

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末上市基金前十名持有人	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF
场内简称	300ETF(扩位证券简称：沪深 300ETF)
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	89,386,687,690.00 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	2012 年 5 月 28 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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	贾波	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	10,902,422,916.98	-2,759,793,487.95	-5,553,712,516.70
本期利润	56,434,927,972.29	-12,085,984,781.81	-9,940,263,108.48
加权平均基金份额本期利润	0.8168	-0.5113	-0.7999
本期加权平均净值利润率	22.30%	-13.37%	-19.26%
本期基金份额净值增长率	17.38%	-9.65%	-20.32%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	118,659,647,097.77	30,145,277,033.06	24,418,175,843.72
期末可供分配基金份额利润	1.3275	0.8051	1.2400

期末基金资产净值	359,627,123,543.00	131,086,564,266.62	77,502,503,225.35
期末基金份额净值	4.0233	3.5009	3.9358
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	80.20%	53.52%	69.92%

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、本基金于 2012 年 5 月 11 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值+基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买沪深 300ETF 后的实际份额净值变动情况。

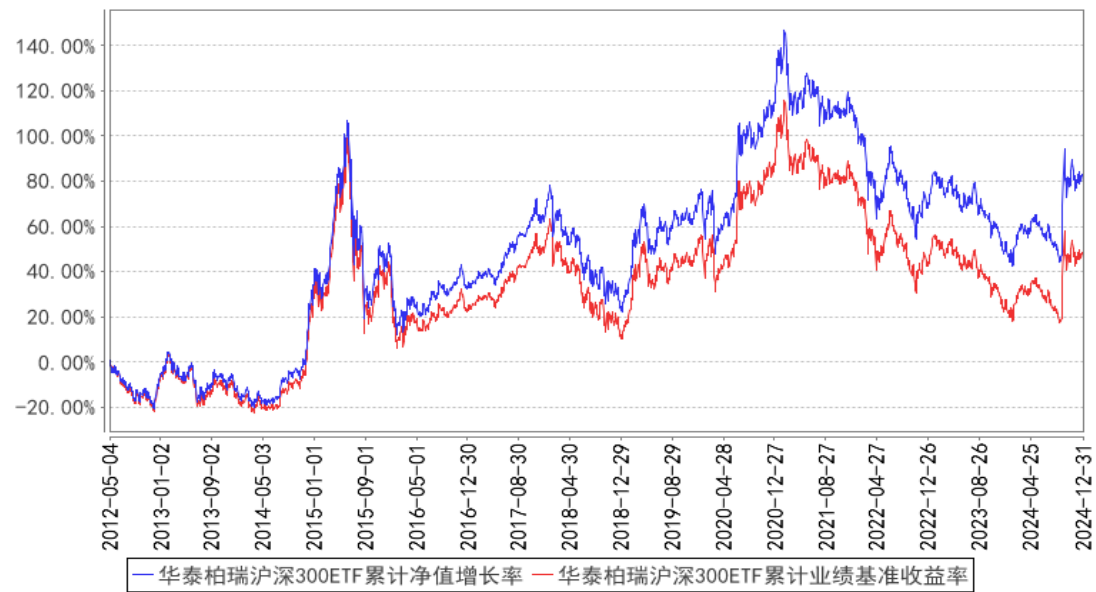
3.2 基金净值表现

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	-1.91%	1.73%	-2.06%	1.74%	0.15%	-0.01%
过去六个月	15.37%	1.65%	13.67%	1.66%	1.70%	-0.01%
过去一年	17.38%	1.34%	14.68%	1.34%	2.70%	0.00%
过去三年	-15.50%	1.17%	-20.35%	1.18%	4.85%	-0.01%
过去五年	4.92%	1.23%	-3.95%	1.23%	8.87%	0.00%
自基金合同生效起至今	80.20%	1.36%	46.20%	1.37%	34.00%	-0.01%

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

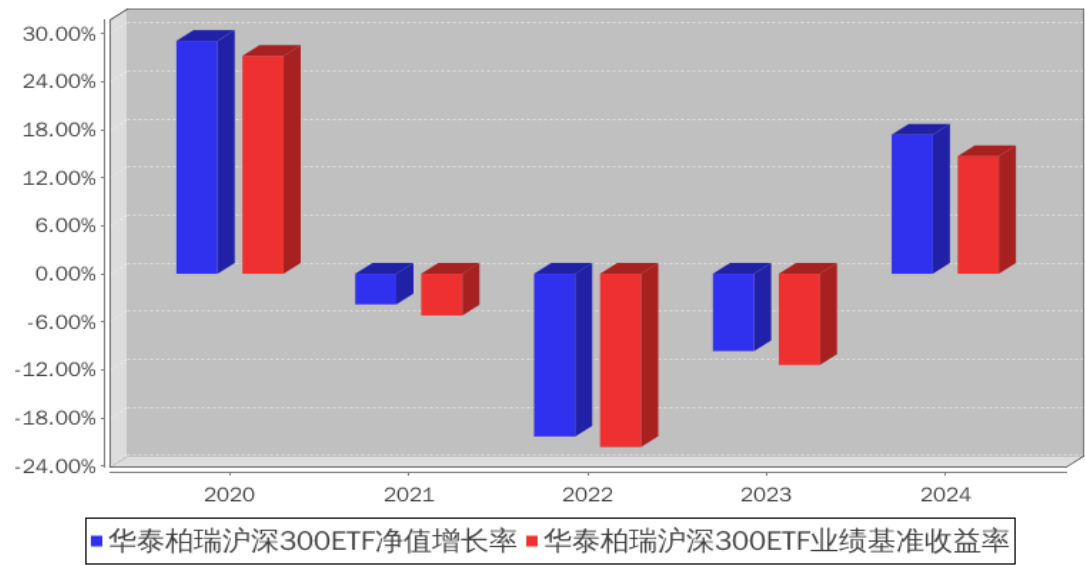
华泰柏瑞沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2012年5月4日至2024年12月31日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞沪深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2024 年	0.6900	2,494,093,851.70	-	2,494,093,851.70	-
2023 年	0.6400	1,193,215,211.55	-	1,193,215,211.55	-
2022 年	0.7500	863,564,082.15	-	863,564,082.15	-

合计	2.0800	4,550,873,145.40	-	4,550,873,145.40	-
----	--------	------------------	---	------------------	---

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2024 年 12 月 31 日，公司旗下管理 165 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	-	6 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2012 年 5 月 4 日	-	23 年	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。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。
--	--	--	--	--	-----------------------------

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 29 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年市场以结构性机会为主，其中银行、非银金融、通信、家用电器的表现相对较好，涨跌幅分别为 34.39%、30.17%、28.82% 和 25.44%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为 14.68%、5.46%、1.20% 和 13.23%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为 24.85% 和 4.24%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

回顾 2024 年全年，内外部因素持续扰动 A 股市场走势。外部地缘局势再度升温、美联储降息落地、美国大选特朗普获胜带来特朗普交易行情震荡；而内部低通胀在上半年有一定困扰，但一系列稳增长政策组合拳在四季度明显加码，给市场带来一针强心剂。在内外部的综合影响下，A 股最终呈现出先抑后扬再震荡的趋势，最终上证指数结束了过去持续低迷的表现，实现 12.7% 的正收益。

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 0.016%，期间日跟踪误差为 0.029%，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 4.0233 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.38%，业绩比较基准收益率为 14.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，政策延续性、需求不足物价承压、外部环境（美联储政策、地缘风险）仍将是影响市场的关键因素。虽然面临扰动，但投资者风险偏好在政府一系列稳增长政策的决心带动下有望整体好于 2024 年，并且随着更多行业自发收缩供给叠加配套政策上的支持，A 股结构性机会仍将持续并进一步增多，宽基指数配置性价比凸现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规法律部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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，方可进行收益分配。本报告期内，本基金符合分红条件，于 2024 年 1 月 18 日进行分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.69 元，利润分配合计 2,494,093,851.70 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

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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	安永华明（2025）审字第 70025451_B18 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	华泰柏瑞沪深 300 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	我们审计了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责	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

任	导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对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沪深 300 交易型开放式指数证券投资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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	施翊洲	张晓阳
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	7.4.7.1	1,996,034,359.45	557,763,846.81
结算备付金		1,987,673,826.64	1,178,798,737.04
存出保证金		464,696,953.95	150,070,827.81
交易性金融资产	7.4.7.2	355,451,566,630.68	129,302,062,860.16
其中：股票投资		355,451,566,630.68	129,302,062,860.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	292,464,049.18
应收股利		-	74,250.20
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	1,054,977.37
资产总计		359,899,971,770.72	131,482,289,548.57
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		253,556.82	2,096,681.51
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		44,908,165.68	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		46,500,026.97	47,802,161.66
应付托管费		15,500,009.01	9,560,432.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,042,749.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.9	155,643,720.23	336,266,006.46
负债合计		272,848,227.72	395,725,281.95
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	240,967,476,445.23	100,941,287,233.56
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	118,659,647,097.77	30,145,277,033.06
净资产合计		359,627,123,543.00	131,086,564,266.62
负债和净资产总计		359,899,971,770.72	131,482,289,548.57

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.0233 元，基金份额总额 89,386,687,690.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		57,874,999,689.46	- 11,516,585,282.45
1. 利息收入		33,767,748.29	68,212,911.68
其中：存款利息收入	7.4.7.13	27,423,099.10	15,639,796.17
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		6,344,649.19	52,573,115.51
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		12,549,683,464.21	-2,293,775,209.01
其中：股票投资收益	7.4.7.14	4,821,999,382.60	-4,014,234,612.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	6,661,422.85
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	440,798,762.65	-158,133,685.88
股利收益	7.4.7.19	7,286,885,318.96	1,871,931,666.11
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	45, 532, 505, 055. 31	-9, 326, 191, 293. 86
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	-240, 956, 578. 35	35, 168, 308. 74
减：二、营业总支出		1, 440, 071, 717. 17	569, 399, 499. 36
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	1, 128, 455, 862. 70	451, 435, 295. 24
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	233, 653, 986. 79	90, 287, 058. 98
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		1, 590, 284. 89	17, 923. 40
8. 其他费用	7. 4. 7. 23	76, 371, 582. 79	27, 659, 221. 74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56, 434, 927, 972. 29	12, 085, 984, 781. 81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56, 434, 927, 972. 29	12, 085, 984, 781. 81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		56, 434, 927, 972. 29	12, 085, 984, 781. 81

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	100, 941, 287, 23 3. 56	-	30, 145, 277, 033 . 06	131, 086, 564, 266 . 62
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	100,941,287,23 3.56	-	30,145,277,033 .06	131,086,564,266 .62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	140,026,189,21 1.67	-	88,514,370,064 .71	228,540,559,276 .38
(一)、综合收益总额	-	-	56,434,927,972 .29	56,434,927,972. 29
(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)	140,026,189,21 1.67	-	34,573,535,944 .12	174,599,725,155 .79
其中：1. 基金申购款	232,940,264,49 1.35	-	73,002,705,269 .74	305,942,969,761 .09
2. 基金赎回款	- 92,914,075,279 .68	-	- 38,429,169,325 .62	- 131,343,244,605 .30
(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)	-	-	- 2,494,093,851. 70	- 2,494,093,851.7 0
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	240,967,476,44 5.23	-	118,659,647,09 7.77	359,627,123,543 .00
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 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	53,084,327,381 .63	-	24,418,175,843 .72	77,502,503,225. 35
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	53,084,327,381.63	-	24,418,175,843.72	77,502,503,225.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	47,856,959,851.93	-	5,727,101,189.34	53,584,061,041.27
(一)、综合收益总额	-	-	-12,085,984,781.81	-12,085,984,781.81
(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)	47,856,959,851.93	-	19,006,301,182.70	66,863,261,034.63
其中：1. 基金申购款	95,075,826,926.93	-	40,283,455,101.23	135,359,282,028.16
2. 基金赎回款	-47,218,867,075.00	-	-21,277,153,918.53	-68,496,020,993.53
(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)	-	-	-1,193,215,211.55	-1,193,215,211.55
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	100,941,287,233.56	-	30,145,277,033.06	131,086,564,266.62

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：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,297,269.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.37094933,并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2012]14 号文审核同意,本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 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《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数沪深 300 指数成份股、备选成份股为主要投资对象;此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证、债券、权证、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。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”)。华泰柏瑞沪深 300ETF 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 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度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。

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对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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。本基金的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；基于本基金的性质和特点，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%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，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和债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。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,996,034,359.45	557,763,846.81
等于：本金	1,995,819,407.98	557,702,844.31
加：应计利息	214,951.47	61,002.50
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	1,996,034,359.45	557,763,846.81

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		323,821,666,267.15	-	355,451,566,630.68	31,629,900,363.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		323,821,666,267.15	-	355,451,566,630.68	31,629,900,363.53

项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		143,220,517,991.29	-	129,302,062,860.16	- 13,918,455,131.13
贵金属投资- 金交所黄金合 约		-	-	-	-
债 券	交易所 市场	-	-	-	-
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		143,220,517,991.29	-	129,302,062,860.16	- 13,918,455,131.13

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,664,210,380.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,664,210,380.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,664,210,380.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,172,765,460.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,172,765,460.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,172,765,460.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2501	沪深 300 股指期货 2501	700.00	827,148,000.00	-6,964,560.00
IF2503	沪深 300 股指期货 2503	2,400.00	2,835,360,000.00	5,262,180.00
合计				-1,702,380.00
减：可抵销期货暂收款				-1,702,380.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	1,054,977.37
待摊费用	-	-
合计	-	1,054,977.37

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	7,865,809.81	9,096,721.25
其中：交易所市场	7,865,809.81	9,096,721.25
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	270,000.00	416,575.28
应付指数使用费	28,618,999.04	8,884,926.97

应退退补款	118,388,911.38	317,367,782.96
合计	155,643,720.23	336,266,006.46

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,444,087,690.00	100,941,287,233.56
本期申购	86,409,000,000.00	232,940,264,491.35
本期赎回（以“-”号填列）	-34,466,400,000.00	-92,914,075,279.68
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	89,386,687,690.00	240,967,476,445.23

注：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。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118,407,469,939.70	-88,262,192,906.64	30,145,277,033.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	118,407,469,939.70	-88,262,192,906.64	30,145,277,033.06
本期利润	10,902,422,916.98	45,532,505,055.31	56,434,927,972.29
本期基金份额交易产生的变动数	158,239,803,584.10	-123,666,267,639.98	34,573,535,944.12
其中：基金申购款	265,082,443,263.47	-192,079,737,993.73	73,002,705,269.74
基金赎回款	-106,842,639,679.37	68,413,470,353.75	-38,429,169,325.62
本期已分配利润	-2,494,093,851.70	-	-2,494,093,851.70
本期末	285,055,602,589.08	166,395,955,491.31	118,659,647,097.77

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31	2023 年 1 月 1 日至 2023

	日	年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,004,001.74	1,321,822.26
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	22,211,467.47	14,200,460.86
其他	207,629.89	117,513.05
合计	27,423,099.10	15,639,796.17

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	271,935,569.90	-3,153,134,378.88
股票投资收益——赎回 差价收入	4,550,063,812.70	-861,100,233.21
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	4,821,999,382.60	-4,014,234,612.09

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	73,159,695,221.05	37,430,048,216.20
减：卖出股票成本 总额	72,808,833,495.03	40,524,296,393.72
减：交易费用	78,926,156.12	58,886,201.36
买卖股票差价收入	271,935,569.90	-3,153,134,378.88

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间
----	-----------------------------	---------

		2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	131,343,244,605.30	68,496,020,993.53
减：现金支付赎回款总额	49,306,716,582.30	28,767,495,349.53
减：赎回股票成本总额	77,486,464,210.30	40,589,625,877.21
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	4,550,063,812.70	-861,100,233.21

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——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：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	-	6,410.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	6,655,012.65
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	-	6,661,422.85

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1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	-	43,282,046.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	36,618,700.00
减：应计利息总额	-	6,602.40
减：交易费用	-	1,731.77
买卖债券差价收入	-	6,655,012.65

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——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：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	440,798,762.65	-158,133,685.88

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	7,286,885,318.96	1,871,931,666.11
其中：证券出借权益 补偿收入	1,278,610.33	26,323,002.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,286,885,318.96	1,871,931,666.11

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	45,548,355,494.66	-9,356,757,093.21
股票投资	45,548,355,494.66	-9,356,757,093.21
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	-15,667,920.00	30,383,280.00
权证投资	-	-
期货投资	-15,667,920.00	30,383,280.00
3. 其他	-182,519.35	182,519.35
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	45,532,505,055.31	-9,326,191,293.86

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-241,031,355.92	35,026,858.17
其他	74,777.57	141,450.57
合计	-240,956,578.35	35,168,308.74

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：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	150,000.00	170,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	76,068,306.61	27,086,117.73
注册登记费	23,424.72	276,575.28
银行划款手续费	9,851.46	6,528.73
合计	76,371,582.79	27,659,221.74

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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（“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	34,371,718,688.83	16.16	22,319,506,206.01	22.07

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日
-------	-----------------------------

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
华泰证券	8,639,039.19	30.09	1,565,287.83	19.90
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1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	8,176,593.04	38.48	7,449,305.49	81.89

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

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,128,455,862.70	451,435,295.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	1,128,455,862.70	451,435,295.24

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2024 年 11 月 21 日，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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金调低管理费率 and 托管费率并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2024 年 11 月 22 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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	233,653,986.79	90,287,058.98

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2024 年 11 月 21 日，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金调低管理费率 and 托管费率并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2024 年 11 月 22 日起，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	6,740,715,504.00	5,745,076.90	-	-

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均 费率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收 利息余额
华泰证券	2,530,754,791.60	1.00~5.33	2.95	3,098,536.45	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均 费率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收 利息余额
华泰证券	11,835,404,780.00	1.00~5.33	3.09	14,149,838.40	605,327,214.00	475,236.89

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 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 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
华泰柏瑞沪 深300交易型 开放式指数 证券投资基 金联接基金	555,222,765.00	0.6211	733,226,365.00	1.9582
华泰证券股 份有限公司	42,039,469.00	0.0470	279,125,506.00	0.7454

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,996,034,359.45	5,004,001.74	557,763,846.81	1,321,822.26

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期

2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	3,056.00	66,406.88
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	10,448.00	163,929.12
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	1,296.00	37,609.92
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	2,978.00	77,428.00
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189.00	26,705.80
华泰联合证券	301606	绿联科技	网下申购	3,959.00	83,970.39
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	3,056.00	68,332.16
华泰联合证券	688726	拉普拉斯	网下申购	9,785.00	172,020.30
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	7,433.00	83,918.57
上年度可比期间					
2023 年 1 月 1 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	118031	天 23 转债	网上配售	147,310	14,731,000.00
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688602	康鹏科技	网下申购	10,653	92,254.98
华泰联合证券	301487	盟固利	网下申购	8,662	46,081.84
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	301421	波长光电	网下申购	3,315	97,394.70
华泰联合证券	688693	锆威特	网下申购	1,773	72,391.59
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	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 605,054,561.00 股中国工商银行的普通股，成本总额为人民币 3,324,369,055.23 元，估值总额为人民币 4,186,977,562.12 元，占基金净资产的比例为 1.16%(2023 年 12 月 31 日，本基金持有 261,897,957.00 股中国工商银行的普通股，成本总额为

人民币 1,220,373,461.42 元，估值总额为人民币 1,251,872,234.46 元，占基金净资产的比例为 0.96%)。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 88,313,906.00 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 1,273,746,740.28 元，估值总额为人民币 1,553,441,606.54 元，占基金净资产的比例为 0.43%(2023 年 12 月 31 日，本基金持有 38,047,705.00 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 567,491,812.16 元，估值总额为人民币 530,765,484.75 元，占基金净资产的比例为 0.40%)。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发放 总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 01 月 17 日	2024 年 1 月 18 日	-	0.6900	2,494,093,851.70	-	2,494,093,851.70	-
合计	-	-	-	0.6900	2,494,093,851.70	-	2,494,093,851.70	-

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股 锁定 期内	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股 锁定 期内	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股 锁定 期内	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-

301551	无线传媒	2024年9月19日	6个月	新股锁定期内	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新股锁定期内	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024年10月10日	6个月	新股锁定期内	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新股锁定期内	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股锁定期内	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新股锁定期内	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股锁定期内	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股锁定期内	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024年8月28日	6个月	新股锁定期内	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	新股锁定期内	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股锁定期内	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-

301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股 锁定 期内	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股 锁定 期内	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股 锁定 期内	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股 锁定 期内	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股 锁定 期内	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月 内 (含)	新股 未上 市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月 以上	新股 锁定 期内	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫股份	2024年9月10日	6个月	新股 锁定 期内	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力股份	2024年12月17日	6个月	新股 锁定 期内	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健尔康	2024年10月29日	6个月	新股 锁定 期内	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024年8月19日	6个月	新股 锁定 期内	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-

603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股 锁定 期内	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股 锁定 期内	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股 锁定 期内	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股 锁定 期内	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股 锁定 期内	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股 锁定 期内	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股 锁定 期内	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股 锁定 期内	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-

688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股 锁定 期内	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

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
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大资产重组	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	81,619,267	591,259,255.41	589,291,107.74	-

注：本基金截至 2024 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大资产重组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市场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：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用

风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为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出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人会对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

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 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 12 月 31 日，本基金

持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,996,034,359.45	-	-	-	-	-	1,996,034,359.45
结算备付金	1,987,673,826.64	-	-	-	-	-	1,987,673,826.64
存出保证金	25,195,993.95	-	-	-	-	439,500,960.00	464,696,953.95
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	355,451,566,630.68	355,451,566,630.68

资产总计	4,008,904,180.04	-	-	-	-	-355,891,067,590.68	359,899,971,770.72
负债							
交易性金融 负债	-	-	-	-	-	253,556.82	253,556.82
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	46,500,026.97	46,500,026.97
应付托管费	-	-	-	-	-	15,500,009.01	15,500,009.01
应付清算款	-	-	-	-	-	44,908,165.68	44,908,165.68
应交税费	-	-	-	-	-	10,042,749.01	10,042,749.01
其他负债	-	-	-	-	-	155,643,720.23	155,643,720.23
负债总计	-	-	-	-	-	272,848,227.72	272,848,227.72
利率敏感度 缺口	4,008,904,180.04	-	-	-	-	-355,618,219,362.96	359,627,123,543.00
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	557,763,846.81	-	-	-	-	-	557,763,846.81
结算备付金	1,178,798,737.04	-	-	-	-	-	1,178,798,737.04
存出保证金	7,663,107.81	-	-	-	-	142,407,720.00	150,070,827.81
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	-129,302,062,860.16	129,302,062,860.16
应收股利	-	-	-	-	-	74,250.20	74,250.20
应收清算款	-	-	-	-	-	292,464,049.18	292,464,049.18
其他资产	-	-	-	-	-	1,054,977.37	1,054,977.37
资产总计	1,744,225,691.66	-	-	-	-	-129,738,063,856.91	131,482,289,548.57
负债							
交易性金融 负债	-	-	-	-	-	2,096,681.51	2,096,681.51
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	47,802,161.66	47,802,161.66
应付托管费	-	-	-	-	-	9,560,432.32	9,560,432.32
其他负债	-	-	-	-	-	336,266,006.46	336,266,006.46
负债总计	-	-	-	-	-	395,725,281.95	395,725,281.95
利率敏感度 缺口	1,744,225,691.66	-	-	-	-	-129,342,338,574.96	131,086,564,266.62

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2023 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	355,451,566,630.68	98.84	129,302,062,860.16	98.64
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	-253,556.82	-0.00	-2,096,681.51	—
合计	355,451,313,073.86	98.84	129,299,966,178.65	98.64

注：其他包含：1、可退替代款。2、在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	17,870,417,512.71	6,494,416,013.28
	业绩比较基准下降 5%	-17,870,417,512.71	-6,494,416,013.28

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	354,861,603,820.58	129,300,832,868.14
第二层次	589,318,844.24	-
第三层次	643,965.86	1,229,992.02
合计	355,451,566,630.68	129,302,062,860.16

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次

还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,229,992.02	1,229,992.02
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	530,388.08	530,388.08
转出第三层次	-	1,553,367.04	1,553,367.04
当期利得或损失总额	-	436,952.80	436,952.80
其中：计入损益的利得或损失	-	436,952.80	436,952.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	643,965.86	643,965.86
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	383,244.77	383,244.77
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 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	-	1,932,889.83	1,932,889.83
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,821,317.59	2,821,317.59
转出第三层次	-	4,697,799.55	4,697,799.55
当期利得或损失总额	-	1,173,584.15	1,173,584.15
其中：计入损益的利得或损失	-	1,173,584.15	1,173,584.15
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,229,992.02	1,229,992.02

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	159,407.39	159,407.39
--	---	------------	------------

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2024 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	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	643,965.86	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665~5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	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	1,229,992.02	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	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 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

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 2024 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 305,942,969,761.09 元(2023 年度：135,359,282,028.16 元)，其中包括以股票支付的申购款 191,378,813,601.50 元和以现金支付的申购款 114,564,156,159.59 元(2023 年度：其中包括以股票支付的申购款 79,841,614,082.16 元和以现金支付的申购款 55,517,667,946.00 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	355,451,566,630.68	98.76
	其中：股票	355,451,566,630.68	98.76
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	3,983,708,186.09	1.11
8	其他各项资产	464,696,953.95	0.13
9	合计	359,899,971,770.72	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	3,330,315,311.77	0.93
B	采矿业	17,049,017,595.04	4.74
C	制造业	186,005,852,776.26	51.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,647,070,042.92	3.79
E	建筑业	7,243,442,990.06	2.01
F	批发和零售业	924,709,086.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	12,458,156,657.62	3.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,950,206,104.07	4.71
J	金融业	87,422,406,153.82	24.31
K	房地产业	3,039,817,216.34	0.85

L	租赁和商务服务业	2,986,641,935.07	0.83
M	科学研究和技术服务业	3,326,027,143.10	0.92
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	1,067,231,916.25	0.30
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	355,450,894,928.32	98.84

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	495,433.63	0.00
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	31,864.80	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,255.37	0.00
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	11,148.56	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	671,702.36	0.00

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	600519	贵州茅台	10,862,818	16,554,934,632.00	4.60
2	300750	宁德时代	45,552,565	12,116,982,290.00	3.37
3	601318	中国平安	185,785,668	9,781,615,420.20	2.72
4	600036	招商银行	213,630,682	8,395,685,802.60	2.33
5	000333	美的集团	84,336,743	6,343,809,808.46	1.76
6	600900	长江电力	211,298,846	6,243,880,899.30	1.74
7	300059	东方财富	218,048,418	5,630,010,152.76	1.57
8	600030	中信证券	168,527,831	4,915,956,830.27	1.37
9	601166	兴业银行	250,963,094	4,808,452,881.04	1.34
10	000858	五粮液	33,582,821	4,702,938,252.84	1.31
11	002594	比亚迪	15,567,982	4,400,445,792.12	1.22
12	601899	紫金矿业	284,342,235	4,299,254,593.20	1.20
13	601398	工商银行	605,054,561	4,186,977,562.12	1.16
14	002475	立讯精密	87,304,224	3,558,520,170.24	0.99
15	600276	恒瑞医药	77,058,223	3,536,972,435.70	0.98
16	000651	格力电器	77,336,621	3,514,949,424.45	0.98
17	600887	伊利股份	109,934,624	3,317,826,952.32	0.92
18	688981	中芯国际	34,399,236	3,254,855,710.32	0.91
19	601328	交通银行	406,639,170	3,159,586,350.90	0.88
20	601816	京沪高铁	504,861,584	3,109,947,357.44	0.86
21	601288	农业银行	551,149,006	2,943,135,692.04	0.82
22	000725	京东方A	637,914,147	2,800,443,105.33	0.78
23	300760	迈瑞医疗	10,477,549	2,671,774,995.00	0.74
24	600919	江苏银行	253,407,136	2,488,458,075.52	0.69
25	601088	中国神华	56,900,384	2,474,028,696.32	0.69
26	688256	寒武纪	3,731,867	2,455,568,486.00	0.68
27	688041	海光信息	15,981,103	2,393,809,418.37	0.67
28	603259	药明康德	43,242,227	2,380,052,174.08	0.66

29	600309	万华化学	32,580,687	2,324,632,017.45	0.65
30	000063	中兴通讯	55,563,005	2,244,745,402.00	0.62
31	300124	汇川技术	36,964,996	2,165,409,465.68	0.60
32	601668	中国建筑	359,138,697	2,154,832,182.00	0.60
33	002371	北方华创	5,427,500	2,122,152,500.00	0.59
34	600000	浦发银行	202,620,114	2,084,960,973.06	0.58
35	601601	中国太保	59,087,741	2,013,710,213.28	0.56
36	601988	中国银行	363,863,945	2,004,890,336.95	0.56
37	002415	海康威视	63,851,856	1,960,251,979.20	0.55
38	000001	平安银行	167,517,503	1,959,954,785.10	0.54
39	601728	中国电信	268,087,085	1,935,588,753.70	0.54
40	300308	中际旭创	15,404,251	1,902,579,041.01	0.53
41	600837	海通证券	166,455,718	1,850,987,584.16	0.51
42	300274	阳光电源	24,968,906	1,843,454,329.98	0.51
43	600690	海尔智家	64,708,528	1,842,251,792.16	0.51
44	600941	中国移动	15,506,920	1,832,297,667.20	0.51
45	603019	中科曙光	25,179,179	1,820,958,225.28	0.51
46	002714	牧原股份	47,138,411	1,812,000,518.84	0.50
47	601766	中国中车	210,063,460	1,760,331,794.80	0.49
48	600016	民生银行	425,481,011	1,757,236,575.43	0.49
49	601857	中国石油	195,659,448	1,749,195,465.12	0.49
50	600406	国电南瑞	69,348,592	1,748,971,490.24	0.49
51	600660	福耀玻璃	27,628,212	1,724,000,428.80	0.48
52	601919	中远海控	110,189,617	1,707,939,063.50	0.47
53	601985	中国核电	162,919,547	1,699,250,875.21	0.47
54	600031	三一重工	102,496,294	1,689,138,925.12	0.47
55	600028	中国石化	251,716,707	1,681,467,602.76	0.47
56	002352	顺丰控股	41,615,995	1,677,124,598.50	0.47
57	600104	上汽集团	79,958,244	1,659,933,145.44	0.46
58	601127	赛力斯	12,425,575	1,657,447,449.25	0.46
59	601012	隆基绿能	104,594,051	1,643,172,541.21	0.46
60	000100	TCL 科技	324,194,370	1,630,697,681.10	0.45
61	000568	泸州老窖	12,761,135	1,597,694,102.00	0.44
62	601229	上海银行	171,770,634	1,571,701,301.10	0.44
63	601169	北京银行	255,504,171	1,571,350,651.65	0.44
64	601225	陕西煤业	66,913,239	1,556,401,939.14	0.43
65	601688	华泰证券	88,313,906	1,553,441,606.54	0.43
66	600809	山西汾酒	8,397,550	1,546,912,685.50	0.43
67	002230	科大讯飞	31,970,258	1,544,802,866.56	0.43
68	603501	韦尔股份	14,687,901	1,533,563,743.41	0.43
69	300498	温氏股份	91,963,343	1,518,314,792.93	0.42
70	601138	工业富联	68,595,095	1,474,794,542.50	0.41
71	600050	中国联通	274,485,016	1,457,515,434.96	0.41

72	601211	国泰君安	77,640,481	1,447,994,970.65	0.40
73	688012	中微公司	7,620,235	1,441,443,652.60	0.40
74	600150	中国船舶	38,591,885	1,387,764,184.60	0.39
75	002142	宁波银行	56,963,582	1,384,784,678.42	0.39
76	300502	新易盛	11,676,329	1,349,550,105.82	0.38
77	688008	澜起科技	19,521,636	1,325,519,084.40	0.37
78	603288	海天味业	28,785,957	1,321,275,426.30	0.37
79	000338	潍柴动力	93,598,786	1,282,303,368.20	0.36
80	601818	光大银行	320,387,446	1,239,899,416.02	0.34
81	603986	兆易创新	11,489,832	1,227,114,057.60	0.34
82	002027	分众传媒	174,482,674	1,226,613,198.22	0.34
83	600999	招商证券	63,974,804	1,225,757,244.64	0.34
84	601628	中国人寿	28,745,434	1,205,008,593.28	0.34
85	688111	金山办公	4,106,849	1,176,160,485.11	0.33
86	000625	长安汽车	85,668,944	1,144,537,091.84	0.32
87	601390	中国中铁	177,334,519	1,133,167,576.41	0.32
88	601888	中国中免	16,799,632	1,125,743,340.32	0.31
89	000425	徐工机械	141,697,443	1,123,660,722.99	0.31
90	600089	特变电工	87,206,558	1,111,011,548.92	0.31
91	000938	紫光股份	39,504,138	1,099,400,160.54	0.31
92	600436	片仔癀	5,118,974	1,098,019,923.00	0.31
93	600048	保利发展	123,920,173	1,097,932,732.78	0.31
94	601658	邮储银行	191,612,800	1,088,360,704.00	0.30
95	002241	歌尔股份	42,055,393	1,085,449,693.33	0.30
96	300033	同花顺	3,765,497	1,082,580,387.50	0.30
97	600905	三峡能源	247,076,078	1,079,722,460.86	0.30
98	000792	盐湖股份	65,593,817	1,079,674,227.82	0.30
99	300015	爱尔眼科	80,545,805	1,067,231,916.25	0.30
100	600938	中国海油	36,071,893	1,064,481,562.43	0.30
101	600019	宝钢股份	151,903,365	1,063,323,555.00	0.30
102	601006	大秦铁路	156,831,239	1,063,315,800.42	0.30
103	600438	通威股份	46,584,339	1,029,979,735.29	0.29
104	601939	建设银行	115,897,136	1,018,735,825.44	0.28
105	600584	长电科技	24,621,901	1,006,050,874.86	0.28
106	601600	中国铝业	136,844,429	1,005,806,553.15	0.28
107	300014	亿纬锂能	21,217,496	991,705,763.04	0.28
108	600585	海螺水泥	41,470,611	986,171,129.58	0.27
109	601009	南京银行	92,220,775	982,151,253.75	0.27
110	600760	中航沈飞	19,017,469	964,566,027.68	0.27
111	600893	航发动力	23,059,909	955,833,228.05	0.27
112	600958	东方证券	90,300,631	953,574,663.36	0.27
113	601989	中国重工	196,829,117	946,748,052.77	0.26
114	600111	北方稀土	43,763,720	928,666,138.40	0.26

115	000977	浪潮信息	17,754,312	921,093,706.56	0.26
116	000538	云南白药	15,319,784	918,421,050.80	0.26
117	600926	杭州银行	62,201,382	908,762,191.02	0.25
118	002050	三花智控	38,648,497	908,626,164.47	0.25
119	688271	联影医疗	7,159,968	905,019,955.20	0.25
120	605499	东鹏饮料	3,599,037	894,432,675.24	0.25
121	300408	三环集团	23,217,730	894,114,782.30	0.25
122	002463	沪电股份	22,386,950	887,642,567.50	0.25
123	600015	华夏银行	109,934,847	880,578,124.47	0.24
124	002304	洋河股份	10,413,792	869,864,045.76	0.24
125	002179	中航光电	21,994,196	864,371,902.80	0.24
126	600886	国投电力	51,519,699	856,257,397.38	0.24
127	000002	万科 A	117,504,927	853,085,770.02	0.24
128	000166	申万宏源	155,590,417	832,408,730.95	0.23
129	000776	广发证券	51,132,136	828,851,924.56	0.23
130	601669	中国电建	148,718,264	812,001,721.44	0.23
131	603993	洛阳钼业	122,068,711	811,756,928.15	0.23
132	601916	浙商银行	260,331,544	757,564,793.04	0.21
133	688036	传音控股	7,972,731	757,409,445.00	0.21
134	002049	紫光国微	11,765,171	757,324,057.27	0.21
135	300433	蓝思科技	34,288,189	750,911,339.10	0.21
136	002028	思源电气	10,277,186	747,151,422.20	0.21
137	601377	兴业证券	119,297,163	746,800,240.38	0.21
138	600009	上海机场	21,515,373	734,749,987.95	0.20
139	600570	恒生电子	26,091,976	730,314,408.24	0.20
140	600010	宝钢股份	391,906,168	728,945,472.48	0.20
141	601186	中国铁建	79,451,151	728,567,054.67	0.20
142	601336	新华保险	14,419,850	716,666,545.00	0.20
143	601901	方正证券	85,208,940	709,790,470.20	0.20
144	002311	海大集团	14,431,019	707,841,481.95	0.20
145	600547	山东黄金	31,232,355	706,788,193.65	0.20
146	600795	国电电力	153,891,289	704,822,103.62	0.20
147	603799	华友钴业	23,496,281	687,501,182.06	0.19
148	002460	赣锋锂业	19,496,716	682,580,027.16	0.19
149	000768	中航西飞	24,070,766	679,758,431.84	0.19
150	601838	成都银行	39,660,628	678,593,345.08	0.19
151	601995	中金公司	19,931,769	671,501,297.61	0.19
152	601800	中国交建	61,472,300	642,385,535.00	0.18
153	001979	招商蛇口	62,638,759	641,420,892.16	0.18
154	600989	宝丰能源	37,954,752	639,158,023.68	0.18
155	002422	科伦药业	21,300,630	637,527,855.90	0.18
156	600415	小商品城	47,299,433	634,285,396.53	0.18
157	601360	三六零	60,447,105	625,627,536.75	0.17

158	000157	中联重科	85,700,796	619,616,755.08	0.17
159	601788	光大证券	33,803,625	612,183,648.75	0.17
160	300442	润泽科技	11,741,469	610,086,729.24	0.17
161	600029	南方航空	93,153,349	604,565,235.01	0.17
162	600489	中金黄金	50,230,232	604,269,690.96	0.17
163	600115	中国东航	147,736,094	590,944,376.00	0.16
164	002252	上海莱士	81,619,267	589,291,107.74	0.16
165	002466	天齐锂业	17,815,457	587,910,081.00	0.16
166	603369	今世缘	12,946,558	585,572,818.34	0.16
167	002001	新 和 成	26,626,541	584,985,105.77	0.16
168	600674	川投能源	33,741,919	582,048,102.75	0.16
169	600745	闻泰科技	14,929,781	578,976,907.18	0.16
170	601066	中信建投	22,481,198	578,890,848.50	0.16
171	600066	宇通客车	21,936,198	578,676,903.24	0.16
172	300782	卓胜微	6,394,834	573,616,609.80	0.16
173	601689	拓普集团	11,672,583	571,956,567.00	0.16
174	601881	中国银河	37,480,009	570,820,537.07	0.16
175	601878	浙商证券	46,591,503	570,279,996.72	0.16
176	300418	昆仑万维	14,790,400	569,134,592.00	0.16
177	601633	长城汽车	21,542,300	567,208,759.00	0.16
178	003816	中国广核	135,779,500	560,769,335.00	0.16
179	600346	恒力石化	36,401,429	558,761,935.15	0.16
180	002736	国信证券	49,796,325	557,718,840.00	0.16
181	600426	华鲁恒升	25,585,393	552,900,342.73	0.15
182	002236	大华股份	34,180,030	546,880,480.00	0.15
183	600196	复星医药	21,993,271	546,532,784.35	0.15
184	002648	卫星化学	29,069,881	546,223,063.99	0.15
185	000661	长春高新	5,474,009	544,335,454.96	0.15
186	300122	智飞生物	20,682,207	543,942,044.10	0.15
187	002920	德赛西威	4,930,818	542,932,369.98	0.15
188	688169	石头科技	2,471,835	542,048,697.15	0.15
189	600160	巨化股份	22,251,443	536,704,805.16	0.15
190	688126	沪硅产业	28,436,134	535,168,041.88	0.15
191	000786	北新建材	17,458,911	529,179,592.41	0.15
192	601117	中国化学	63,357,680	525,235,167.20	0.15
193	000963	华东医药	15,055,845	520,932,237.00	0.14
194	600460	士兰微	19,976,066	519,777,237.32	0.14
195	600372	中航机载	41,814,854	515,577,149.82	0.14
196	600011	华能国际	75,893,084	513,796,178.68	0.14
197	601868	中国能建	223,895,732	512,721,226.28	0.14
198	601111	中国国航	64,623,069	511,168,475.79	0.14
199	002601	龙佰集团	28,825,045	509,338,545.15	0.14
200	600183	生益科技	20,953,752	503,937,735.60	0.14

201	000596	古井贡酒	2,891,637	501,120,692.10	0.14
202	300394	天孚通信	5,424,962	495,624,528.32	0.14
203	002129	TCL 中环	55,779,250	494,761,947.50	0.14
204	001965	招商公路	35,246,720	491,691,744.00	0.14
205	688223	晶科能源	69,096,445	491,275,723.95	0.14
206	600600	青岛啤酒	6,049,862	489,554,833.04	0.14
207	300347	泰格医药	8,948,066	488,743,364.92	0.14
208	601100	恒立液压	9,248,138	488,024,242.26	0.14
209	300896	爱美客	2,665,840	486,515,800.00	0.14
210	601021	春秋航空	8,420,242	485,595,356.14	0.14
211	000807	云铝股份	35,856,769	485,142,084.57	0.13
212	002180	纳思达	17,120,388	482,281,329.96	0.13
213	600085	同仁堂	11,877,005	482,087,632.95	0.13
214	600741	华域汽车	27,170,244	478,467,996.84	0.13
215	002493	荣盛石化	52,504,751	475,167,996.55	0.13
216	600176	中国巨石	41,506,886	472,763,431.54	0.13
217	002459	晶澳科技	34,374,600	472,650,750.00	0.13
218	300832	新产业	6,648,830	471,069,605.50	0.13
219	600219	南山铝业	120,342,530	470,539,292.30	0.13
220	601998	中信银行	66,929,343	467,166,814.14	0.13
221	000895	双汇发展	17,911,034	464,970,442.64	0.13
222	301269	华大九天	3,804,050	460,670,455.00	0.13
223	300661	圣邦股份	5,623,533	459,892,528.74	0.13
224	603392	万泰生物	6,489,386	457,242,137.56	0.13
225	300759	康龙化成	17,791,113	457,231,604.10	0.13
226	002709	天赐材料	23,091,397	455,362,348.84	0.13
227	002916	深南电路	3,639,740	454,967,500.00	0.13
228	600482	中国动力	18,570,205	454,412,916.35	0.13
229	600515	海南机场	118,353,921	447,377,821.38	0.12
230	002938	鹏鼎控股	12,039,500	439,200,960.00	0.12
231	600188	兖矿能源	30,917,174	438,096,355.58	0.12
232	002271	东方雨虹	33,718,477	437,665,831.46	0.12
233	688396	华润微	9,231,597	435,639,062.43	0.12
234	600845	宝信软件	14,828,694	433,887,586.44	0.12
235	601877	正泰电器	18,528,374	433,749,235.34	0.12
236	600233	圆通速递	29,745,112	422,083,139.28	0.12
237	000975	山金国际	27,406,703	421,241,025.11	0.12
238	600161	天坛生物	20,497,970	420,208,385.00	0.12
239	601319	中国人保	55,080,825	419,715,886.50	0.12
240	002555	三七互娱	26,750,529	418,378,273.56	0.12
241	000630	铜陵有色	127,907,400	413,140,902.00	0.11
242	601618	中国中冶	123,214,393	406,607,496.90	0.11
243	601607	上海医药	19,227,469	403,776,849.00	0.11

244	000983	山西焦煤	49,001,329	403,770,950.96	0.11
245	002074	国轩高科	18,593,494	394,553,942.68	0.11
246	600023	浙能电力	69,457,917	393,131,810.22	0.11
247	000999	华润三九	8,850,273	392,421,104.82	0.11
248	605117	德业股份	4,584,899	388,799,435.20	0.11
249	601898	中煤能源	31,638,191	385,353,166.38	0.11
250	000408	藏格矿业	13,715,500	380,330,815.00	0.11
251	600588	用友网络	35,318,840	378,971,153.20	0.11
252	300450	先导智能	18,912,450	378,627,249.00	0.11
253	000301	东方盛虹	45,586,669	374,266,552.49	0.10
254	600362	江西铜业	17,879,829	369,039,670.56	0.10
255	688599	天合光能	18,795,750	362,757,975.00	0.10
256	300316	晶盛机电	11,326,795	361,324,760.50	0.10
257	601872	招商轮船	56,184,515	360,142,741.15	0.10
258	601238	广汽集团	38,246,732	357,224,476.88	0.10
259	603296	华勤技术	4,961,700	352,032,615.00	0.10
260	000876	新希望	39,062,585	350,782,013.30	0.10
261	300413	芒果超媒	12,966,483	348,668,727.87	0.10
262	600803	新奥股份	15,970,772	346,246,336.96	0.10
263	600332	白云山	12,179,814	346,150,313.88	0.10
264	601799	星宇股份	2,537,692	338,731,128.16	0.09
265	603260	合盛硅业	6,051,626	336,228,340.56	0.09
266	300628	亿联网络	8,706,155	336,057,583.00	0.09
267	300999	金龙鱼	10,304,700	336,036,267.00	0.09
268	600061	国投资本	44,362,544	333,606,330.88	0.09
269	600027	华电国际	58,764,138	329,666,814.18	0.09
270	600039	四川路桥	45,044,647	327,925,030.16	0.09
271	002812	恩捷股份	10,065,285	321,988,467.15	0.09
272	002007	华兰生物	18,929,283	318,958,418.55	0.09
273	600918	中泰证券	48,102,200	316,031,454.00	0.09
274	600875	东方电气	19,170,933	304,626,125.37	0.08
275	688472	阿特斯	24,201,003	303,964,597.68	0.08
276	000617	中油资本	43,726,407	301,274,944.23	0.08
277	601699	潞安环能	20,676,398	296,913,075.28	0.08
278	600025	华能水电	31,105,298	295,811,383.98	0.08
279	600018	上港集团	48,213,342	295,065,653.04	0.08
280	603659	璞泰来	18,424,554	293,134,654.14	0.08
281	600026	中远海能	24,062,739	279,127,772.40	0.08
282	688009	中国通号	44,562,932	278,963,954.32	0.08
283	688303	大全能源	11,278,938	272,273,563.32	0.08
284	603806	福斯特	17,983,056	266,149,228.80	0.07
285	601865	福莱特	13,192,242	259,755,244.98	0.07
286	688506	百利天恒	1,348,889	258,622,487.97	0.07

287	601059	信达证券	16,740,910	250,778,831.80	0.07
288	603195	公牛集团	3,432,638	241,108,493.12	0.07
289	601698	中国卫通	10,958,895	223,561,458.00	0.06
290	603833	欧派家居	3,238,501	223,262,258.94	0.06
291	688187	时代电气	4,627,891	221,768,536.72	0.06
292	300979	华利集团	2,685,276	211,196,957.40	0.06
293	601236	红塔证券	24,495,386	207,965,827.14	0.06
294	000708	中信特钢	17,383,744	198,348,519.04	0.06
295	601136	首创证券	8,977,000	197,494,000.00	0.05
296	601808	中海油服	10,229,400	155,998,350.00	0.04
297	688082	盛美上海	1,555,102	155,510,200.00	0.04
298	000800	一汽解放	16,786,600	137,650,120.00	0.04
299	600377	宁沪高速	8,144,700	124,695,357.00	0.03
300	001289	龙源电力	2,652,218	41,666,344.78	0.01

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	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
2	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
3	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
4	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
5	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
6	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
7	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
8	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
9	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
10	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
11	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
12	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
13	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
14	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
15	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
16	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
17	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
18	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
19	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
20	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
21	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
22	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
23	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00

24	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
25	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
26	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
27	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
28	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
29	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
30	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
31	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
32	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
33	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
34	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
35	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
36	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
37	603285	键邦股份	129	2,916.69	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	9,188,382,471.16	7.01
2	000333	美的集团	5,623,517,356.38	4.29
3	002594	比亚迪	4,566,112,821.89	3.48
4	000858	五粮液	4,242,540,808.65	3.24
5	300059	东方财富	3,097,621,346.81	2.36
6	000651	格力电器	3,089,173,009.00	2.36
7	002475	立讯精密	3,084,157,814.68	2.35
8	300760	迈瑞医疗	2,772,868,462.57	2.12
9	000725	京东方 A	2,547,140,501.95	1.94
10	002371	北方华创	2,525,161,663.94	1.93
11	300308	中际旭创	2,125,620,535.08	1.62
12	300124	汇川技术	2,070,140,266.50	1.58
13	002415	海康威视	2,037,936,985.85	1.55
14	300274	阳光电源	2,030,723,349.83	1.55
15	002714	牧原股份	1,967,323,750.83	1.50
16	300498	温氏股份	1,757,292,893.64	1.34
17	000001	平安银行	1,721,194,888.86	1.31
18	601127	赛力斯	1,686,110,889.13	1.29
19	000568	泸州老窖	1,651,516,871.85	1.26
20	000063	中兴通讯	1,544,870,964.55	1.18

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,945,351,889.13	3.77
2	000333	美的集团	2,689,005,626.28	2.05
3	002594	比亚迪	2,650,254,160.80	2.02
4	300059	东方财富	1,943,173,827.83	1.48
5	000858	五粮液	1,843,220,007.56	1.41
6	002371	北方华创	1,554,557,205.71	1.19
7	000651	格力电器	1,426,388,732.41	1.09
8	002475	立讯精密	1,373,588,547.38	1.05
9	000792	盐湖股份	1,209,918,129.90	0.92
10	000725	京东方 A	1,187,023,106.99	0.91
11	300760	迈瑞医疗	1,154,659,419.49	0.88
12	300308	中际旭创	1,151,831,668.11	0.88
13	300274	阳光电源	1,090,842,444.20	0.83
14	300124	汇川技术	982,647,655.83	0.75
15	002415	海康威视	976,454,826.22	0.74
16	002714	牧原股份	892,934,422.53	0.68
17	300223	北京君正	799,088,803.00	0.61
18	002142	宁波银行	792,361,233.49	0.60
19	000001	平安银行	786,279,547.88	0.60
20	000063	中兴通讯	771,197,537.78	0.59

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	139,517,632,379.69
卖出股票收入（成交）总额	73,159,695,221.05

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中信证券（600030）在报告编制日前一年内曾受到广东证监局深圳证券交易所、上海证券交易所和北京证券交易所的处罚。

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	464,696,953.95
2	应收清算款	-
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	464,696,953.95

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	301626	苏州天脉	62,951.46	0.00	新股锁定期内
2	688615	合合信息	47,910.42	0.00	新股锁定期内
3	301611	珂玛科技	45,104.40	0.00	新股锁定期内
4	688449	联芸科技	41,392.64	0.00	新股锁定期内
5	688605	先锋精科	39,937.92	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		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	
		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（%）
792,893	112,734.87	74,243,732,479.00	83.06	14,587,732,446.00	16.32	555,222,765.00	0.62

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	中央汇金投资有限责任公司	35,654,598,859.00	39.89
2	中央汇金资产管理有限责任公司	26,621,328,344.00	29.78
3	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	894,887,573.00	1.00
4	国泰君安证券股份有限公司	843,489,204.00	0.94
5	中国人寿保险股份有限公司	633,495,134.00	0.71
6	友邦人寿保险有限公司—传统	502,957,619.00	0.56
7	中国平安人寿保险股份有限公司—万能—一个险万能	465,449,800.00	0.52
8	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	356,943,800.00	0.40
9	国华人寿保险股份有限公司—传统十三号	268,783,764.00	0.30
10	香港中央结算有限公司	215,521,627.00	0.24
11	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	555,222,765.00	0.62

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

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	10,000.00	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（2012 年 5 月 4 日） 基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	37,444,087,690.00
本报告期基金总申购份额	86,409,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	34,466,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	89,386,687,690.00

§ 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

基金管理人重大人事变动：

2024 年 1 月 19 日，公司股东会书面决定尹雷先生担任公司独立董事，陆楨女士不再担任公司独立董事。

2024 年 7 月 2 日，经公司董事会审议通过，柳军先生、王文慧女士任公司副总经理。

2024 年 7 月 12 日，经公司董事会审议通过，李晓西先生不再担任公司副总经理。

2024 年 7 月 2 日，柳军先生任公司副总经理，根据法规要求，不再担任职工监事。

2024 年 7 月 11 日，公司全体员工投票推选赵景云女士担任公司职工监事。

2024 年 8 月 16 日，公司股东会书面决定卢龙威先生担任公司监事，卞时珍女士不再担任公司监事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计

师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 150,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	34,371,718,688.83	16.16	8,639,039.19	30.09	—
广发证券	6	30,338,133,429.82	14.27	4,486,150.30	15.63	—
国泰君安	2	27,193,533,905.74	12.79	2,719,543.29	9.47	—
方正证券	2	23,928,169,568.43	11.25	2,392,974.04	8.34	—
申万宏源	2	16,048,272,262.88	7.55	1,604,918.02	5.59	—
招商证券	2	13,971,851,729.14	6.57	1,648,649.56	5.74	—
中信建投	2	13,845,095,711.66	6.51	1,570,015.26	5.47	—
海通证券	1	13,067,631,158.35	6.14	1,657,293.70	5.77	—
国信证券	1	12,840,541,266.70	6.04	1,284,136.68	4.47	—
中金公司	2	8,879,672,633.91	4.18	888,030.03	3.09	—
东方财富证券	2	8,538,853,999.37	4.02	853,938.90	2.97	—
中信证券	3	2,892,480,451.94	1.36	289,254.18	1.01	—
国投证券	1	2,716,362,2	1.28	271,663.63	0.95	—

		54.06				
平安证券	2	1,957,484,369.84	0.92	195,751.40	0.68	-
华宝证券	1	1,267,056,755.01	0.60	126,709.90	0.44	-
中金财富证券	1	815,981,060.38	0.38	81,603.20	0.28	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当综合考虑下列因素：

- (1) 具有相应的业务经营资格；
- (2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；
- (3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- (4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要的；
- (6) 被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2. 选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

（1）公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

（2）基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

（3）如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3. 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

4、本报告期内，本基金新增租用了东方财富证券、国信证券的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
方正证	-	-	-	-	-	-

券						
海通证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证	-	-	-	-	-	-

券						
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 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旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 19 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 05 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 27 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金调低管理费率 and 托管费率并修改基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 20 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 18 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 02 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 24 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 27 日
9	关于同意国金证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 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	2024 年 09 月 20 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 19 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 04 日

	止深圳前海财厚基金销售有限公司 办理旗下基金相关业务公告		
12	关于同意光大证券股份有限公司为 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指 数证券投资基金提供一般做市服务 的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 08 月 21 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终 止中民财富基金销售（上海）有限 公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 08 月 16 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停 牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 24 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗 下基金参加招商证券股份有限公司 费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 19 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗 下基金投资关联方承销期内承销证 券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 18 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高 级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 13 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终 止喜鹊财富基金销售有限公司办理 旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 06 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高 级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 03 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变 更网上直销汇款交易业务的收款银 行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗 下基金投资关联方承销期内分销证 券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提 醒投资者防范不法分子假冒公司名 义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗 下基金投资关联方承销期内承销证 券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗 下基金投资关联方承销期内承销证 券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 24 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终 止和合期货有限公司办理旗下基金 相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 21 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对 营业执照吊销客户采取限制交易措	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日

	施的公告		
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
28	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 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	2024 年 01 月 24 日
29	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 11 日
30	关于同意财通证券股份有限公司为华泰柏瑞沪深 300 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	2024 年 01 月 09 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20240116-20241231;	6,247,371,001.00	29,407,227,858.00	0.00	35,654,598,859.00	39.89
	2	20240730-20241231	0.00	26,621,328,344.00	0.00	26,621,328,344.00	29.78
产品特有风险							
本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不							

确定性。(4) 基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向, 审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响, 同时将完善流动性风险管控机制, 最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注: 无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日