

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券
投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
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	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 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	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	54

8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
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	76
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	76
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	76
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	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	77
§ 9 基金份额持有人信息	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2 期末上市基金前十名持有人	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	79
§ 10 开放式基金份额变动	79
§ 11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
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	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	82
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
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	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	83
13.1 备查文件目录	83
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 2000
场内简称	中证 2000 (扩位证券简称: 中证 2000ETF)
基金主代码	563300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 6 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,003,674,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 14 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、股票（含存托凭证）的投资策略</p> <p>本基金主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争做到日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素，决定是否采用完全复制法的策略。完全复制法指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；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。若本基金决定修改复制方法，将在更换复制方法前按规定履行适当程序并公告。</p> <p>本基金将根据投资目标，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务</p>
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混

	合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金属于股票型基金中的指数型基金，跟踪中证 2000 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	张姗
	联系电话	021-38601777	400-61-95555
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	400-61-95555
传真		021-38601799	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200135	518040
法定代表人		贾波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	2,787,636.90
本期利润	19,081,946.23
加权平均基金份额本期利润	0.0408
本期加权平均净值利润率	4.09%
本期基金份额净值增长率	0.96%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	8,534,506.47
期末可供分配基金份额利润	0.0085

期末基金资产净值	1, 013, 267, 454. 02
期末基金份额净值	1. 0096
3. 1. 3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	0. 96%

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

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

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

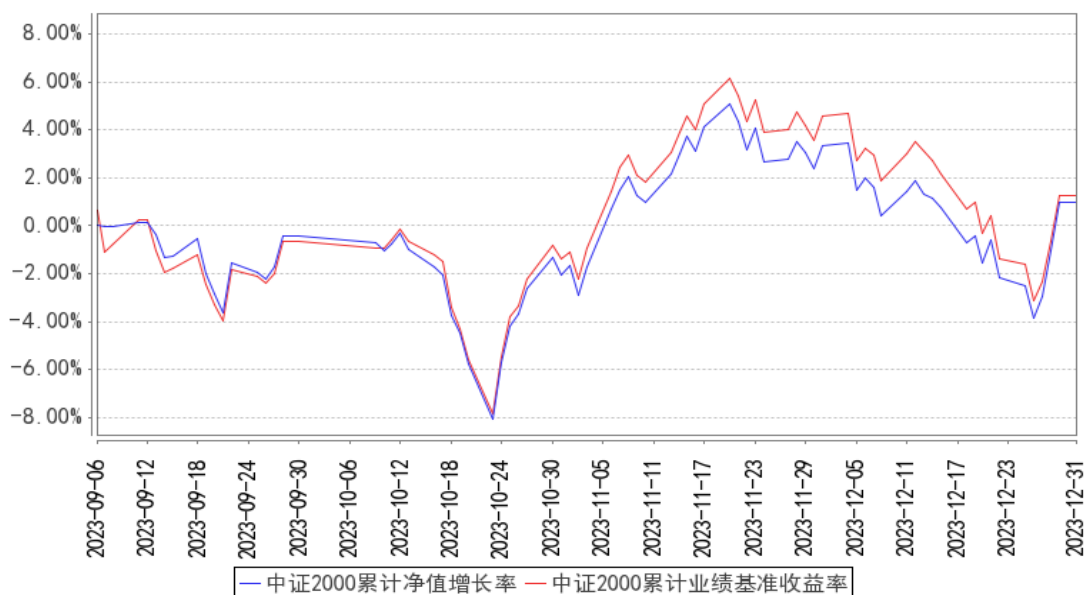
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1. 39%	1. 10%	1. 92%	1. 10%	-0. 53%	0. 00%
自基金合同生效起至今	0. 96%	1. 04%	1. 25%	1. 08%	-0. 29%	-0. 04%

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

中证2000累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

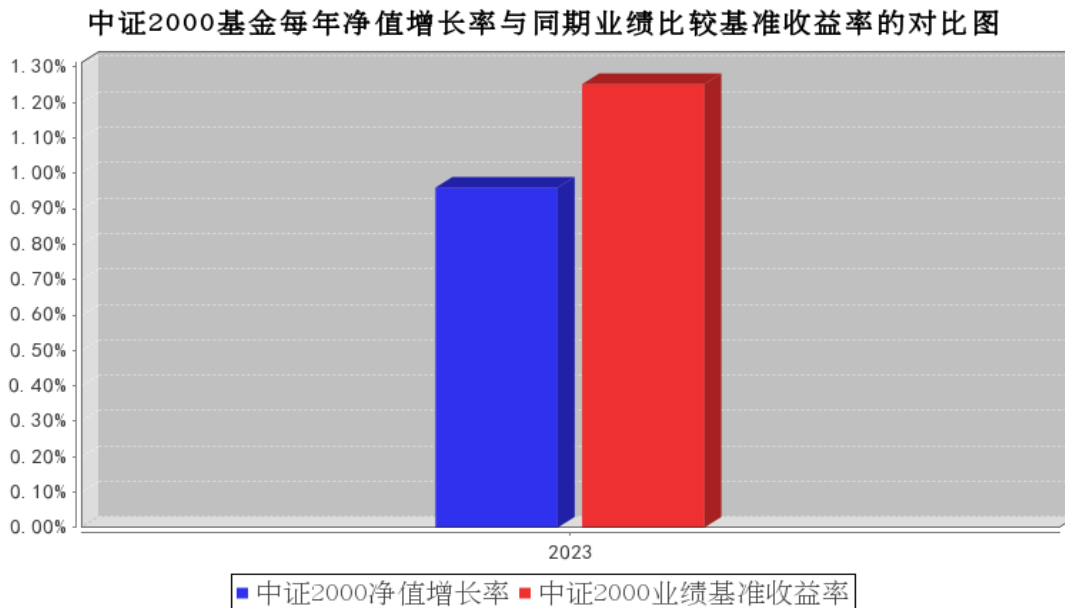


注：1、图示日期为 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

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



注：本基金合同自 2023 年 9 月 6 日起生效，2023 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升

级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏

交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资

基金（QDII）、华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞致远混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞益享债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦合债券型证券投资基金、华泰柏瑞祥泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞科技创新混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2023 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 3801.46 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李沐阳	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 6 日	-	5 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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的基金经理。2023

					<p>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 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。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、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 10 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发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
柳军	<p>总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理</p>	<p>2023 年 9 月 6 日</p>	-	22 年	<p>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</p>

				<p>券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 20 次，其中 4 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 16 次为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

华泰柏瑞中证 2000ETF 于 2023 年 9 月 14 日上市交易。中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本,反映沪深交易所小市值风格股票证券的价格变动趋势。本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素,采取抽样复制法构建基金的股票投资组合,实现基金投资目标。产品成立以来,10 月市场震荡下行,临近月末在汇金持续增持以及其他政策出台的背景下,指数有所反弹。11 月市场反弹,中美关系改善预期升温叠加美债利率回落,市场风险偏好提升,小盘风格偏强。12 月指数继续震荡下行,海外假期叠加人民币短期贬值,量化持仓集中风险值得持续关注。

我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内,本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.088%,期间日跟踪误差为 0.114%,较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0096 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.96%,业绩比较基准收益率为 1.25%。

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 2024 年,资金面上,市场将受到美联储降息周期以及资本市场政策周期双重共振,外资有望重新流入。基本面上,制造业 PMI 转正,经济逐渐复苏。市场风格方面,在有增量资金进入的市场环境下,风险偏好提升,小市值主题性更强,业绩弹性更佳。此外,随着总量政策密集推出的窗口期接近尾声,各部委工作重心大概率已转向产业政策,国家安全、高质量发展是绕不开的主题,对应自主可控、数字经济、高端制造等小盘风格集中的泛科技方向,中证 2000 所代表的小盘风格或将在政策的持续催化下成为优势风格。

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标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年度,本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时,始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法,独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,

同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 8,534,506.47 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22161 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 9 月 6 日(基

	<p>金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险; 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能</p>

	<p>涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证 2000 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	26,804,358.36
结算备付金		1,366,651.69
存出保证金		278,844.84
交易性金融资产	7.4.7.2	998,720,096.10
其中：股票投资		998,448,084.77
基金投资		-

债券投资		272,011.33
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		11,353,723.52
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		1,038,523,674.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		302,267.09
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		210,063.00
应付托管费		42,012.59
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		0.60
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	24,701,877.21
负债合计		25,256,220.49
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	1,003,674,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	9,593,454.02
净资产合计		1,013,267,454.02
负债和净资产总计		1,038,523,674.51

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0096 元，基金份额总额 1,003,674,000.00

份。

2、本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		20,150,559.51
1. 利息收入		57,113.75
其中：存款利息收入	7.4.7.13	57,113.75
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）		4,132,680.57
其中：股票投资收益	7.4.7.14	3,880,924.47
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	104,488.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	147,267.54
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	16,294,309.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-333,544.14
减：二、营业总支出		1,068,613.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	745,838.95
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	149,167.75
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-

7. 税金及附加		0.23
8. 其他费用	7.4.7.23	173,606.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,081,946.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,081,946.23
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		19,081,946.23

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	588,674,000.00	-	-	588,674,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	415,000,000.00	-	9,593,454.02	424,593,454.02
（一）、综合收益总额	-	-	19,081,946.23	19,081,946.23
（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）	415,000,000.00	-	-9,488,492.21	405,511,507.79
其中：1. 基金申购款	917,500,000.00	-	-12,179,917.28	905,320,082.72
2. 基金赎回款	-502,500,000.00	-	2,691,425.07	-499,808,574.93
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1940 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 588,674,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0459 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 588,674,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]210 号核准，本基金 588,674,000.00 份基金份额于 2023 年 9 月 14 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括创业板以及其他经中

国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 2000ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 2000ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023

年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，

并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息,以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配;基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估,基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上,方可对超额收益进行分配;本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%,基金收益分配每年至多 4 次。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	26,804,358.36
等于：本金	26,802,887.20
加：应计利息	1,471.16
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	26,804,358.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	982,189,272.90	-	998,448,084.77	16,258,811.87
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	11.33	272,011.33	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	272,000.00	272,011.33	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	982,461,272.90	11.33	998,720,096.10	16,258,811.87

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	482,000.30
其中：交易所市场	482,000.30
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	120,000.00
应退退补款	24,099,876.91
合计	24,701,877.21

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	588,674,000.00	588,674,000.00
本期申购	917,500,000.00	917,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-502,500,000.00	-502,500,000.00
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	1,003,674,000.00	1,003,674,000.00

注：1. 投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

2. 本基金于 2023 年 9 月 1 日公开发售，共募集有效净认购资金人民币为 588,674,000.00 元，折合为 588,674,000.00 份基金份额。本基金设立募集期内认购资金未产生利息收入。

3. 根据《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 9 月 13 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务和赎回业务自 2023 年 9 月 14 日起开始办理。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,787,636.90	16,294,309.33	19,081,946.23
本期基金份额交易产生的变动数	5,746,869.57	-15,235,361.78	-9,488,492.21
其中：基金申购款	3,889,040.35	-16,068,957.63	-12,179,917.28
金赎回款	1,857,829.22	833,595.85	2,691,425.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,534,506.47	1,058,947.55	9,593,454.02

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	47,393.43
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	8,820.11
其他	900.21
合计	57,113.75

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6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	5,236,378.34

股票投资收益——赎回差价收入	-1,355,453.87
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,880,924.47

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	534,684,649.86
减：卖出股票成本总额	528,009,006.61
减：交易费用	1,439,264.91
买卖股票差价收入	5,236,378.34

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	499,808,574.93
减：现金支付赎回款总额	317,067,172.93
减：赎回股票成本总额	184,096,855.87
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,355,453.87

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6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	58.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	104,429.66
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	104,488.56

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月6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	489,798.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	385,300.00
减：应计利息总额	49.40
减：交易费用	19.58
买卖债券差价收入	104,429.66

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6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	147,267.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	147,267.54

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	16,258,811.87
股票投资	16,258,811.87
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	35,497.46
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	16,294,309.33

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	-386,524.80

其他	52,980.66
合计	-333,544.14

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
注册登记费	50,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00
银行划款手续费	3,206.35
合计	173,606.35

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“中证 2000”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

联接”)	
------	--

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	223,840.10	0.01

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月6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	209.49	0.02	-	-

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。

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 2023年9月6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
其中：应支付销售机构的客户维护费	31,900.41
应支付基金管理人的净管理费	713,938.54

注：自 2023 年 9 月 6 日起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50 % 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50 % / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 6 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	149,167.75

注：自 2023 年 9 月 6 日起，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10 % 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10 % / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	17,418,900.00	1.7355
华泰证券股份有限公司	139,071,000.00	13.8562

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 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
	招商银行	26,804,358.36

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
华泰联合证券	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定期内	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定期内	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定期内	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-

001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定期内	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定期内	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定期内	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定期内	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定期内	2.66	4.45	6,504	17,300.64	28,942.80	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定期内	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定期内	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定期内	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定期内	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-

601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定期内	11.25	11.07	672	7,560.00	7,439.04	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	3,071	5,220.70	12,468.26	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定期内	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定期内	58.08	57.81	96	5,575.68	5,549.76	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定期内	14.23	18.19	275	3,913.25	5,002.25	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定期内	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股锁定期内	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定期内	31.95	52.25	308	9,840.60	16,093.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定期内	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-

688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股锁定期内	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111018	华康转债	2023年12月25日	1个月	配债未上市	100.00	100.00	2,040	204,006.26	204,006.26	-
118046	诺泰转债	2023年12月15日	1个月	配债未上市	100.00	100.01	680	68,005.07	68,005.07	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300096	易联众	2023年12月29日	实施其他风险警示	6.82	2024年1月2日	5.46	106,500	705,618.45	726,330.00	-

		日			日				
--	--	---	--	--	---	--	--	--	--

注：本基金截至 2023 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程

度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2023 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月	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
--------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

31 日							
资产							
货币资金	26,804,358.36	-	-	-	-	-	26,804,358.36
结算备付金	1,366,651.69	-	-	-	-	-	1,366,651.69
存出保证金	278,844.84	-	-	-	-	-	278,844.84
交易性金融资产	-	-	-	-272,011.33	998,448,084.77	-	998,720,096.10
应收清算款	-	-	-	-	11,353,723.52	-	11,353,723.52
资产总计	28,449,854.89	-	-	-272,011.33	1,009,801,808.29	-	1,038,523,674.51
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	302,267.09	-	302,267.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	210,063.00	-	210,063.00
应付托管费	-	-	-	-	42,012.59	-	42,012.59
应交税费	-	-	-	-	0.60	-	0.60
其他负债	-	-	-	-	24,701,877.21	-	24,701,877.21
负债总计	-	-	-	-	25,256,220.49	-	25,256,220.49
利率敏感度缺口	28,449,854.89	-	-	-272,011.33	984,545,587.80	-	1,013,267,454.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 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 0.03%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运

用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	998,448,084.77	98.54
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-302,267.09	-0.03
合计	998,145,817.68	98.51

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 2000 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（2023 年 12 月 31 日）
	中证 2000 指数上升 5%	49,285,648.58
	中证 2000 指数下降 5%	-49,285,648.58

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	997,504,536.45
第二层次	998,341.33
第三层次	217,218.32
合计	998,720,096.10

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>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。</p> <p>对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。</p>

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	139,227.20	139,227.20
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	77,991.12	77,991.12
其中：计入损益的利得或损失	-	77,991.12	77,991.12
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	217,218.32	217,218.32
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期	-	77,991.12	77,991.12

损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	217,218.32	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.5141~2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 905,320,082.72 元，其中包括以股票支付的申购款 318,083,157.95 元和以现金支付的申购款 587,236,924.77 元。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	998,448,084.77	96.14
	其中：股票	998,448,084.77	96.14

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	272,011.33	0.03
	其中：债券	272,011.33	0.03
	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	28,171,010.05	2.71
8	其他各项资产	11,632,568.36	1.12
9	合计	1,038,523,674.51	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,158,538.00	0.61
B	采矿业	9,956,706.00	0.98
C	制造业	667,084,351.36	65.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,134,696.00	2.18
E	建筑业	15,302,781.00	1.51
F	批发和零售业	36,418,570.40	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	18,877,695.00	1.86
H	住宿和餐饮业	1,530,202.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,726,947.69	9.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	23,651,611.00	2.33
L	租赁和商务服务业	21,970,557.00	2.17
M	科学研究和技术服务业	32,145,283.00	3.17
N	水利、环境和公共设施管理业	18,594,396.00	1.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,724,656.00	0.47
Q	卫生和社会工作	1,730,612.00	0.17
R	文化、体育和娱乐	12,753,659.00	1.26

	业		
S	综合	4,469,605.00	0.44
	合计	998,230,866.45	98.52

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	195,542.36	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,439.04	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	11,178.92	0.00
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	217,218.32	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	688049	炬芯科技	158,816	6,046,125.12	0.60
2	300842	帝科股份	80,300	5,665,165.00	0.56
3	003038	鑫铂股份	160,700	5,520,045.00	0.54
4	688621	阳光诺和	79,024	5,511,924.00	0.54
5	688510	航亚科技	307,044	5,410,115.28	0.53
6	605167	利柏特	563,100	5,343,819.00	0.53
7	300815	玉禾田	361,200	5,273,520.00	0.52
8	605116	奥锐特	198,300	5,120,106.00	0.51
9	301051	信濠光电	80,200	5,106,334.00	0.50
10	301101	明月镜片	120,500	5,044,130.00	0.50
11	003000	劲仔食品	400,900	4,898,998.00	0.48
12	688386	泛亚微透	118,973	4,854,098.40	0.48
13	688080	映翰通	119,254	4,839,327.32	0.48
14	603757	大元泵业	198,900	4,821,336.00	0.48
15	688589	力合微	119,182	4,756,553.62	0.47
16	605286	同力日升	158,900	4,744,754.00	0.47
17	300926	博俊科技	160,400	4,704,532.00	0.46
18	301278	快可电子	80,250	4,674,562.50	0.46
19	301391	卡莱特	40,000	4,579,200.00	0.45
20	002912	中新赛克	160,500	4,492,395.00	0.44
21	603727	博迈科	358,100	4,486,993.00	0.44
22	300349	金卡智能	361,000	4,483,620.00	0.44
23	603859	能科科技	118,800	4,482,324.00	0.44
24	603518	锦泓集团	444,900	4,457,898.00	0.44
25	300795	米奥会展	120,500	4,442,835.00	0.44
26	301266	宇邦新材	80,200	4,440,674.00	0.44
27	002588	史丹利	681,900	4,350,522.00	0.43
28	300938	信测标准	120,500	4,324,745.00	0.43
29	002870	香山股份	120,400	4,318,748.00	0.43
30	300729	乐歌股份	240,730	4,311,474.30	0.43
31	002285	世联行	1,728,300	4,165,203.00	0.41
32	301162	国能日新	80,200	4,160,776.00	0.41
33	300779	惠城环保	80,300	4,143,480.00	0.41
34	688302	海创药业	79,250	4,126,547.50	0.41
35	002919	名臣健康	160,400	4,112,656.00	0.41
36	688357	建龙微纳	79,188	4,093,227.72	0.40
37	300444	双杰电气	601,400	4,053,436.00	0.40
38	300592	华凯易佰	160,400	3,973,108.00	0.39
39	688258	卓易信息	79,327	3,926,686.50	0.39
40	000589	贵州轮胎	641,500	3,925,980.00	0.39
41	688365	光云科技	357,693	3,895,276.77	0.38
42	002947	恒铭达	120,320	3,871,897.60	0.38
43	688020	方邦股份	79,450	3,851,736.00	0.38

44	300355	蒙草生态	1,002,700	3,760,125.00	0.37
45	002878	元隆雅图	200,700	3,735,027.00	0.37
46	002983	芯瑞达	120,200	3,709,372.00	0.37
47	601588	北辰实业	1,949,900	3,704,810.00	0.37
48	002452	长高电新	521,400	3,701,940.00	0.37
49	300020	银江技术	441,200	3,661,960.00	0.36
50	301004	嘉益股份	80,200	3,645,090.00	0.36
51	603067	振华股份	357,300	3,640,887.00	0.36
52	600180	瑞茂通	596,100	3,630,249.00	0.36
53	600425	青松建化	913,500	3,608,325.00	0.36
54	300969	恒帅股份	40,000	3,594,800.00	0.35
55	688076	诺泰生物	79,480	3,572,626.00	0.35
56	300990	同飞股份	80,200	3,569,702.00	0.35
57	003028	振邦智能	80,200	3,533,612.00	0.35
58	601500	通用股份	833,600	3,451,104.00	0.34
59	301030	仕净科技	80,200	3,344,340.00	0.33
60	688663	新风光	119,147	3,340,881.88	0.33
61	002971	和远气体	120,200	3,331,944.00	0.33
62	688501	青达环保	198,678	3,323,882.94	0.33
63	002752	昇兴股份	641,400	3,322,452.00	0.33
64	603822	嘉澳环保	118,700	3,301,047.00	0.33
65	301195	北路智控	80,200	3,254,516.00	0.32
66	600576	祥源文旅	437,200	3,252,768.00	0.32
67	000888	峨眉山 A	360,800	3,221,944.00	0.32
68	688136	科兴制药	158,962	3,218,980.50	0.32
69	688121	卓然股份	158,564	3,207,749.72	0.32
70	603076	乐惠国际	119,000	3,189,200.00	0.31
71	688628	优利德	79,114	3,117,091.60	0.31
72	300881	盛德鑫泰	120,200	3,074,716.00	0.30
73	002478	常宝股份	562,700	3,066,715.00	0.30
74	603711	香飘飘	177,500	3,042,350.00	0.30
75	605377	华旺科技	158,600	3,027,674.00	0.30
76	688533	上声电子	79,159	3,017,541.08	0.30
77	688358	祥生医疗	79,327	2,996,974.06	0.30
78	600897	厦门空港	238,700	2,981,363.00	0.29
79	603569	长久物流	238,400	2,953,776.00	0.29
80	688698	伟创电气	79,416	2,885,183.28	0.28
81	300452	山河药辅	200,500	2,855,120.00	0.28
82	002301	齐心集团	401,200	2,852,532.00	0.28
83	002833	弘亚数控	160,200	2,841,948.00	0.28
84	300389	艾比森	160,300	2,779,602.00	0.27
85	300545	联得装备	80,100	2,767,455.00	0.27
86	688687	凯因科技	78,629	2,741,006.94	0.27

87	603366	日出东方	436,400	2,718,772.00	0.27
88	300491	通合科技	120,400	2,682,512.00	0.26
89	002315	焦点科技	80,300	2,660,339.00	0.26
90	002641	公元股份	521,100	2,621,133.00	0.26
91	002630	华西能源	1,043,800	2,588,624.00	0.26
92	301093	华兰股份	80,100	2,587,230.00	0.26
93	300421	力星股份	200,200	2,584,582.00	0.26
94	301257	普蕊斯	40,100	2,546,350.00	0.25
95	603628	清源股份	120,600	2,532,600.00	0.25
96	300731	科创新源	120,300	2,521,488.00	0.25
97	688398	赛特新材	79,340	2,507,144.00	0.25
98	605300	佳禾食品	158,800	2,486,808.00	0.25
99	300559	佳发教育	160,400	2,486,200.00	0.25
100	002803	吉宏股份	120,200	2,471,312.00	0.24
101	300460	惠伦晶体	200,200	2,454,452.00	0.24
102	002970	锐明技术	80,100	2,451,861.00	0.24
103	301185	鸥玛软件	120,200	2,447,272.00	0.24
104	300314	戴维医疗	160,400	2,428,456.00	0.24
105	300840	酷特智能	120,100	2,391,191.00	0.24
106	003029	吉大正元	120,300	2,371,113.00	0.23
107	605266	健之佳	39,726	2,359,724.40	0.23
108	300396	迪瑞医疗	80,100	2,358,945.00	0.23
109	002956	西麦食品	160,300	2,297,099.00	0.23
110	605128	上海沿浦	39,500	2,292,975.00	0.23
111	002154	报喜鸟	400,300	2,273,704.00	0.22
112	300654	世纪天鸿	200,700	2,263,896.00	0.22
113	301181	标榜股份	80,100	2,261,223.00	0.22
114	688418	震有科技	119,112	2,246,452.32	0.22
115	002443	金洲管道	320,500	2,195,425.00	0.22
116	688569	铁科轨道	79,223	2,187,347.03	0.22
117	300105	龙源技术	320,700	2,177,553.00	0.21
118	002829	星网宇达	80,100	2,165,904.00	0.21
119	688292	浩瀚深度	78,280	2,154,265.60	0.21
120	688186	广大特材	119,021	2,144,758.42	0.21
121	300092	科新机电	160,300	2,135,196.00	0.21
122	300181	佐力药业	200,100	2,133,066.00	0.21
123	300857	协创数据	40,100	2,124,899.00	0.21
124	001215	千味央厨	40,000	2,112,400.00	0.21
125	600186	莲花健康	347,400	2,101,770.00	0.21
126	688277	天智航	158,402	2,087,738.36	0.21
127	603722	阿科力	38,500	2,075,150.00	0.20
128	600251	冠农股份	238,200	2,069,958.00	0.20
129	301235	华康医疗	80,200	2,055,526.00	0.20

130	000521	长虹美菱	360,800	2,031,304.00	0.20
131	002083	孚日股份	400,900	2,020,536.00	0.20
132	000655	金岭矿业	281,000	2,014,770.00	0.20
133	300331	苏大维格	80,100	2,000,898.00	0.20
134	301061	匠心家居	40,100	1,994,975.00	0.20
135	300354	东华测试	40,100	1,991,767.00	0.20
136	300532	今天国际	120,200	1,973,684.00	0.19
137	600269	赣粤高速	476,700	1,959,237.00	0.19
138	603383	顶点软件	39,700	1,957,210.00	0.19
139	600794	保税科技	476,900	1,945,752.00	0.19
140	002431	棕榈股份	761,400	1,933,956.00	0.19
141	600351	亚宝药业	277,900	1,917,510.00	0.19
142	688087	英科再生	79,086	1,904,390.88	0.19
143	000531	穗恒运 A	280,400	1,875,876.00	0.19
144	301011	华立科技	79,931	1,870,385.40	0.18
145	603178	圣龙股份	39,700	1,840,095.00	0.18
146	002184	海得控制	120,200	1,839,060.00	0.18
147	002609	捷顺科技	160,300	1,830,626.00	0.18
148	600461	洪城环境	198,600	1,815,204.00	0.18
149	688382	益方生物	118,798	1,798,601.72	0.18
150	002922	伊戈尔	120,000	1,782,000.00	0.18
151	605599	菜百股份	118,800	1,768,932.00	0.17
152	000099	中信海直	200,900	1,767,920.00	0.17
153	300049	福瑞股份	40,100	1,747,959.00	0.17
154	002339	积成电子	240,600	1,746,756.00	0.17
155	002115	三维通信	240,600	1,737,132.00	0.17
156	600054	黄山旅游	158,700	1,726,656.00	0.17
157	300129	泰胜风能	159,900	1,722,123.00	0.17
158	300280	紫天科技	40,200	1,717,746.00	0.17
159	300430	诚益通	120,200	1,717,658.00	0.17
160	605077	华康股份	79,346	1,717,047.44	0.17
161	600133	东湖高新	158,900	1,711,353.00	0.17
162	300378	鼎捷软件	80,100	1,706,931.00	0.17
163	002270	华明装备	120,200	1,697,224.00	0.17
164	002017	东信和平	160,000	1,665,600.00	0.16
165	002394	联发股份	200,000	1,662,000.00	0.16
166	002031	巨轮智能	401,200	1,660,968.00	0.16
167	600961	株冶集团	198,400	1,658,624.00	0.16
168	300246	宝莱特	160,400	1,652,120.00	0.16
169	603811	诚意药业	158,800	1,646,756.00	0.16
170	300360	炬华科技	119,900	1,637,834.00	0.16
171	600630	龙头股份	111,300	1,636,110.00	0.16
172	000554	泰山石油	280,500	1,618,485.00	0.16

173	300719	安达维尔	120,200	1,602,266.00	0.16
174	300041	回天新材	159,900	1,602,198.00	0.16
175	000766	通化金马	80,200	1,599,188.00	0.16
176	603660	苏州科达	180,900	1,590,111.00	0.16
177	300622	博士眼镜	80,000	1,586,400.00	0.16
178	300192	科德教育	160,300	1,582,161.00	0.16
179	002073	软控股份	240,600	1,580,742.00	0.16
180	300576	容大感光	40,000	1,570,400.00	0.15
181	300320	海达股份	200,400	1,559,112.00	0.15
182	002860	星帅尔	120,200	1,556,590.00	0.15
183	600509	天富能源	237,500	1,546,125.00	0.15
184	002732	燕塘乳业	80,100	1,537,920.00	0.15
185	600611	大众交通	515,100	1,534,998.00	0.15
186	002858	力盛体育	80,000	1,520,000.00	0.15
187	000978	桂林旅游	200,000	1,512,000.00	0.15
188	603590	康辰药业	39,600	1,507,968.00	0.15
189	605098	行动教育	39,000	1,503,450.00	0.15
190	603322	超讯通信	39,700	1,497,087.00	0.15
191	300566	激智科技	80,100	1,496,268.00	0.15
192	688697	纽威数控	79,214	1,491,599.62	0.15
193	300718	长盛轴承	80,000	1,484,000.00	0.15
194	603918	金桥信息	79,300	1,482,910.00	0.15
195	688560	明冠新材	79,323	1,476,994.26	0.15
196	300556	丝路视觉	40,000	1,474,000.00	0.15
197	603619	中曼石油	79,400	1,470,488.00	0.15
198	300473	德尔股份	80,200	1,466,056.00	0.14
199	002896	中大力德	40,000	1,454,000.00	0.14
200	002401	中远海科	80,100	1,451,412.00	0.14
201	300161	华中数控	40,000	1,436,000.00	0.14
202	603825	华扬联众	118,700	1,433,896.00	0.14
203	002669	康达新材	120,200	1,432,784.00	0.14
204	600094	大名城	475,000	1,425,000.00	0.14
205	688588	凌志软件	118,798	1,413,696.20	0.14
206	603357	设计总院	158,500	1,410,650.00	0.14
207	300042	朗科科技	40,100	1,403,500.00	0.14
208	600533	栖霞建设	476,900	1,397,317.00	0.14
209	000417	合肥百货	279,900	1,396,701.00	0.14
210	300791	仙乐健康	40,100	1,389,866.00	0.14
211	002681	奋达科技	280,700	1,389,465.00	0.14
211	300081	恒信东方	120,300	1,389,465.00	0.14
212	601199	江南水务	278,000	1,378,880.00	0.14
213	600979	广安爱众	396,900	1,373,274.00	0.14
214	002345	潮宏基	200,600	1,366,086.00	0.13

215	301076	新瀚新材	40,100	1,360,192.00	0.13
216	300700	岱勒新材	80,000	1,357,600.00	0.13
217	300708	聚灿光电	120,000	1,353,600.00	0.13
218	600694	大商股份	79,400	1,341,066.00	0.13
219	002170	芭田股份	240,400	1,334,220.00	0.13
220	002045	国光电器	80,000	1,332,000.00	0.13
221	000815	美利云	120,200	1,329,412.00	0.13
222	300705	九典制药	40,000	1,329,200.00	0.13
223	300005	探路者	200,400	1,326,648.00	0.13
224	002846	英联股份	120,000	1,314,000.00	0.13
225	002279	久其软件	200,500	1,305,255.00	0.13
226	000912	泸天化	280,900	1,303,376.00	0.13
227	002533	金杯电工	160,500	1,296,840.00	0.13
228	002786	银宝山新	80,200	1,288,012.00	0.13
229	002057	中钢天源	159,900	1,285,596.00	0.13
230	300174	元力股份	80,200	1,284,002.00	0.13
231	000861	海印股份	641,700	1,283,400.00	0.13
232	601579	会稽山	119,200	1,280,208.00	0.13
233	300384	三联虹普	80,200	1,279,992.00	0.13
234	603078	江化微	79,400	1,271,988.00	0.13
235	000551	创元科技	120,300	1,259,541.00	0.12
236	002483	润邦股份	240,600	1,255,932.00	0.12
237	600769	祥龙电业	119,200	1,253,984.00	0.12
238	300239	东宝生物	200,600	1,249,738.00	0.12
239	600084	中葡股份	158,800	1,248,168.00	0.12
240	002197	证通电子	119,900	1,245,761.00	0.12
241	002035	华帝股份	200,600	1,245,726.00	0.12
242	002682	龙洲股份	141,100	1,243,091.00	0.12
243	603629	利通电子	39,500	1,242,670.00	0.12
244	600189	泉阳泉	118,800	1,242,648.00	0.12
245	300909	汇创达	39,900	1,240,890.00	0.12
246	300147	香雪制药	240,600	1,239,090.00	0.12
247	600033	福建高速	397,300	1,231,630.00	0.12
248	002104	恒宝股份	160,300	1,231,104.00	0.12
249	000713	丰乐种业	160,500	1,231,035.00	0.12
250	300194	福安药业	280,700	1,229,466.00	0.12
251	601020	华钰矿业	118,800	1,223,640.00	0.12
252	300139	晓程科技	120,200	1,222,434.00	0.12
253	000862	银星能源	200,600	1,221,654.00	0.12
254	001339	智微智能	35,500	1,220,490.00	0.12
255	000592	平潭发展	481,000	1,216,930.00	0.12
256	600238	海南椰岛	119,100	1,211,247.00	0.12
257	300580	贝斯特	40,000	1,211,200.00	0.12

258	002235	安妮股份	160,400	1,211,020.00	0.12
259	000948	南天信息	80,200	1,208,614.00	0.12
260	002367	康力电梯	160,000	1,203,200.00	0.12
261	603665	康隆达	39,500	1,203,170.00	0.12
262	300678	中科信息	40,000	1,199,200.00	0.12
263	002328	新朋股份	200,600	1,197,582.00	0.12
264	600664	哈药股份	357,400	1,197,290.00	0.12
265	300305	裕兴股份	120,426	1,189,808.88	0.12
266	000680	山推股份	240,600	1,188,564.00	0.12
267	600757	长江传媒	158,900	1,183,805.00	0.12
268	300110	华仁药业	280,500	1,183,710.00	0.12
269	603960	克来机电	79,400	1,180,678.00	0.12
270	300173	福能东方	240,400	1,180,364.00	0.12
271	000931	中关村	200,600	1,177,522.00	0.12
272	002397	梦洁股份	284,100	1,176,174.00	0.12
273	603009	北特科技	79,200	1,174,536.00	0.12
274	300293	蓝英装备	79,800	1,173,060.00	0.12
275	300225	金力泰	119,900	1,172,622.00	0.12
276	300631	久吾高科	40,100	1,169,717.00	0.12
277	002510	天汽模	240,600	1,169,316.00	0.12
278	002122	汇洲智能	280,000	1,167,600.00	0.12
279	300809	华辰装备	39,900	1,167,075.00	0.12
280	000777	中核科技	79,800	1,160,292.00	0.11
281	002526	山东矿机	398,700	1,156,230.00	0.11
282	300213	佳讯飞鸿	160,500	1,155,600.00	0.11
283	300248	新开普	120,300	1,153,677.00	0.11
284	601038	一拖股份	79,000	1,151,030.00	0.11
285	600130	波导股份	238,200	1,145,742.00	0.11
286	300228	富瑞特装	160,400	1,138,840.00	0.11
287	600255	鑫科材料	514,200	1,136,382.00	0.11
288	600212	绿能慧充	157,900	1,133,722.00	0.11
289	600830	香溢融通	158,700	1,131,531.00	0.11
290	000421	南京公用	160,500	1,121,895.00	0.11
291	605016	百龙创园	39,500	1,121,405.00	0.11
292	600620	天宸股份	119,100	1,119,540.00	0.11
293	300008	天海防务	280,600	1,116,788.00	0.11
294	600868	梅雁吉祥	437,700	1,116,135.00	0.11
295	300252	金信诺	120,300	1,110,369.00	0.11
296	002536	飞龙股份	79,800	1,110,018.00	0.11
297	300533	冰川网络	40,000	1,108,000.00	0.11
298	000610	西安旅游	80,200	1,107,562.00	0.11
299	600846	同济科技	118,800	1,104,840.00	0.11
300	000900	现代投资	281,300	1,102,696.00	0.11

301	300471	厚普股份	79,800	1,100,442.00	0.11
302	605133	嵘泰股份	39,700	1,098,499.00	0.11
303	600605	汇通能源	39,400	1,094,138.00	0.11
304	002375	亚厦股份	240,600	1,089,918.00	0.11
305	002632	道明光学	110,300	1,089,764.00	0.11
306	000670	盈方微	160,500	1,088,190.00	0.11
307	300302	同有科技	80,200	1,085,908.00	0.11
308	300853	申昊科技	39,900	1,085,280.00	0.11
309	300507	苏奥传感	160,400	1,084,304.00	0.11
310	300745	欣锐科技	39,900	1,084,083.00	0.11
311	600353	旭光电子	118,400	1,082,176.00	0.11
312	301046	能辉科技	39,900	1,082,088.00	0.11
313	603626	科森科技	118,400	1,076,256.00	0.11
314	000957	中通客车	119,600	1,074,008.00	0.11
315	002785	万里石	39,900	1,073,709.00	0.11
316	600035	楚天高速	281,000	1,073,420.00	0.11
317	600410	华胜天成	158,800	1,067,136.00	0.11
318	002062	宏润建设	240,800	1,066,744.00	0.11
319	002703	浙江世宝	79,800	1,066,128.00	0.11
320	000859	国风新材	200,700	1,065,717.00	0.11
321	002225	濮耐股份	281,000	1,062,180.00	0.10
322	002540	亚太科技	160,500	1,060,905.00	0.10
323	600106	重庆路桥	158,700	1,060,116.00	0.10
324	600860	京城股份	79,000	1,057,810.00	0.10
325	300189	神农科技	320,700	1,055,103.00	0.10
326	002255	海陆重工	199,400	1,054,826.00	0.10
327	300047	天源迪科	120,200	1,051,750.00	0.10
328	600665	天地源	278,200	1,051,596.00	0.10
329	301018	申菱环境	39,900	1,050,966.00	0.10
330	002514	宝馨科技	119,600	1,050,088.00	0.10
331	002579	中京电子	119,600	1,048,892.00	0.10
332	002491	通鼎互联	199,400	1,044,856.00	0.10
333	002471	中超控股	358,800	1,040,520.00	0.10
334	601388	怡球资源	397,100	1,040,402.00	0.10
335	000949	新乡化纤	319,000	1,030,370.00	0.10
336	002819	东方中科	40,200	1,029,522.00	0.10
337	600653	申华控股	556,400	1,029,340.00	0.10
338	603199	九华旅游	39,500	1,025,025.00	0.10
339	002362	汉王科技	39,900	1,022,238.00	0.10
340	002165	红宝丽	240,800	1,018,584.00	0.10
341	002406	远东传动	159,500	1,017,610.00	0.10
342	002331	皖通科技	120,200	1,014,488.00	0.10
343	002449	国星光电	106,900	1,012,343.00	0.10

344	000812	陕西金叶	199,400	1,008,964.00	0.10
344	002480	新筑股份	199,400	1,008,964.00	0.10
345	688609	九联科技	76,363	1,007,991.60	0.10
346	300632	光莆股份	79,800	1,007,076.00	0.10
347	300066	三川智慧	199,400	1,006,970.00	0.10
348	300125	聆达股份	79,800	1,006,278.00	0.10
349	002014	永新股份	120,400	1,005,340.00	0.10
350	600101	明星电力	119,200	1,002,472.00	0.10
351	002306	中科云网	171,400	999,262.00	0.10
352	600301	华锡有色	79,200	996,336.00	0.10
353	002519	银河电子	160,400	989,668.00	0.10
354	000852	石化机械	160,400	986,460.00	0.10
355	600512	腾达建设	397,400	985,552.00	0.10
356	300540	蜀道装备	39,900	983,535.00	0.10
357	002650	加加食品	240,800	982,464.00	0.10
358	600300	维维股份	315,800	982,138.00	0.10
359	002133	广宇集团	281,000	980,690.00	0.10
360	000911	广农糖业	120,200	979,630.00	0.10
361	002551	尚荣医疗	240,800	977,648.00	0.10
362	002553	南方精工	79,800	973,560.00	0.10
363	000816	智慧农业	320,800	968,816.00	0.10
364	002033	丽江股份	119,600	967,564.00	0.10
365	600375	汉马科技	158,800	960,740.00	0.09
366	000716	黑芝麻	159,500	960,190.00	0.09
367	600609	金杯汽车	197,400	959,364.00	0.09
368	000509	华塑控股	239,200	959,192.00	0.09
369	300510	金冠股份	160,400	957,588.00	0.09
370	000532	华金资本	79,800	956,802.00	0.09
371	600684	珠江股份	275,700	956,679.00	0.09
372	002655	共达电声	70,600	955,218.00	0.09
373	000070	特发信息	120,300	955,182.00	0.09
374	000797	中国武夷	319,000	953,810.00	0.09
375	002297	博云新材	119,600	953,212.00	0.09
376	601595	上海电影	36,900	953,127.00	0.09
377	002084	海鸥住工	239,200	952,016.00	0.09
378	002479	富春环保	199,400	951,138.00	0.09
379	603222	济民医疗	118,400	948,384.00	0.09
380	001212	中旗新材	39,900	948,024.00	0.09
381	000863	三湘印象	240,000	948,000.00	0.09
382	300341	麦克奥迪	79,800	941,640.00	0.09
383	003015	日久光电	80,000	940,800.00	0.09
384	000404	长虹华意	159,500	939,455.00	0.09
385	600368	五洲交通	237,700	938,915.00	0.09

386	603012	创力集团	157,900	933,189.00	0.09
387	300193	佳士科技	119,600	929,292.00	0.09
388	600159	大龙地产	238,000	928,200.00	0.09
389	300691	联合光电	39,900	925,281.00	0.09
390	002628	成都路桥	279,100	921,030.00	0.09
391	001219	青岛食品	39,900	919,695.00	0.09
392	600237	铜峰电子	118,400	916,416.00	0.09
393	002590	万安科技	80,300	913,011.00	0.09
394	000751	锌业股份	280,600	911,950.00	0.09
395	002995	天地在线	39,900	907,725.00	0.09
396	300536	农尚环境	40,100	906,260.00	0.09
397	002575	群兴玩具	160,400	904,656.00	0.09
398	000510	新金路	159,500	904,365.00	0.09
399	000151	中成股份	79,800	904,134.00	0.09
400	002548	金新农	160,400	903,052.00	0.09
401	600686	金龙汽车	119,200	902,344.00	0.09
402	000055	方大集团	199,400	901,288.00	0.09
403	002529	海源复材	71,000	900,280.00	0.09
404	002093	国脉科技	119,600	899,392.00	0.09
405	002374	中锐股份	240,400	899,096.00	0.09
406	603011	合锻智能	119,100	895,632.00	0.09
407	603878	武进不锈	118,400	893,920.00	0.09
408	300335	迪森股份	159,500	893,200.00	0.09
409	002523	天桥起重	320,800	891,824.00	0.09
410	002725	跃岭股份	79,600	889,928.00	0.09
411	002455	百川股份	119,600	887,432.00	0.09
412	000593	德龙汇能	119,600	885,040.00	0.09
413	300375	鹏翎股份	160,000	884,800.00	0.09
414	002731	萃华珠宝	79,800	882,588.00	0.09
415	600513	联环药业	79,200	882,288.00	0.09
416	300426	唐德影视	79,800	880,194.00	0.09
417	000014	沙河股份	79,800	878,598.00	0.09
418	000721	西安饮食	80,200	876,586.00	0.09
419	000906	浙商中拓	119,600	874,276.00	0.09
420	002360	同德化工	119,600	873,080.00	0.09
421	600293	三峡新材	238,700	868,868.00	0.09
422	002560	通达股份	120,300	868,566.00	0.09
423	300120	经纬辉开	119,600	868,296.00	0.09
424	600408	安泰集团	357,200	867,996.00	0.09
425	300520	科大国创	39,900	867,426.00	0.09
426	002666	德联集团	160,400	866,160.00	0.09
427	300468	四方精创	79,800	865,830.00	0.09
428	002852	道道全	79,800	863,436.00	0.09

429	000836	富通信息	320,700	859,476.00	0.08
430	600651	飞乐音响	238,200	857,520.00	0.08
431	300247	融捷健康	240,600	856,536.00	0.08
432	002445	中南文化	360,900	855,333.00	0.08
433	600479	千金药业	79,400	855,138.00	0.08
434	002561	徐家汇	79,800	853,860.00	0.08
435	688176	亚虹医药	79,083	852,514.74	0.08
436	002687	乔治白	159,500	850,135.00	0.08
437	600495	晋西车轴	198,500	849,580.00	0.08
438	600853	龙建股份	197,400	842,898.00	0.08
439	600858	银座股份	157,900	840,028.00	0.08
440	000753	漳州发展	199,400	837,480.00	0.08
441	002112	三变科技	79,800	836,304.00	0.08
442	600187	国中水务	315,800	833,712.00	0.08
443	000544	中原环保	119,600	830,024.00	0.08
444	600278	东方创业	118,400	826,432.00	0.08
445	600162	香江控股	473,600	824,064.00	0.08
446	603333	尚纬股份	143,500	819,385.00	0.08
447	000505	京粮控股	119,600	818,064.00	0.08
448	603227	雪峰科技	118,400	816,960.00	0.08
449	300304	云意电气	120,200	816,158.00	0.08
450	002565	顺灏股份	240,600	815,634.00	0.08
451	603686	福龙马	79,400	812,262.00	0.08
452	002686	亿利达	119,600	809,692.00	0.08
453	600071	凤凰光学	35,300	808,723.00	0.08
454	300365	恒华科技	119,600	808,496.00	0.08
455	002869	金溢科技	39,900	807,576.00	0.08
455	300489	光智科技	39,900	807,576.00	0.08
456	600619	海立股份	118,400	806,304.00	0.08
457	002395	双象股份	39,900	803,586.00	0.08
458	000788	北大医药	119,600	802,516.00	0.08
459	600379	宝光股份	79,800	801,990.00	0.08
460	600960	渤海汽车	198,000	801,900.00	0.08
461	300538	同益股份	39,900	797,601.00	0.08
462	002546	新联电子	159,500	797,500.00	0.08
463	300465	高伟达	79,800	797,202.00	0.08
464	002090	金智科技	79,800	796,404.00	0.08
465	002448	中原内配	119,600	794,144.00	0.08
466	002611	东方精工	160,000	793,600.00	0.08
467	000920	沃顿科技	79,800	792,414.00	0.08
468	300534	陇神戎发	80,000	789,600.00	0.08
469	300581	晨曦航空	80,200	788,366.00	0.08
470	688221	前沿生物	79,180	785,465.60	0.08

471	300479	神思电子	39,900	785,232.00	0.08
472	002622	皓宸医疗	240,100	785,127.00	0.08
473	300537	广信材料	39,900	782,838.00	0.08
474	002175	东方智造	280,700	780,346.00	0.08
475	300279	和晶科技	120,200	777,694.00	0.08
476	000159	国际实业	119,600	776,204.00	0.08
477	002930	宏川智慧	39,900	773,661.00	0.08
478	603015	弘讯科技	79,200	772,992.00	0.08
479	000659	珠海中富	320,700	772,887.00	0.08
480	300307	慈星股份	120,300	772,326.00	0.08
481	002524	光正眼科	119,600	771,420.00	0.08
482	600744	华银电力	236,800	767,232.00	0.08
483	002208	合肥城建	119,600	766,636.00	0.08
484	300278	华昌达	200,500	765,910.00	0.08
485	002082	万邦德	119,600	765,440.00	0.08
486	000010	美丽生态	240,600	765,108.00	0.08
487	300612	宣亚国际	39,900	764,085.00	0.08
488	300164	通源石油	159,500	760,815.00	0.08
489	002676	顺威股份	160,000	758,400.00	0.07
490	002441	众业达	79,800	755,706.00	0.07
491	603611	诺力股份	39,500	747,735.00	0.07
492	603869	新智认知	79,000	745,760.00	0.07
493	600616	金枫酒业	119,100	745,566.00	0.07
494	603035	常熟汽饰	39,500	745,365.00	0.07
495	002420	毅昌科技	119,400	745,056.00	0.07
496	300099	尤洛卡	120,300	744,657.00	0.07
496	300503	昊志机电	40,100	744,657.00	0.07
497	002849	威星智能	39,900	744,534.00	0.07
498	600545	卓郎智能	276,300	743,247.00	0.07
499	603421	鼎信通讯	79,000	742,600.00	0.07
500	000576	甘化科工	79,800	742,140.00	0.07
501	301215	中汽股份	120,000	740,400.00	0.07
502	600310	广西能源	197,100	737,154.00	0.07
503	000838	财信发展	200,500	735,835.00	0.07
504	600257	大湖股份	118,400	730,528.00	0.07
505	002469	三维化学	120,200	728,412.00	0.07
506	600784	鲁银投资	118,400	728,160.00	0.07
507	605066	天正电气	79,200	727,056.00	0.07
508	300096	易联众	106,500	726,330.00	0.07
509	603808	歌力思	79,200	726,264.00	0.07
510	300645	正元智慧	39,900	725,781.00	0.07
511	000819	岳阳兴长	40,100	725,008.00	0.07
512	300221	银禧科技	120,300	721,800.00	0.07

513	300572	安车检测	39,900	720,993.00	0.07
514	000635	英力特	80,000	717,600.00	0.07
515	603388	元成股份	79,200	715,968.00	0.07
516	600354	敦煌种业	119,100	714,600.00	0.07
517	002845	同兴达	40,100	711,775.00	0.07
518	002150	通润装备	40,100	711,374.00	0.07
519	603969	银龙股份	118,400	710,400.00	0.07
520	002377	国创高新	280,500	709,665.00	0.07
521	603050	科林电气	39,400	707,230.00	0.07
522	300560	中富通	39,900	706,629.00	0.07
523	300061	旗天科技	120,300	704,958.00	0.07
524	300410	正业科技	80,100	704,079.00	0.07
525	002334	英威腾	80,000	698,400.00	0.07
526	300551	古鳌科技	40,100	697,740.00	0.07
527	001896	豫能控股	159,500	697,015.00	0.07
528	600249	两面针	119,300	696,712.00	0.07
529	002288	超华科技	159,500	695,420.00	0.07
530	300467	迅游科技	39,900	693,462.00	0.07
531	603319	湘油泵	39,500	692,830.00	0.07
532	002298	中电兴发	120,200	692,352.00	0.07
533	002342	巨力索具	160,400	691,324.00	0.07
534	000570	苏常柴A	120,000	691,200.00	0.07
535	002659	凯文教育	159,500	690,635.00	0.07
536	000612	焦作万方	120,000	690,000.00	0.07
537	002642	荣联科技	80,200	688,116.00	0.07
538	002037	保利联合	79,800	687,078.00	0.07
539	300518	新讯达	40,100	684,908.00	0.07
540	600190	锦州港	236,800	681,984.00	0.07
541	002300	太阳电缆	80,200	681,700.00	0.07
542	002337	赛象科技	120,000	681,600.00	0.07
543	300052	中青宝	40,100	680,497.00	0.07
544	002380	科远智慧	39,900	679,497.00	0.07
545	600624	复旦复华	119,000	679,490.00	0.07
546	002712	思美传媒	119,600	679,328.00	0.07
547	300493	润欣科技	79,800	679,098.00	0.07
548	600215	派斯林	79,300	677,222.00	0.07
549	600730	中国高科	119,000	672,350.00	0.07
550	300547	川环科技	39,900	672,315.00	0.07
551	002827	高争民爆	40,000	670,000.00	0.07
552	600698	湖南天雁	119,100	669,342.00	0.07
553	000926	福星股份	160,500	669,285.00	0.07
554	002792	通宇通讯	39,900	668,724.00	0.07
554	300585	奥联电子	39,900	668,724.00	0.07

555	300740	水羊股份	39,900	665,133.00	0.07
556	300137	先河环保	119,600	664,976.00	0.07
557	002708	光洋股份	80,200	664,056.00	0.07
558	002264	新华都	120,300	662,853.00	0.07
559	300975	商络电子	80,000	661,600.00	0.07
560	000782	美达股份	120,200	659,898.00	0.07
561	603429	集友股份	79,200	658,944.00	0.07
562	300019	硅宝科技	39,900	658,749.00	0.07
563	000037	深南电 A	80,000	657,600.00	0.06
564	601789	宁波建工	158,700	657,018.00	0.06
565	002246	北化股份	80,200	656,838.00	0.06
566	300288	朗玛信息	39,900	656,355.00	0.06
567	002248	华东数控	80,200	653,630.00	0.06
568	000428	华天酒店	160,200	653,616.00	0.06
569	002363	隆基机械	80,000	653,600.00	0.06
570	300400	劲拓股份	40,100	653,229.00	0.06
571	002766	索菱股份	119,600	651,820.00	0.06
572	600200	江苏吴中	79,200	651,024.00	0.06
573	600113	浙江东日	79,000	649,380.00	0.06
574	603135	中重科技	39,500	646,220.00	0.06
575	600558	大西洋	158,700	645,909.00	0.06
576	002210	飞马国际	360,500	645,295.00	0.06
577	000663	永安林业	79,800	644,784.00	0.06
578	002282	博深股份	79,500	643,950.00	0.06
579	000530	冰山冷热	120,200	641,868.00	0.06
580	600992	贵绳股份	39,700	639,170.00	0.06
581	002495	佳隆股份	199,100	637,120.00	0.06
582	603887	城地香江	79,000	635,160.00	0.06
583	300046	台基股份	39,900	634,809.00	0.06
584	002149	西部材料	40,100	630,372.00	0.06
585	002772	众兴菌业	79,800	629,622.00	0.06
586	002757	南兴股份	39,900	624,036.00	0.06
587	600838	上海九百	79,200	623,304.00	0.06
588	603701	德宏股份	39,700	622,893.00	0.06
589	603508	思维列控	39,500	620,150.00	0.06
590	603639	海利尔	39,400	618,580.00	0.06
591	600721	百花医药	79,400	614,556.00	0.06
592	300541	先进数通	39,900	614,061.00	0.06
593	600629	华建集团	118,400	610,944.00	0.06
594	000955	欣龙控股	120,100	610,108.00	0.06
595	300317	珈伟新能	119,600	608,764.00	0.06
596	000790	华神科技	120,200	608,212.00	0.06
597	603767	中马传动	39,500	607,905.00	0.06

598	000717	中南股份	239,200	607,568.00	0.06
599	600836	上海易连	158,600	607,438.00	0.06
600	600503	华丽家族	237,900	606,645.00	0.06
601	300565	科信技术	40,100	606,312.00	0.06
602	603106	恒银科技	69,800	605,864.00	0.06
603	603630	拉芳家化	39,500	604,350.00	0.06
604	601798	蓝科高新	79,400	604,234.00	0.06
605	600613	神奇制药	79,200	602,712.00	0.06
606	002733	雄韬股份	39,900	600,096.00	0.06
607	002795	永和智控	80,200	599,094.00	0.06
608	603330	天洋新材	79,000	598,820.00	0.06
609	600280	中央商场	158,400	598,752.00	0.06
610	603318	水发燃气	79,400	597,882.00	0.06
611	600526	菲达环保	120,200	593,788.00	0.06
612	002613	北玻股份	120,300	590,673.00	0.06
613	600178	东安动力	39,700	588,751.00	0.06
614	300140	节能环境	79,800	588,126.00	0.06
615	300469	信息发展	39,900	587,328.00	0.06
616	001222	源飞宠物	39,900	586,530.00	0.06
617	000715	中兴商业	80,200	586,262.00	0.06
618	600785	新华百货	39,500	584,600.00	0.06
619	600020	中原高速	158,400	582,912.00	0.06
620	603778	乾景园林	104,700	582,132.00	0.06
621	600540	新赛股份	119,000	580,720.00	0.06
622	000407	胜利股份	160,000	579,200.00	0.06
623	300650	太龙股份	40,100	577,841.00	0.06
624	000757	浩物股份	120,300	577,440.00	0.06
625	300501	海顺新材	39,900	575,757.00	0.06
626	300466	赛摩智能	80,100	575,118.00	0.06
627	002552	宝鼎科技	39,900	570,171.00	0.06
628	002634	棒杰股份	79,200	567,072.00	0.06
629	600683	京投发展	118,400	565,952.00	0.06
630	002213	大为股份	40,100	564,207.00	0.06
631	002253	川大智胜	39,400	563,420.00	0.06
632	600228	返利科技	71,600	558,480.00	0.06
633	002451	摩恩电气	80,000	558,400.00	0.06
634	300328	宜安科技	80,200	558,192.00	0.06
635	300082	奥克股份	80,000	557,600.00	0.06
636	300997	欢乐家	39,900	557,403.00	0.06
637	300589	江龙船艇	39,900	553,812.00	0.05
638	603843	正平股份	158,400	552,816.00	0.05
639	300441	鲍斯股份	80,200	552,578.00	0.05
640	600814	杭州解百	78,800	548,448.00	0.05

641	002272	川润股份	80,000	547,200.00	0.05
642	300872	天阳科技	39,900	545,832.00	0.05
643	603999	读者传媒	79,200	544,104.00	0.05
644	600501	航天晨光	39,700	543,096.00	0.05
645	300730	科创信息	39,900	542,640.00	0.05
646	002638	勤上股份	200,000	542,000.00	0.05
647	002119	康强电子	40,100	536,137.00	0.05
648	600165	新日恒力	158,500	535,730.00	0.05
649	002689	远大智能	120,000	534,000.00	0.05
650	300165	天瑞仪器	80,000	533,600.00	0.05
651	600230	沧州大化	39,500	532,065.00	0.05
652	603777	来伊份	39,400	528,748.00	0.05
653	300424	航新科技	40,100	525,310.00	0.05
653	300542	新晨科技	40,100	525,310.00	0.05
654	000534	万泽股份	40,100	524,909.00	0.05
655	300884	狄耐克	39,900	521,892.00	0.05
656	002329	皇氏集团	80,100	519,048.00	0.05
657	300258	精锻科技	40,100	518,092.00	0.05
658	688373	盟科药业	79,195	517,143.35	0.05
659	300291	百纳千成	80,000	515,200.00	0.05
660	603990	麦迪科技	39,500	510,340.00	0.05
661	002953	日丰股份	39,900	506,730.00	0.05
662	002388	新亚制程	80,100	503,829.00	0.05
663	000514	渝开发	120,400	502,068.00	0.05
664	300062	中能电气	80,000	498,400.00	0.05
665	002654	万润科技	40,000	496,800.00	0.05
666	300053	航宇微	39,900	487,977.00	0.05
666	300374	中铁装配	39,900	487,977.00	0.05
667	300340	科恒股份	39,900	486,780.00	0.05
668	600222	太龙药业	79,200	485,496.00	0.05
669	300968	格林精密	39,900	481,992.00	0.05
670	002593	日上集团	120,000	481,200.00	0.05
671	300582	英飞特	39,900	479,199.00	0.05
672	002438	江苏神通	40,100	479,195.00	0.05
673	600818	中路股份	39,700	476,003.00	0.05
674	603165	荣晟环保	39,500	473,210.00	0.05
675	002361	神剑股份	120,300	472,779.00	0.05
676	300561	汇金科技	39,900	470,820.00	0.05
677	300086	康芝药业	80,000	469,600.00	0.05
678	300439	美康生物	40,100	465,561.00	0.05
678	300490	华自科技	40,100	465,561.00	0.05
679	603339	四方科技	38,900	462,521.00	0.05
680	300515	三德科技	39,900	460,446.00	0.05

681	002667	威领股份	40,100	451,927.00	0.04
682	002346	柘中股份	39,900	444,885.00	0.04
683	600081	东风科技	39,500	443,585.00	0.04
684	603028	赛福天	39,700	442,655.00	0.04
685	300434	金石亚药	39,900	441,294.00	0.04
686	002905	金逸影视	39,900	437,304.00	0.04
687	300543	朗科智能	39,900	435,708.00	0.04
688	601116	三江购物	39,500	428,970.00	0.04
689	300100	双林股份	39,900	416,157.00	0.04
690	603977	国泰集团	39,700	412,880.00	0.04
691	600753	东方银星	39,500	411,590.00	0.04
692	002723	小崧股份	39,900	408,177.00	0.04
693	603336	宏辉果蔬	79,200	404,712.00	0.04
694	000882	华联股份	240,100	403,368.00	0.04
695	300603	立昂技术	39,900	401,793.00	0.04
696	600822	上海物贸	39,500	400,135.00	0.04
697	000518	四环生物	120,000	398,400.00	0.04
698	603017	中衡设计	39,500	395,395.00	0.04
699	002589	瑞康医药	120,000	392,400.00	0.04
700	603158	腾龙股份	39,600	385,704.00	0.04
701	300414	中光防雷	39,900	384,237.00	0.04
702	300025	华星创业	40,000	383,600.00	0.04
703	002730	电光科技	39,900	378,252.00	0.04
704	603779	威龙股份	34,200	374,832.00	0.04
705	002547	春兴精工	80,100	374,067.00	0.04
706	600792	云煤能源	79,200	369,072.00	0.04
707	600213	亚星客车	39,500	364,980.00	0.04
708	603528	多伦科技	39,700	360,476.00	0.04
709	300404	博济医药	39,900	357,105.00	0.04
710	300310	宜通世纪	80,100	354,042.00	0.03
711	002822	中装建设	80,000	350,400.00	0.03
712	000793	华闻集团	159,600	347,928.00	0.03
713	002769	普路通	39,900	342,342.00	0.03
714	000698	沈阳化工	80,000	337,600.00	0.03
715	002277	友阿股份	79,800	321,594.00	0.03
716	002103	广博股份	35,400	283,554.00	0.03
717	600661	昂立教育	25,800	276,060.00	0.03
718	002169	智光电气	39,900	274,512.00	0.03
719	300057	万顺新材	39,900	246,183.00	0.02
720	002148	北纬科技	39,900	240,996.00	0.02
721	002419	天虹股份	39,900	220,647.00	0.02
722	600622	光大嘉宝	79,200	204,336.00	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301526	国际复材	6,504	28,942.80	0.00
2	688652	京仪装备	308	16,093.00	0.00
3	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
4	601096	宏盛华源	3,071	12,468.26	0.00
5	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
6	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
7	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
8	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
9	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
10	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
11	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
12	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
13	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
14	601083	锦江航运	672	7,439.04	0.00
15	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
16	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
17	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
18	603062	麦加芯彩	96	5,549.76	0.00
19	603107	上海汽配	275	5,002.25	0.00
20	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
21	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
22	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
23	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
24	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
25	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
26	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	003038	鑫铂股份	9,284,230.00	0.92
2	301101	明月镜片	8,198,222.50	0.81
3	300795	米奥会展	8,108,429.00	0.80
4	003000	劲仔食品	7,956,855.00	0.79
5	300815	玉禾田	7,863,928.84	0.78
6	300926	博俊科技	7,711,934.80	0.76
7	002919	名臣健康	7,624,408.20	0.75

8	301004	嘉益股份	7,553,133.00	0.75
9	300729	乐歌股份	7,411,158.80	0.73
10	002947	恒铭达	7,231,824.60	0.71
11	301051	信濠光电	6,997,230.50	0.69
12	301030	仕净科技	6,926,827.00	0.68
13	300938	信测标准	6,926,550.47	0.68
14	300731	科创新源	6,816,498.60	0.67
15	301278	快可电子	6,292,400.80	0.62
16	301266	宇邦新材	6,083,838.06	0.60
17	002956	西麦食品	6,045,232.60	0.60
18	301257	普蕊斯	5,964,018.00	0.59
19	300842	帝科股份	5,501,988.00	0.54
20	300881	盛德鑫泰	5,491,225.70	0.54

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002947	恒铭达	4,793,639.17	0.47
2	300731	科创新源	4,403,202.00	0.43
3	301198	喜悦智行	4,365,208.92	0.43
4	301389	隆扬电子	4,134,260.00	0.41
5	003011	海象新材	4,067,383.00	0.40
6	301004	嘉益股份	3,938,028.00	0.39
7	300926	博俊科技	3,862,413.00	0.38
8	300700	岱勒新材	3,822,612.24	0.38
9	003038	鑫铂股份	3,786,858.00	0.37
10	301257	普蕊斯	3,756,678.00	0.37
11	002956	西麦食品	3,713,656.60	0.37
12	301101	明月镜片	3,528,063.50	0.35
13	300795	米奥会展	3,525,020.50	0.35
14	300729	乐歌股份	3,462,765.31	0.34
15	003000	劲仔食品	3,457,113.00	0.34
16	301030	仕净科技	3,256,135.00	0.32
17	603516	淳中科技	3,032,610.00	0.30
18	002919	名臣健康	3,011,395.00	0.30
19	688566	吉贝尔	2,988,286.16	0.29
20	003029	吉大正元	2,849,548.00	0.28

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,376,211,977.43
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	534,684,649.86
--------------	----------------

注：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	-	-
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）	272,011.33	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	272,011.33	0.03

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	111018	华康转债	2,040	204,006.26	0.02
2	118046	诺泰转债	680	68,005.07	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	278,844.84
2	应收清算款	11,353,723.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,632,568.36

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301526	国际复材	28,942.80	0.00	新股锁定期内
2	688652	京仪装备	16,093.00	0.00	新股锁定期内
3	301566	达利凯普	12,752.64	0.00	新股锁定期内
4	601096	宏盛华源	12,468.26	0.00	新股锁定期内
5	301508	中机认检	11,178.92	0.00	新股锁定期内

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
2,560	392,060.1 6	880,702,288.0 0	87.7 5	105,552,812.0 0	10.5 2	17,418,900.0 0	1.74

注：由于四舍五入的原因，占总份额比例可能存在尾差。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	华泰证券股份有限公司	139,071,000.00	13.86
2	上海迎水投资管理有 限公司—迎水巡洋 11 号私募证券投资基金	66,967,200.00	6.67
3	中国银河证券股份有 限公司	60,587,500.00	6.04
4	方正证券股份有限公 司	53,527,900.00	5.33
5	国泰君安证券股份有 限公司	51,174,900.00	5.10
6	深圳市恒泰融安投资 管理有限公司—恒泰 融安创弘 14 号私募证 券投资基金	42,160,000.00	4.20
7	招商证券股份有限公 司	38,621,888.00	3.85
8	华鑫证券有限责任公 司	29,800,000.00	2.97
9	首誉光控资管—招商 银行—首誉光控—乐 瑞宏观对冲 1 号集合资 产管理计划	27,808,500.00	2.77
10	中信证券股份有限公 司	23,000,000.00	2.29

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 6 日）基金份额总额	588,674,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	917,500,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	502,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,003,674,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

2023 年 4 月 18 日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 11 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	私募资产管理业务与投资顾问业务未能有效分离
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	966,013,889.54	50.59	162,230.37	15.46	-
招商证券	2	351,719,019.78	18.42	331,955.64	31.63	-
银河证券	2	270,018,250.04	14.14	252,718.00	24.08	-
广发证券	2	187,714,922.06	9.83	175,683.11	16.74	-
中信建投	2	130,039,313.08	6.81	123,003.00	11.72	-
方正证券	4	3,773,973.78	0.20	3,545.47	0.34	-
华泰证券	5	223,840.10	0.01	209.49	0.02	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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、上述交易单元均系本报告期内租用。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	21,802.42	4.45	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	276,424.51	56.44	-	-	-	-
华泰证券	191,571.71	39.11	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证	-	-	-	-	-	-

券						
上海证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 26 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 23 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与贵州省贵文文化基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 16 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 13 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 01 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 08 日
7	关于同意东方证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 27 日
8	关于同意海通证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 26 日
9	关于同意申万宏源证券有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 25 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 20 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止尚智逢源(北京)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 19 日
12	关于同意方正证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 15 日
13	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 14 日
14	关于同意招商证券股份有限公司为华	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 14 日

	泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告		
15	关于同意华泰证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 14 日
16	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 14 日
17	关于同意广发证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 14 日
18	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 11 日
19	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 11 日
20	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层
 托管人住所

13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日