

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 3,498,674,000.00 份  |
| 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。</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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 | <p>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。</p> <p>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。</p>  |
| 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  |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2024年7月1日-2024年9月30日) |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -89,317,512.31            |
| 2. 本期利润         | 288,086,521.37            |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2055                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 3,281,370,837.42          |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9379                    |

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。

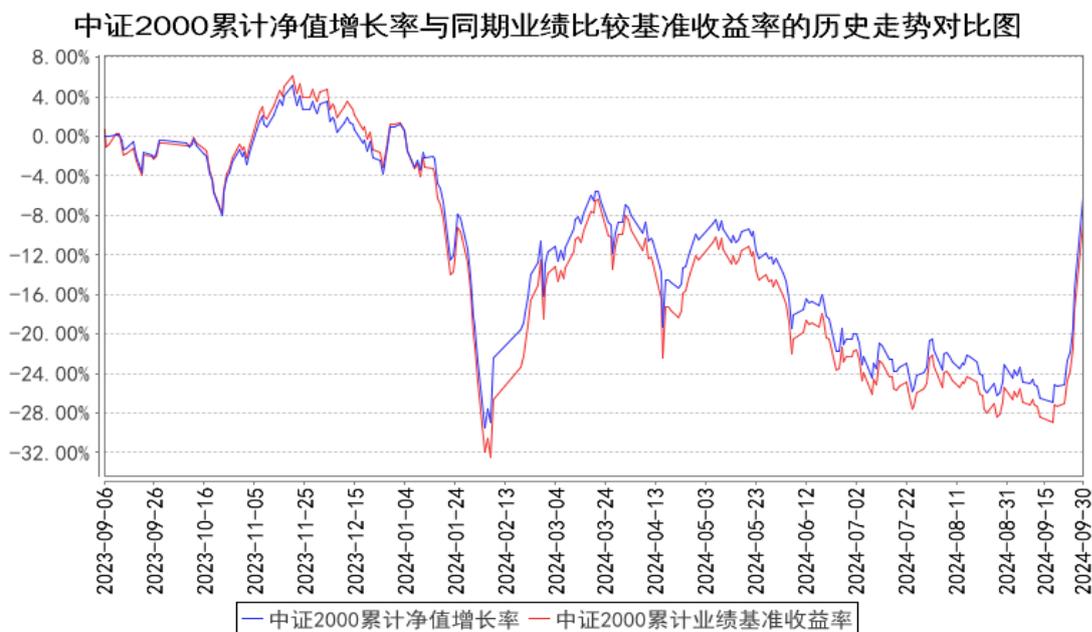
#### 3.2 基金净值表现

##### 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    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 18.06%     | 2.11%         | 17.67%         | 2.11%                 | 0.39% | 0.00%  |
| 过去六个月 | 2.67%      | 1.99%         | 1.49%          | 2.07%                 | 1.18% | -0.08% |
| 过去一年  | -5.81%     | 2.03%         | -7.99%         | 2.13%                 | 2.18% | -0.10% |

|                |        |       |        |       |       |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | -6.21% | 1.97% | -8.59% | 2.07% | 2.38% | -0.10% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1、图示日期为 2023 年 9 月 6 日至 2024 年 9 月 30 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。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                 | 任本基金的基金经理期限    |      | 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 | -    | 6 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 |

|    |                               |                       |   |   |
|----|-------------------------------|-----------------------|---|---|
|    |                               |                       |   | <p>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 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。2024 年 1 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发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 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> | - | <p>23 年</p> <p>副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易</p>   |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

#### 4.1.1 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

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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《证券投资基金管理人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 2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年上半年，中证 2000 指数在前期盘整后大幅反弹。三季度经济增速放缓，尤其是出口和消费疲软，对中小企业产生了一定的负面影响。中证 2000 指数中的成份股以中小市值公司为主，这些企业相较于大型蓝筹企业，受宏观经济波动和政策变化的影响更为显著。

全球经济放缓的背景下，市场避险情绪上升，资金更多流入低风险资产，而中小市值企业的

股价承压较大，导致中证 2000ETF 在季度初期经历了一定的调整。不过，随着季度末推出了一系列经济刺激政策，中证 2000ETF 在季度末出现强劲反弹。

展望 2024 年第四季度，中小市值企业有望继续受到政策的扶持。随着政府进一步加大对民营经济和中小企业的支持力度，特别是在创新技术应用等方面的政策倾斜，中证 2000ETF 所覆盖的中小企业有望在未来几个季度中逐步恢复盈利能力。

同时，随着科技创新、消费升级和医药产业等领域的发展，中证 2000 指数成份股中涉及的创新型企业和新兴行业的表现可能继续成为推动 ETF 价格上涨的动力。尽管外部经济环境仍具挑战，但长期来看，中证 2000ETF 凭借其广泛覆盖的中小市值公司，有望从政策利好和经济复苏中受益。我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.070%，期间日跟踪误差为 0.087%，较好地实现了本基金的投资目标。

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。

#### 4.5 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 0.9379 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.06%，业绩比较基准收益率为 17.67%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 3,200,922,897.56 | 96.81        |
|    | 其中：股票             | 3,200,922,897.56 | 96.81        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -                | -            |
|    | 其中：债券             | -                | -            |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |

|   |              |                  |        |
|---|--------------|------------------|--------|
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 43,940,592.87    | 1.33   |
| 8 | 其他资产         | 61,421,363.82    | 1.86   |
| 9 | 合计           | 3,306,284,854.25 | 100.00 |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | 15,174,017.00    | 0.46         |
| B  | 采矿业              | 34,935,702.70    | 1.06         |
| C  | 制造业              | 2,132,295,318.51 | 64.98        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 60,343,054.81    | 1.84         |
| E  | 建筑业              | 57,164,846.56    | 1.74         |
| F  | 批发和零售业           | 142,258,803.62   | 4.34         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 76,958,678.00    | 2.35         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 6,616,173.00     | 0.20         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 326,201,335.05   | 9.94         |
| J  | 金融业              | -                | -            |
| K  | 房地产业             | 79,164,691.78    | 2.41         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 64,772,178.00    | 1.97         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 83,499,515.21    | 2.54         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 62,510,052.54    | 1.90         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | 19,799,926.00    | 0.60         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,796,532.00     | 0.09         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 29,650,960.00    | 0.90         |
| S  | 综合               | 6,354,443.00     | 0.19         |
|    | 合计               | 3,200,496,227.78 | 97.54        |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.2.2 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              | 216,244.48 | 0.01         |
| 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      | -          | -            |

|   |                 |            |      |
|---|-----------------|------------|------|
| H | 住宿和餐饮业          | -          | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 200,883.62 | 0.01 |
| J | 金融业             | -          | -    |
| K | 房地产业            | -          | -    |
| L | 租赁和商务服务业        | -          | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | 9,541.68   | 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              | 426,669.78 | 0.01 |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.2.3 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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  | 002588 | 史丹利  | 2,633,200 | 20,802,280.00 | 0.63         |
| 2  | 603067 | 振华股份 | 1,243,100 | 15,538,750.00 | 0.47         |
| 3  | 300349 | 金卡智能 | 1,110,500 | 14,847,385.00 | 0.45         |
| 4  | 688259 | 创耀科技 | 402,850   | 14,832,937.00 | 0.45         |
| 5  | 600897 | 厦门空港 | 966,840   | 14,251,221.60 | 0.43         |
| 6  | 300815 | 玉禾田  | 971,800   | 13,916,176.00 | 0.42         |
| 7  | 000589 | 贵州轮胎 | 2,496,400 | 13,605,380.00 | 0.41         |
| 8  | 000521 | 长虹美菱 | 1,248,100 | 13,604,290.00 | 0.41         |
| 9  | 600611 | 大众交通 | 1,728,200 | 13,531,806.00 | 0.41         |
| 10 | 003000 | 劲仔食品 | 973,800   | 13,438,440.00 | 0.41         |

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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  | 301551 | 无线传媒 | 652   | 82,080.28 | 0.00         |
| 2  | 688615 | 合合信息 | 289   | 56,129.58 | 0.00         |

|   |        |      |       |           |      |
|---|--------|------|-------|-----------|------|
| 3 | 688692 | 达梦数据 | 175   | 51,353.75 | 0.00 |
| 4 | 001279 | 强邦新材 | 2,642 | 25,574.56 | 0.00 |
| 5 | 301611 | 珂玛科技 | 804   | 24,071.76 | 0.00 |

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

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

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。

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,703,083.82  |
| 2  | 应收证券清算款 | 59,680,576.16 |
| 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    | 37,703.84     |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 61,421,363.82 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告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。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 301551 | 无线传媒 | 82,080.28      | 0.00         | 新股锁定期内   |
| 2  | 688615 | 合合信息 | 56,129.58      | 0.00         | 新股锁定期内   |
| 3  | 688692 | 达梦数据 | 51,353.75      | 0.00         | 新股锁定期内   |
| 4  | 001279 | 强邦新材 | 25,574.56      | 0.00         | 新股未上市    |
| 5  | 301611 | 珂玛科技 | 24,071.76      | 0.00         | 新股锁定期内   |

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,263,674,000.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,045,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,810,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 3,498,674,000.00 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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

## 9.2 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

## 9.3 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 10 月 25 日