,961,382.74	-7,496,794.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	154,150.69	10,156,150.69	11,359.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	154,150.69	10,156,150.69	11,359.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	2,533,232,989.95	-	2,243,533,757.87	-289,699,232.08
其他	-	-	-	-
合计	2,632,681,807.87	154,150.69	2,335,651,291.30	-297,184,667.26

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。  
 本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 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6月30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	15,619,620.00	-	-	
其中：股指期货投资	15,619,620.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	15,619,620.00	-	-	

#### 6.4.7.3.2 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
IF2409	沪深 300 股指期货 2409	15.00	15,406,200.00	-213,420.00
合计				-213,420.00
减：可抵销期货暂收款				-213,420.00
净额				0.00

#### 6.4.7.3.3 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。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 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。

#### 6.4.7.4.2 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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 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。

6.4.7.6.2 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。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 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。

6.4.7.7.2 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。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	384,859.50
合计	384,859.50

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	409.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	153,219.45
其中：交易所市场	153,219.45



银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	112,383.18
合计	266,012.02

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,586,223,277.75	1,586,223,277.75
本期申购	319,219,319.77	319,219,319.77
本期赎回（以“-”号填列）	-187,333,157.92	-187,333,157.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,718,109,439.60	1,718,109,439.60

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,786,414,827.77	1,786,414,827.77
本期申购	1,516,146,206.24	1,516,146,206.24
本期赎回（以“-”号填列）	-2,106,065,622.65	-2,106,065,622.65
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,196,495,411.36	1,196,495,411.36

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	490,409,352.69	-745,291,839.55	-254,882,486.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	490,409,352.69	-745,291,839.55	-254,882,486.86
本期利润	-50,357,832.21	75,610,275.57	25,252,443.36
本期基金份额交易产生的变动数	38,848,755.21	-61,039,437.05	-22,190,681.84
其中：基金申购款	92,661,862.77	-139,906,187.72	-47,244,324.95
基金赎回款	-53,813,107.56	78,866,750.67	25,053,643.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	478,900,275.69	-730,721,001.03	-251,820,725.34

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	234,123,553.20	-543,534,421.32	-309,410,868.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	234,123,553.20	-543,534,421.32	-309,410,868.12
本期利润	-41,716,473.87	65,353,348.09	23,636,874.22
本期基金份额交易产生的变动数	-72,716,529.22	166,627,509.92	93,910,980.70
其中：基金申购款	173,555,473.88	-420,671,024.93	-247,115,551.05
基金赎回款	-246,272,003.10	587,298,534.85	341,026,531.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	119,690,550.11	-311,553,563.31	-191,863,013.20

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	272,691.97
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	54,343.53
其他	2,098.96
合计	329,134.46

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-241,998.46
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-1,562,252.91

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,804,251.37

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,543,418.27
减：卖出股票成本总额	1,457,427.19
减：交易费用	327,989.54
买卖股票差价收入	-241,998.46

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
申购基金份额总额	603,151,020.00
减：现金支付申购款总额	237,238,104.45
减：申购股票成本总额	367,475,168.46
减：交易费用	-
申购差价收入	-1,562,252.91

#### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	947,267,870.61
减：卖出/赎回基金成本总额	1,085,273,600.03
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	45,825.70
基金投资收益	-138,051,555.12

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 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6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——利息收入	64,869.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	64,869.86

#### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.16.3 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。

#### 6.4.7.16.4 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。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 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。

##### 6.4.7.17.2 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。

##### 6.4.7.17.3 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。

##### 6.4.7.17.4 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。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 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。

##### 6.4.7.18.2 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。

##### 6.4.7.18.3 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。

##### 6.4.7.18.4 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。

### 6.4.7.19 衍生工具收益

#### 6.4.7.19.1 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。

#### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,524,824.23

### 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	923,058.15
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	46,988,728.49
合计	47,911,786.64

### 6.4.7.21 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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	141,177,043.66
股票投资	4,757,873.40
债券投资	11,359.00
资产支持证券投资	-
基金投资	136,407,811.26
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-213,420.00
权证投资	-
期货投资	-213,420.00
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	140,963,623.66

### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	146,191.66
基金转换费收入	1,243.87

合计	147,435.53
----	------------

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。

#### 6.4.7.23 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	52,710.84
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	7,421.02
合计	119,804.20

#### 6.4.7.25 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，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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
华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	420,981,736.27	89.02

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	10,013,138.00	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	3,668,251,437.17	97.41

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	392,062.81	89.10	27,690.13	39.16

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等（截至 2024 年 6 月 30 日）。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	581,906.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,439,491.60	1,569,189.28
应支付基金管理人的净管理费	-857,584.61	-675,707.61

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于目标 ETF 而调减，因此支付基金管理人的净管理费为负。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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产})$$



× 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	116,381.45	178,696.36

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 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：

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 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 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	56,840.34	56,840.34
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	551,385.60	551,385.60
合计	0.00	608,225.94	608,225.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	7.19	7.19
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	2,039,895.47	2,039,895.47
合计	0.00	2,039,902.66	2,039,902.66

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前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 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 6 月 30 日	
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C
基金合同生效日（2012 年 5 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	45,709,920.33	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	45,709,920.33	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.5683%	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C
基金合同生效日（2012 年 5 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,969,309.46	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	4,969,309.46	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1775%	-

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	126,657,689.05	272,691.97	182,444,720.57	450,619.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合证券	118031	天 23 转债	网上配售	80	8,000.00

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有 643,344,065.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 1.06%。（2023 年 12 月 31 日：本基金持有 733,226,365.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 1.96%）。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为目标 ETF 的联接基金，采用主要投资于目标 ETF 基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与沪深 300 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2023 年 12 月 31 日：本基金无债券投资）。

#### 6.4.13.3 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 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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 6 月 30 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30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
<b>资产</b>							
货币资金	126,657,689.05	-	-	-	-	-	126,657,689.05
结算备付金	6,473,016.85	-	-	-	-	-	6,473,016.85
存出保证金	2,146,888.25	-	-	-	-	-	2,146,888.25
交易性金融资产	10,156,150.69	-	-	-	-	-2,325,495,140.61	2,335,651,291.30
应收申购款	-	-	-	-	-	3,203,472.21	3,203,472.21
其他资产	-	-	-	-	-	384,859.50	384,859.50
<b>资产总计</b>	<b>145,433,744.84</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-2,329,083,472.32</b>	<b>2,474,517,217.16</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,007,410.53	3,007,410.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	96,538.11	96,538.11
应付托管费	-	-	-	-	-	19,307.64	19,307.64
应付清算款	-	-	-	-	-	4,165.65	4,165.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-	202,670.79	202,670.79
其他负债	-	-	-	-	-	266,012.02	266,012.02



负债总计	-	-	-	-	-	3,596,104.74	3,596,104.74
利率敏感度缺口	145,433,744.84	-	-	-	-	-2,325,487,367.58	2,470,921,112.42
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	174,930,725.21	-	-	-	-	-	174,930,725.21
结算备付金	7,296,085.43	-	-	-	-	-	7,296,085.43
存出保证金	189,781.98	-	-	-	-	-	189,781.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,649,208,433.88	2,649,208,433.88
应收申购款	-	-	-	-	-	5,815,006.70	5,815,006.70
应收清算款	-	-	-	-	-	209,701,631.48	209,701,631.48
资产总计	182,416,592.62	-	-	-	-	-2,864,725,072.06	3,047,141,664.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	238,067,079.25	238,067,079.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	108,761.51	108,761.51
应付托管费	-	-	-	-	-	21,752.30	21,752.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	366,250.85	366,250.85
其他负债	-	-	-	-	-	233,070.23	233,070.23
负债总计	-	-	-	-	-	238,796,914.14	238,796,914.14
利率敏感度缺口	182,416,592.62	-	-	-	-	-2,625,928,157.92	2,808,344,750.54

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.41%(2023 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于目标 ETF，所面临的其他价格风险

主要来源于沪深 300 指数波动的影响。

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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	81,961,382.74	3.32	82,256,252.65	2.93
交易性金融资产—基金投资	2,243,533,757.87	90.80	2,566,952,181.23	91.40
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	2,325,495,140.61	94.11	2,649,208,433.88	94.33

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	115,921,611.05	131,598,698.01
	沪深 300 指数下降 5%	-115,921,611.05	-131,598,698.01

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	2,325,388,412.82	2,648,769,767.99
第二层次	10,201,761.80	-
第三层次	61,116.68	438,665.89
合计	2,335,651,291.30	2,649,208,433.88

##### 6.4.14.2.2 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2023 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	81,961,382.74	3.31
	其中：股票	81,961,382.74	3.31
2	基金投资	2,243,533,757.87	90.67
3	固定收益投资	10,156,150.69	0.41
	其中：债券	10,156,150.69	0.41
	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	133,130,705.90	5.38
8	其他各项资产	5,735,219.96	0.23
9	合计	2,474,517,217.16	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	833,969.60	0.03
B	采矿业	6,028,691.88	0.24
C	制造业	40,190,900.00	1.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,331,464.00	0.18
E	建筑业	2,291,321.20	0.09
F	批发和零售业	231,390.60	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,171,541.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,355,051.58	0.14
J	金融业	19,438,515.69	0.79
K	房地产业	678,348.00	0.03
L	租赁和商务服务业	609,308.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	635,172.95	0.03
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	165,708.24	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,961,382.74	3.32

### 7.2.2 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。

### 7.3 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	600519	贵州茅台	3,100	4,548,909.00	0.18
2	601318	中国平安	61,959	2,562,624.24	0.10
3	600036	招商银行	69,685	2,382,530.15	0.10
4	300750	宁德时代	10,000	1,800,300.00	0.07
5	600900	长江电力	61,400	1,775,688.00	0.07
6	601899	紫金矿业	93,000	1,634,010.00	0.07
7	601166	兴业银行	81,900	1,443,078.00	0.06
8	000333	美的集团	18,000	1,161,000.00	0.05
9	601328	交通银行	154,600	1,154,862.00	0.05
10	000858	五粮液	8,000	1,024,320.00	0.04
11	600030	中信证券	55,780	1,016,869.40	0.04
12	002594	比亚迪	4,000	1,001,000.00	0.04
13	600309	万华化学	11,956	966,762.16	0.04
14	600887	伊利股份	37,200	961,248.00	0.04
15	600276	恒瑞医药	24,704	950,115.84	0.04
16	601088	中国神华	18,600	825,282.00	0.03
17	601288	农业银行	177,800	775,208.00	0.03
18	601816	京沪高铁	137,000	735,690.00	0.03
19	002475	立讯精密	18,022	708,444.82	0.03
20	601857	中国石油	65,100	671,832.00	0.03
21	600941	中国移动	6,200	666,500.00	0.03
22	600028	中国石化	104,600	661,072.00	0.03
23	600809	山西汾酒	3,100	653,728.00	0.03
24	600436	片仔癀	3,100	642,227.00	0.03
25	601668	中国建筑	118,300	628,173.00	0.03
26	000651	格力电器	16,000	627,520.00	0.03
27	600690	海尔智家	21,700	615,846.00	0.02
28	603501	韦尔股份	6,100	606,157.00	0.02
29	601138	工业富联	21,700	594,580.00	0.02
30	300760	迈瑞医疗	2,000	581,820.00	0.02
31	601985	中国核电	54,400	579,904.00	0.02
32	601919	中远海控	37,200	576,228.00	0.02

33	601225	陕西煤业	21,700	559,209.00	0.02
34	000725	京东方 A	136,000	556,240.00	0.02
35	600000	浦发银行	66,744	549,303.12	0.02
36	601988	中国银行	118,300	546,546.00	0.02
37	600406	国电南瑞	21,820	544,627.20	0.02
38	600016	民生银行	138,100	523,399.00	0.02
39	601601	中国太保	18,600	518,196.00	0.02
40	601728	中国电信	84,100	517,215.00	0.02
41	600050	中国联通	109,000	512,300.00	0.02
42	600150	中国船舶	12,400	504,804.00	0.02
43	601169	北京银行	84,700	494,648.00	0.02
44	601766	中国中车	65,400	491,154.00	0.02
45	300059	东方财富	46,053	486,319.68	0.02
46	603259	药明康德	12,305	482,232.95	0.02
47	601012	隆基绿能	34,100	478,082.00	0.02
48	600837	海通证券	55,800	477,648.00	0.02
49	600031	三一重工	28,900	476,850.00	0.02
50	600660	福耀玻璃	9,300	445,470.00	0.02
51	002714	牧原股份	10,036	437,569.60	0.02
52	688041	海光信息	6,200	435,984.00	0.02
53	002415	海康威视	14,000	432,740.00	0.02
54	688981	中芯国际	9,200	424,120.00	0.02
55	688012	中微公司	3,000	423,780.00	0.02
56	601229	上海银行	57,420	416,869.20	0.02
57	601818	光大银行	129,500	410,515.00	0.02
58	600938	中国海油	12,400	409,200.00	0.02
59	300498	温氏股份	20,000	396,400.00	0.02
60	601888	中国中免	6,200	387,438.00	0.02
61	600089	特变电工	27,870	386,556.90	0.02
62	601390	中国中铁	58,900	384,028.00	0.02
63	600104	上汽集团	27,306	378,461.16	0.02
64	603288	海天味业	10,825	373,137.75	0.02
65	000001	平安银行	36,000	365,400.00	0.01
66	688008	澜起科技	6,200	354,392.00	0.01
67	600905	三峡能源	81,000	353,160.00	0.01
68	600048	保利发展	40,300	353,028.00	0.01
69	000792	盐湖股份	20,000	349,000.00	0.01
70	300274	阳光电源	5,600	347,368.00	0.01
71	601600	中国铝业	45,500	347,165.00	0.01
72	600019	宝钢股份	51,400	341,810.00	0.01
73	688271	联影医疗	3,100	340,070.00	0.01
74	601211	国泰君安	24,775	335,701.25	0.01
75	000063	中兴通讯	12,000	335,640.00	0.01

76	600886	国投电力	18,000	328,320.00	0.01
77	601658	邮储银行	64,500	327,015.00	0.01
78	000338	潍柴动力	20,000	324,800.00	0.01
79	688036	传音控股	4,200	321,468.00	0.01
80	601989	中国重工	65,100	320,943.00	0.01
81	601009	南京银行	30,300	314,817.00	0.01
82	300124	汇川技术	6,050	310,365.00	0.01
83	002142	宁波银行	14,060	310,163.60	0.01
84	600795	国电电力	51,400	307,886.00	0.01
85	600999	招商证券	21,700	301,847.00	0.01
86	603993	洛阳钼业	35,100	298,350.00	0.01
87	600438	通威股份	15,500	296,205.00	0.01
88	600584	长电科技	9,280	294,268.80	0.01
89	600585	海螺水泥	12,400	292,516.00	0.01
90	601939	建设银行	39,200	290,080.00	0.01
91	603986	兆易创新	3,028	289,537.36	0.01
92	000568	泸州老窖	2,000	286,980.00	0.01
93	601628	中国人寿	9,201	285,691.05	0.01
94	002352	顺丰控股	8,000	285,520.00	0.01
95	601669	中国电建	49,600	277,264.00	0.01
96	603019	中科曙光	6,237	258,835.50	0.01
97	002230	科大讯飞	6,000	257,700.00	0.01
98	600547	山东黄金	9,276	253,976.88	0.01
99	600426	华鲁恒升	9,300	247,752.00	0.01
100	600760	中航沈飞	6,144	246,374.40	0.01
101	600926	杭州银行	18,600	242,730.00	0.01
102	000100	TCL 科技	56,010	241,963.20	0.01
103	000625	长安汽车	18,000	241,740.00	0.01
104	600011	华能国际	24,800	238,576.00	0.01
105	600015	华夏银行	37,200	238,080.00	0.01
106	601006	大秦铁路	33,100	236,996.00	0.01
107	601186	中国铁建	27,100	232,247.00	0.01
108	601916	浙商银行	83,700	231,012.00	0.01
109	600674	川投能源	12,300	230,625.00	0.01
110	600958	东方证券	30,316	230,401.60	0.01
111	600489	中金黄金	15,500	229,400.00	0.01
112	600600	青岛啤酒	3,100	225,587.00	0.01
113	600893	航发动力	6,171	225,550.05	0.01
114	600111	北方稀土	13,000	223,600.00	0.01
115	002027	分众传媒	36,000	218,160.00	0.01
116	600989	宝丰能源	12,400	214,892.00	0.01
117	600188	兖矿能源	9,000	204,570.00	0.01
118	603392	万泰生物	3,100	204,228.00	0.01

119	601377	兴业证券	40,300	203,918.00	0.01
120	600009	上海机场	6,200	199,950.00	0.01
121	603799	华友钴业	8,950	198,063.50	0.01
122	601800	中国交建	21,200	189,528.00	0.01
123	601901	方正证券	24,400	188,612.00	0.01
124	002311	海大集团	4,000	188,200.00	0.01
125	600115	中国东航	46,500	186,465.00	0.01
126	601336	新华保险	6,200	186,186.00	0.01
127	600010	包钢股份	131,400	183,960.00	0.01
128	601838	成都银行	12,100	183,799.00	0.01
129	000661	长春高新	2,000	183,540.00	0.01
130	601111	中国国航	24,800	183,024.00	0.01
131	600029	南方航空	31,000	182,590.00	0.01
132	601788	光大证券	12,400	181,288.00	0.01
133	000938	紫光股份	8,024	179,336.40	0.01
134	600745	闻泰科技	6,200	175,150.00	0.01
135	601021	春秋航空	3,100	174,623.00	0.01
136	002920	德赛西威	2,000	174,180.00	0.01
137	600346	恒力石化	12,400	172,980.00	0.01
138	000002	万科 A	24,000	166,320.00	0.01
139	601689	拓普集团	3,100	166,191.00	0.01
140	300015	爱尔眼科	16,057	165,708.24	0.01
141	600570	恒生电子	9,324	164,661.84	0.01
142	002304	洋河股份	2,000	161,480.00	0.01
143	601360	三六零	21,000	161,280.00	0.01
144	300014	亿纬锂能	4,000	159,680.00	0.01
145	601868	中国能建	74,400	157,728.00	0.01
146	000425	徐工机械	22,000	157,300.00	0.01
147	601872	招商轮船	18,600	157,170.00	0.01
148	002241	歌尔股份	8,000	156,080.00	0.01
149	300782	卓胜微	2,000	155,480.00	0.01
150	002050	三花智控	8,098	154,509.84	0.01
151	002179	中航光电	4,060	154,483.00	0.01
152	600023	浙能电力	21,700	154,287.00	0.01
153	600741	华域汽车	9,300	152,334.00	0.01
154	601117	中国化学	18,400	151,616.00	0.01
155	600219	南山铝业	39,500	150,495.00	0.01
156	600372	中航机载	12,500	149,625.00	0.01
157	600362	江西铜业	6,200	146,816.00	0.01
158	300433	蓝思科技	8,000	146,000.00	0.01
159	600039	四川路桥	18,480	145,807.20	0.01
160	600233	圆通速递	9,300	145,545.00	0.01
161	000977	浪潮信息	4,000	145,480.00	0.01



162	603260	合盛硅业	3,100	144,801.00	0.01
163	601100	恒立液压	3,100	144,398.00	0.01
164	000768	中航西飞	6,000	144,180.00	0.01
165	603369	今世缘	3,100	143,220.00	0.01
166	002252	上海莱士	18,000	140,760.00	0.01
167	000157	中联重科	18,000	138,240.00	0.01
168	000166	申万宏源	32,000	137,920.00	0.01
169	600196	复星医药	6,200	137,268.00	0.01
170	600176	中国巨石	12,316	136,091.80	0.01
171	601881	中国银河	12,400	134,664.00	0.01
172	601995	中金公司	4,500	133,245.00	0.01
173	601878	浙商证券	12,400	132,928.00	0.01
174	600183	生益科技	6,200	130,572.00	0.01
175	003816	中国广核	28,000	129,640.00	0.01
176	600803	新奥股份	6,200	128,960.00	0.01
177	688126	沪硅产业	9,300	128,433.00	0.01
178	601618	中国中冶	40,300	124,930.00	0.01
179	600588	用友网络	12,400	124,000.00	0.01
180	002236	大华股份	8,000	123,680.00	0.01
181	000776	广发证券	10,000	121,700.00	0.00
182	002466	天齐锂业	4,000	119,640.00	0.00
183	601066	中信建投	6,200	119,288.00	0.00
184	000786	北新建材	4,000	118,640.00	0.00
185	601607	上海医药	6,200	118,482.00	0.00
186	601877	正泰电器	6,200	118,172.00	0.00
187	600085	同仁堂	3,060	116,922.60	0.00
188	600515	海南机场	37,200	116,808.00	0.00
189	300408	三环集团	4,000	116,760.00	0.00
190	002460	赣锋锂业	4,060	116,319.00	0.00
191	601898	中煤能源	9,300	116,064.00	0.00
192	002001	新和成	6,044	116,044.80	0.00
193	002493	荣盛石化	12,000	115,920.00	0.00
194	600875	东方电气	6,200	114,390.00	0.00
195	000963	华东医药	4,060	112,908.60	0.00
196	601699	潞安环能	6,200	112,406.00	0.00
197	688396	华润微	3,000	112,320.00	0.00
198	002601	龙佰集团	6,000	111,420.00	0.00
199	600460	士兰微	6,300	110,313.00	0.00
200	002049	紫光国微	2,080	109,408.00	0.00
201	002648	卫星化学	6,060	108,958.80	0.00
202	601633	长城汽车	4,200	106,260.00	0.00
203	002180	纳思达	4,000	105,680.00	0.00
204	600018	上港集团	18,100	104,618.00	0.00

205	002129	TCL 中环	12,050	104,232.50	0.00
206	000538	云南白药	2,020	103,323.00	0.00
207	600025	华能水电	9,300	100,254.00	0.00
208	002271	东方雨虹	8,050	99,337.00	0.00
209	300347	泰格医药	2,000	97,200.00	0.00
210	603899	晨光股份	3,100	96,968.00	0.00
211	601238	广汽集团	12,400	95,976.00	0.00
212	601319	中国人保	18,600	95,790.00	0.00
213	000895	双汇发展	4,000	95,080.00	0.00
214	603659	璞泰来	6,605	93,328.65	0.00
215	688599	天合光能	5,470	92,552.40	0.00
216	300496	中科创达	2,000	91,180.00	0.00
217	600332	白云山	3,100	90,923.00	0.00
218	600845	宝信软件	2,834	90,489.62	0.00
219	688223	晶科能源	12,700	90,170.00	0.00
220	600918	中泰证券	15,500	87,885.00	0.00
221	600061	国投资本	15,440	87,236.00	0.00
222	002736	国信证券	10,000	86,900.00	0.00
223	300122	智飞生物	3,000	84,090.00	0.00
224	000733	振华科技	2,000	83,060.00	0.00
225	002938	鹏鼎控股	2,000	79,520.00	0.00
226	002074	国轩高科	4,000	76,600.00	0.00
227	300628	亿联网络	2,040	75,010.80	0.00
228	000876	新希望	8,000	73,120.00	0.00
229	002709	天赐材料	4,000	70,240.00	0.00
230	603806	福斯特	4,652	68,384.40	0.00
231	300142	沃森生物	6,000	68,280.00	0.00
232	002459	晶澳科技	6,052	67,782.40	0.00
233	300450	先导智能	4,000	66,520.00	0.00
234	002007	华兰生物	4,060	64,107.40	0.00
235	000301	东方盛虹	8,000	63,760.00	0.00
236	002812	恩捷股份	2,000	63,300.00	0.00
237	601865	福莱特	3,100	62,310.00	0.00
238	688303	大全能源	3,000	61,170.00	0.00
239	002841	视源股份	2,000	59,060.00	0.00
240	300316	晶盛机电	2,000	57,460.00	0.00
241	300759	康龙化成	3,000	55,740.00	0.00
242	601236	红塔证券	8,620	55,340.40	0.00
243	300999	金龙鱼	2,000	54,700.00	0.00
244	000708	中信特钢	4,000	54,280.00	0.00
245	601808	中海油服	3,100	53,320.00	0.00
246	002555	三七互娱	4,000	52,200.00	0.00
247	600732	爱旭股份	5,600	50,680.00	0.00

248	000408	藏格矿业	2,000	48,140.00	0.00
249	601059	信达证券	3,200	45,472.00	0.00
250	601698	中国卫通	3,100	43,679.00	0.00
251	300413	芒果超媒	2,083	43,534.70	0.00
252	001979	招商蛇口	4,800	42,192.00	0.00
253	002410	广联达	4,040	38,703.20	0.00
254	000800	一汽解放	4,000	31,320.00	0.00
255	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
256	601998	中信银行	3,700	24,790.00	0.00
257	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
258	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
259	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
260	600161	天坛生物	360	8,784.00	0.00
261	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
262	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
263	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
264	600027	华电国际	600	4,164.00	0.00
265	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
266	600415	小商品城	500	3,710.00	0.00
267	600026	中远海能	200	3,122.00	0.00
268	688009	中国通号	500	3,000.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	600519	贵州茅台	31,784,147.00	1.13
2	601318	中国平安	15,086,860.48	0.54
3	600036	招商银行	13,768,125.00	0.49
4	601899	紫金矿业	8,633,001.50	0.31
5	600900	长江电力	8,596,627.00	0.31
6	601166	兴业银行	8,202,077.25	0.29
7	600276	恒瑞医药	6,529,992.80	0.23
8	600030	中信证券	6,331,176.70	0.23
9	601328	交通银行	6,182,669.00	0.22
10	600887	伊利股份	5,833,760.00	0.21
11	600309	万华化学	4,676,574.00	0.17
12	601088	中国神华	4,649,575.99	0.17
13	601288	农业银行	4,560,917.00	0.16
14	600809	山西汾酒	4,438,685.00	0.16
15	600436	片仔癀	4,289,241.00	0.15
16	601816	京沪高铁	4,259,143.00	0.15
17	601012	隆基绿能	4,051,061.00	0.14

18	600028	中国石化	4,026,216.00	0.14
19	600941	中国移动	3,944,833.00	0.14
20	603259	药明康德	3,859,845.93	0.14

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	688692	达梦数据	368,165.00	0.01
2	688691	灿芯股份	119,556.00	0.00
3	601615	明阳智能	87,570.00	0.00
4	688695	中创股份	84,769.20	0.00
5	688530	欧莱新材	75,131.81	0.00
6	688563	航材股份	71,679.05	0.00
7	688561	奇安信	71,160.00	0.00
8	002202	金风科技	68,790.08	0.00
9	603381	永臻股份	63,808.00	0.00
10	600754	锦江酒店	60,814.00	0.00
11	603344	星德胜	58,785.89	0.00
12	601155	新城控股	54,660.00	0.00
13	688548	广钢气体	41,249.12	0.00
14	000069	华侨城 A	33,280.00	0.00
15	688549	中巨芯	29,072.38	0.00
16	600606	绿地控股	25,274.70	0.00
17	000877	天山股份	22,000.00	0.00
18	688702	盛科通信	21,795.30	0.00
19	688627	精智达	14,829.60	0.00
20	688591	泰凌微	14,750.46	0.00

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	363,879,852.34
卖出股票收入（成交）总额	1,543,418.27

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。

#### 7.5 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	10,156,150.69	0.41
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	10,156,150.69	0.41

### 7.6 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	019709	23 国债 16	100,000	10,156,150.69	0.41

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	指数型	交易型开放式 (ETF)	华泰柏瑞基金管理有限公司	2,243,533,757.87	90.80

### 7.11 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.13 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行（601328）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.13.2 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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

#### 7.13.3 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	2,146,888.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,203,472.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	384,859.50
9	合计	5,735,219.96

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 (%)
华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	34,752	49,439.15	974,409,139.49	56.71	743,700,300.11	43.29
华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C	38,266	31,267.85	862,699,399.72	72.10	333,796,011.64	27.90
合计	72,155	40,393.66	1,837,108,539.21	63.03	1,077,496,311.75	36.97

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）。

### 8.2 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	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	1,445,544.16	0.0841
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C	454,856.75	0.0380
	合计	1,900,400.91	0.0652

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	10~50
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	10~50
	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C	10~50
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C
基金合同生效日 (2012 年 5 月 29 日) 基金份额总额	367,019,682.35	-
本报告期期初基金份 额总额	1,586,223,277.75	1,786,414,827.77
本报告期基金总申购 份额	319,219,319.77	1,516,146,206.24
减：本报告期基金总 赎回份额	187,333,157.92	2,106,065,622.65
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,718,109,439.60	1,196,495,411.36

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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，陆楦女士不再担任公司独立董事。  
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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。



10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
中金公司	2	316,006,128.20	86.57	298,906.43	98.39	-
方正证券	2	48,895,925.64	13.40	4,889.38	1.61	-
国信证券	1	124,070.08	0.03	12.42	0.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：本报告期内：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。

公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

### 10.7.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中金公司	9,990,641.00	100.00	-	-	-	-	970,094,731.01	100.00
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

爱建 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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
2	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
3	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
4	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
5	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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

**12.2 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

**12.3 查阅方式**

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日