

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券
投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	60

8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	86
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	88
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	88
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	88
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	88
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	88
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	88
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	89
8.12 投资组合报告附注	89
§ 9 基金份额持有人信息	90
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	90
9.2 期末上市基金前十名持有人	90
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	91
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	91
§ 10 开放式基金份额变动	91
§ 11 重大事件揭示	91
11.1 基金份额持有人大会决议	91
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	91
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	91
11.4 基金投资策略的改变	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	92
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	92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	92
11.8 其他重大事件	93
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	96
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	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	96
§ 13 备查文件目录	97
13.1 备查文件目录	97
13.2 存放地点	97
13.3 查阅方式	97

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 1000
场内简称	中证 1000 (扩位证券简称: 中证 1000 指数 ETF)
基金主代码	516300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	144,102,182.00 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	2021 年 3 月 24 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。本基金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。
投资策略	1、股票的投资策略; 2、存托凭证的投资策略; 3、债券投资策略; 4、股指期货的投资策略; 5、资产支持证券的投资策略; 6、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 采用完全复制的被动式投资策略, 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: 一方面, 相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高; 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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	韩鑫普
	联系电话	021-38601777	0755-82943666
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95565
传真		021-38601799	0755-82960794
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

邮政编码	200135	518000
法定代表人	贾波	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 3 月 15 日 (基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,028,509.73	-9,404,893.50	2,034,836.12
本期利润	-407,450.95	-24,514,078.93	5,797,925.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0030	-0.2276	0.1390
本期加权平均净值利润率	-0.29%	-21.29%	12.39%
本期基金份额净值增长率	-3.41%	-20.85%	26.69%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-4,535,440.78	416,709.35	4,395,137.19
期末可供分配基金份额利润	-0.0315	0.0027	0.1032
期末基金资产净值	139,566,741.22	157,018,891.35	53,971,358.62
期末基金份额	0.9685	1.0027	1.2669

额净值			
3.1.3 累计 期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累 计净值增长 率	-3.15%	0.27%	26.69%

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

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

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

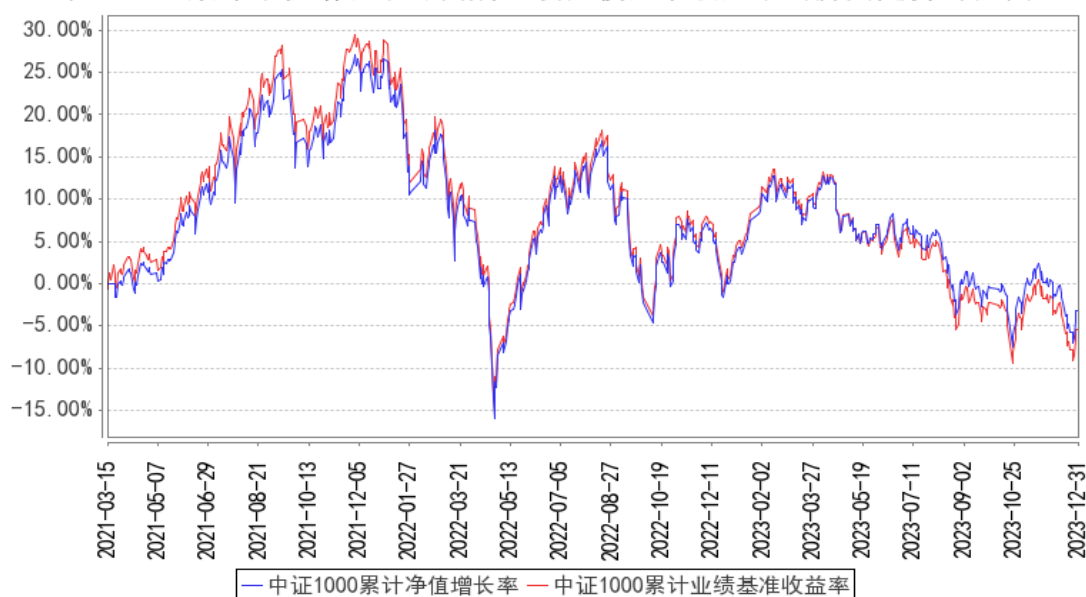
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.75%	1.02%	-3.15%	1.04%	0.40%	-0.02%
过去六个月	-9.45%	0.98%	-10.83%	1.00%	1.38%	-0.02%
过去一年	-3.41%	0.93%	-6.28%	0.95%	2.87%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	-3.15%	1.23%	-5.36%	1.26%	2.21%	-0.03%

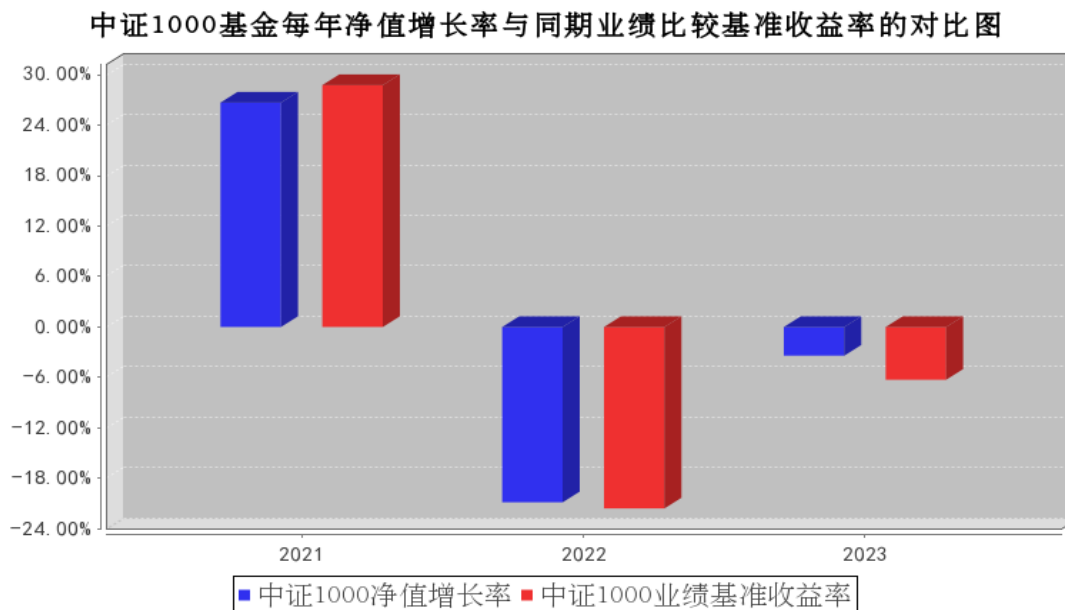
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中证1000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 2021 年 3 月 15 日至 2023 年 12 月 31 日。

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



注：本基金合同自 2021 年 3 月 15 日起生效，2021 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李茜	本基金的基金经理	2021 年 3 月 15 日	-	8 年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 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。2019 年 11 月至 2022 年 12 月任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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 11 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。2020 年 12 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、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任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 2 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰

				<p>柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金和华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、计算机、电子的表现相对较好，涨跌幅分别为 25.75%、16.80%、8.97%和 7.25%。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-11.38%、-7.42%、-6.28%和-19.41%。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-4.10%和-21.85%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

回顾 2023 年，在经济复苏预期历经调整、海外经济保持紧缩态势等内外因素综合影响下，库存周期及中美经济周期错位的驱动下，市场呈现震荡走势。从估值和盈利贡献拆解角度看，指数的收益率均落后于 ROE，估值的持续收缩成为指数承压的重要拖累。

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 0.025%，期间日跟踪误差为 0.036%，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 0.9685 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.41%，业绩比较基准收益率为-6.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国内增长相对乏力、美债利率上行以及海外资金流出共同导致了风险溢价的抬升导致的过渡悲观预期已经反应在当前市场资产价格上，当前 A 股赔率处于历史高位，股债性价比已经达到了较高分位，确定性较高的驱动因素在于：1、国内积极财政政策的前置，财政政策将对基建发力形成积极支撑。2、部分行业逐渐进入到补库存周期，存货净增加或成为基本面边际改善的来源之一，后续工业稳增长政策是影响当前及明年库存补库节奏的重要变量。3、中美经济周期错位预计将进入下半场，宽基指数配置机会大于风险。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投

资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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合规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22177 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 1000 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	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
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。

	<p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们</p>

	应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证 1000 ETF 基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,094,850.07	2,630,492.59
结算备付金		303,884.41	116,114.91
存出保证金		408,001.06	233,023.04
交易性金融资产	7.4.7.2	136,056,061.71	155,413,737.80
其中：股票投资		136,011,358.63	155,346,073.54
基金投资		-	-
债券投资		44,703.08	67,664.26
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		228,716.81	659,325.41

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		140,091,514.06	159,052,693.75
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		870.40	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	768,405.65
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		60,234.05	71,513.52
应付托管费		12,046.83	14,302.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	451,621.56	1,179,580.00
负债合计		524,772.84	2,033,802.40
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	144,102,182.00	156,602,182.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-4,535,440.78	416,709.35
净资产合计		139,566,741.22	157,018,891.35
负债和净资产总计		140,091,514.06	159,052,693.75

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9685 元，基金份额总额 144,102,182.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
一、营业总收入		789,212.25	-23,495,243.78
1. 利息收入		53,377.31	35,974.00
其中：存款利息收入	7.4.7.13	53,377.31	35,974.00

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,290,885.46	-9,241,519.10
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-2,802,442.23	-10,012,555.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	122,867.64	84,087.07
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-61.62	-
股利收益	7.4.7.19	1,388,750.75	686,948.88
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	1,621,058.78	-15,109,185.43
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	405,661.62	819,486.75
减：二、营业总支出		1,196,663.20	1,018,835.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	713,885.95	565,695.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	142,777.16	113,139.24
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.09	0.12
8. 其他费用	7.4.7.23	340,000.00	340,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-407,450.95	-24,514,078.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-407,450.95	-24,514,078.93
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		-407,450.95	-24,514,078.93

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,500,000.00	-	-4,952,150.13	-17,452,150.13
（一）、综合收益总额	-	-	-407,450.95	-407,450.95
（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）	-12,500,000.00	-	-4,544,699.18	-17,044,699.18
其中：1. 基金申购款	195,000,000.00	-	4,446,399.17	199,446,399.17
2. 基金赎回款	-207,500,000.00	-	-8,991,098.35	-216,491,098.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	144,102,182.00	-	-4,535,440.78	139,566,741.22
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022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	42,602,182.00	-	11,369,176.62	53,971,358.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	42,602,182.00	-	11,369,176.62	53,971,358.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	114,000,000.00	-	-10,952,467.27	103,047,532.73
(一)、综合收益总额	-	-	-24,514,078.93	-24,514,078.93
(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)	114,000,000.00	-	13,561,611.66	127,561,611.66
其中：1. 基金申购款	291,000,000.00	-	24,491,049.96	315,491,049.96
2. 基金赎回款	-177,000,000.00	-	-10,929,438.30	-187,929,438.30
(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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35

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

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 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[2021]第 235 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《华泰柏瑞中证 1000 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 222,600,550.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0294 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,602,182.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,632.00 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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]118 号核准,本基金 222,602,182.00 份基金份额于 2021 年 3 月 24 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;本基金参与融资业务时,在任何交易日日终,持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争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。本基金的业绩比较基准为中

证 1000 指数收益率。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征:(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利,这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配;基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估,基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上,方可对超额收益进行分配;本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%,基金收益分配每年至多 4 次;若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股

票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	3,094,850.07	2,630,492.59
等于：本金	3,093,343.08	2,629,045.00
加：应计利息	1,506.99	1,447.59
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	3,094,850.07	2,630,492.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	145,690,236.23	-	136,011,358.63	-9,678,877.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	44,700.00	3.08	44,703.08	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	44,700.00	3.08	44,703.08	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		145,734,936.23	3.08	136,056,061.71	-9,678,877.60
项目	上年度末 2022年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		166,696,623.92	-	155,346,073.54	-11,350,550.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	63,200.00	10.26	67,664.26	4,454.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	63,200.00	10.26	67,664.26	4,454.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		166,759,823.92	10.26	155,413,737.80	-11,346,096.38

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 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	2,384,800.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,384,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,384,800.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义	公允价值		备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

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
IM2403	中证1000股指期货 2403	2.00	2,338,640.00	-46,160.00
合计				-46,160.00
减：可抵销期货暂收款				-46,160.00
净额				-

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投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	99,896.45	142,727.12
其中：交易所市场	99,896.45	142,727.12
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	230,000.00	210,000.00
应退退补款	121,725.11	826,852.88
合计	451,621.56	1,179,580.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,602,182.00	156,602,182.00
本期申购	195,000,000.00	195,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-207,500,000.00	-207,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	144,102,182.00	144,102,182.00
-----	----------------	----------------

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

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,561,495.02	-3,144,785.67	416,709.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,561,495.02	-3,144,785.67	416,709.35
本期利润	-2,028,509.73	1,621,058.78	-407,450.95
本期基金份额交易产生的变动数	-625,343.47	-3,919,355.71	-4,544,699.18
其中：基金申购款	4,312,182.24	134,216.93	4,446,399.17
金赎回款	-4,937,525.71	-4,053,572.64	-8,991,098.35
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	907,641.82	-5,443,082.60	-4,535,440.78

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	47,507.56	31,038.25
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	3,406.96	3,344.08
其他	2,462.79	1,591.67
合计	53,377.31	35,974.00

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-445,599.03	-7,534,160.12
股票投资收益——赎回差价收入	-2,356,843.20	-2,478,394.93
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	-2,802,442.23	-10,012,555.05

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	174,434,427.83	157,331,260.21
减：卖出股票成本总额	174,389,977.34	164,293,587.11
减：交易费用	490,049.52	571,833.22
买卖股票差价收	-445,599.03	-7,534,160.12

入		
---	--	--

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
赎回基金份额对价总额	216,491,098.35	187,929,438.30
减：现金支付赎回款总额	141,356,280.35	122,086,189.30
减：赎回股票成本总额	77,491,661.20	68,321,643.93
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-2,356,843.20	-2,478,394.93

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	89.53	90.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	122,778.11	83,997.05
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	122,867.64	84,087.07

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	574,998.65	409,893.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	452,100.00	325,800.00
减：应计利息总额	97.53	81.77
减：交易费用	23.01	14.46
买卖债券差价收入	122,778.11	83,997.05

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：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-61.62	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利 收益	1,388,750.75	686,948.88
其中：证券出借权益补 偿收入	-	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	1,388,750.75	686,948.88

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,667,218.78	-15,108,852.43
股票投资	1,671,672.78	-15,111,706.43
债券投资	-4,454.00	2,854.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-46,160.00	-
权证投资	-	-
期货投资	-46,160.00	-
3. 其他	-	-333.00
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,621,058.78	-15,109,185.43

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	405,661.62	819,486.75
合计	405,661.62	819,486.75

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

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
注册登记费	150,000.00	150,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00	20,000.00
合计	340,000.00	340,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、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
------------------------	--------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 (%)
招商证券	340,771,177.20	100.00	403,174,430.29	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年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 (%)
招商证券	316,502.74	100.00	99,896.45	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 (%)
招商证券	371,862.52	100.00	142,727.12	100.00

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	713,885.95	565,695.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,124.46	5,365.77
应支付基金管理人的净管理费	699,761.49	560,330.02

注：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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	142,777.16	113,139.24

注：支付基金托管人招商证券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：

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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 (%)
华泰证券股份 有限公司	3,172,400.00	2.2015	1,400,462.00	0.8943

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年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	127100	神码转债	网上配售	217	21,700.00
华泰联合证券	113674	华设转债	网上配售	60	6,000.00
华泰联合证券	123208	孩王转债	网上配售	66	6,600.00
华泰联合证券	123188	水羊转债	网上配售	98	9,800.00
华泰联合证券	127084	柳工转2	网上配售	361	36,100.00
华泰联合证券	113666	爱玛转债	网上配售	140	14,000.00
招商证券	113679	芯能转债	网上配售	110	11,000.00
招商证券	127088	赫达转债	网上配售	58	5,800.00
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	3,582	58,171.68
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	603137	恒尚节能	网下申购	1,156	18,380.40
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	2,667	55,793.64
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	18,353	104,428.57
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	6,747	74,891.70
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	1,313	55,736.85
华泰联合证券	301487	盟固利	网下申购	5,984	31,834.88
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	1,968	37,785.60
华泰联合证券	688602	康鹏科技	网下申购	2,752	23,832.32
华泰联合证券	301421	波长光电	网下申购	1,264	37,136.32
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	3,683	32,778.70
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,009	33,549.25
招商证券	301428	世纪恒通	网下申购	1,430	37,680.50
招商证券	301305	朗坤环境	网下申购	2,549	64,362.25
招商证券	688610	埃科光电	网下申购	759	55,657.47
上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	496	19,309.28
华泰联合证券	688351	微电生理	网下申购	4,925	81,311.75
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35
华泰联合证券	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合证券	301339	通行宝	网下申购	4,043	75,927.54
华泰联合证券	301327	华宝新能	网下申购	725	172,187.50
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	1,100	53,856.00
华泰联合证券	301290	东星医疗	网下申购	1,711	75,437.99
华泰联合证券	301277	新天地	网下申购	2,311	62,397.00
华泰联合证券	123145	药石转债	网上配售	98	9,800.00
华泰联合证券	113650	博22转债	网上配售	40	4,000.00
招商证券	110091	合力转债	网上配售	370	37,000.00
招商证券	000065	北方国际	网上配售	900	4,644.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定期内	12.05	19.92	122	1,470.10	2,430.24	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定期内	53.63	75.36	22	1,179.86	1,657.92	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定期内	41.18	48.64	44	1,811.92	2,140.16	-
001358	兴	2023	6个月	新股	41.00	44.16	39	1,599.00	1,722.24	-

	欣新材	年 12 月 14 日		锁定期内						
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	31.33	38.16	151	4,730.83	5,762.16	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	25.82	31.80	120	3,098.40	3,816.00	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	28.88	34.59	106	3,061.28	3,666.54	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	36.90	50.85	91	3,357.90	4,627.35	-
301272	英华特	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	51.39	53.38	73	3,751.47	3,896.74	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	38.13	28.36	222	8,464.86	6,295.92	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	19.99	19.35	253	5,057.47	4,895.55	-
301329	信音电子	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股锁定期内	21.00	22.23	170	3,570.00	3,779.10	-
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	18.08	44.57	196	3,543.68	8,735.72	-
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	55.68	37.58	61	3,396.48	2,292.38	-
301381	赛维时代	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股锁定期内	20.45	29.69	255	5,214.75	7,570.95	-

301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定期内	67.68	59.37	56	3,790.08	3,324.72	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定期内	33.25	58.19	101	3,358.25	5,877.19	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定期内	29.38	59.37	127	3,731.26	7,539.99	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定期内	37.96	30.39	115	4,365.40	3,494.85	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	31.90	39.84	103	3,285.70	4,103.52	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期内	57.66	47.25	92	5,304.72	4,347.00	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股锁定期内	5.32	40.96	599	3,186.68	24,535.04	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期内	39.78	69.09	124	4,932.72	8,567.16	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	41.66	64.11	59	2,457.94	3,782.49	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股锁定期内	39.99	38.81	100	3,999.00	3,881.00	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股锁定期内	19.50	28.93	169	3,295.50	4,889.17	-
301500	飞	2023	6个月	新股	23.97	20.89	125	2,996.25	2,611.25	-

	南资源	年9月 13日		锁定期内						
301505	苏州规划	2023 年7月 12日	6个月	新股 锁定期内	26.35	35.81	97	2,555.95	3,473.57	-
301507	民生健康	2023 年8月 24日	6个月	新股 锁定期内	10.00	15.85	236	2,360.00	3,740.60	-
301508	中机认检	2023 年11 月23 日	6个月	新股 锁定期内	16.82	26.68	179	3,010.78	4,775.72	-
301509	金凯生科	2023 年7月 26日	6个月	新股 锁定期内	56.56	62.23	57	3,223.92	3,547.11	-
301510	固高科技	2023 年8月 4日	6个月	新股 锁定期内	12.00	35.01	224	2,688.00	7,842.24	-
301515	港通医疗	2023 年7月 13日	6个月	新股 锁定期内	31.16	28.27	81	2,523.96	2,289.87	-
301516	中远通	2023 年12 月1日	6个月	新股 锁定期内	6.87	15.51	397	2,727.39	6,157.47	-
301517	陕西华达	2023 年10 月9日	6个月	新股 锁定期内	26.87	43.69	69	1,854.03	3,014.61	-
301518	长华化学	2023 年7月 26日	6个月	新股 锁定期内	25.75	23.01	126	3,244.50	2,899.26	-
301520	万邦医药	2023 年9月 18日	6个月	新股 锁定期内	67.88	52.74	45	3,054.60	2,373.30	-
301526	国际	2023 年12	6个月	新股 锁定	2.66	4.45	2,185	5,812.10	9,723.25	-

	复材	月 19 日		期内						
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	36.60	37.88	70	2,562.00	2,651.60	-
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	29.50	33.16	109	3,215.50	3,614.44	-
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	66.80	58.99	39	2,605.20	2,300.61	-
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	37.56	43.57	70	2,629.20	3,049.90	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	22.88	32.44	131	2,997.28	4,249.64	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	7.33	13.40	373	2,734.09	4,998.20	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	24.22	18.24	124	3,003.28	2,261.76	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	8.90	22.14	369	3,284.10	8,169.66	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	23.23	35.58	116	2,694.68	4,127.28	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	48.94	68.32	70	3,425.80	4,782.40	-
603004	鼎龙	2023 年 12	6 个月	新股锁定	16.80	31.19	73	1,226.40	2,276.87	-

	科技	月 20 日		期内						
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.10	34.75	57	1,088.70	1,980.75	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	78.99	60.49	79	6,240.21	4,778.71	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	26.74	38.67	164	4,385.36	6,341.88	-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	8.66	11.06	276	2,390.16	3,052.56	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	55.00	74.14	66	3,630.00	4,893.24	-
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	73.33	51.00	76	5,573.08	3,876.00	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	46.77	87.72	70	3,273.90	6,140.40	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博 23 转债	2023 年 12 月 22 日	1 个月	配债未上市	100.00	100.01	230	23,001.51	23,001.51	-
127100	神码转债	2023 年 12 月 21 日	1 个月	配债未上市	100.00	100.01	217	21,701.57	21,701.57	-

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
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大事项	8.48	2024年1月10日	9.33	15,910	155,522.89	134,916.80	-
000801	四川九洲	2023年12月21日	重大事项	7.70	2024年1月5日	8.47	14,000	106,700.18	107,800.00	-
688337	普源精电	2023年12月25日	重要事项未公告	43.87	2024年1月9日	41.72	1,518	77,356.10	66,594.66	-

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于交通银行的托管账户，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03% (2022 年 12 月 31 日：0.04%)。

7.4.13.3 流动性风险

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 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	3,094,850.07	-	-	-	-	-	3,094,850.07
结算备付金	303,884.41	-	-	-	-	-	303,884.41
存出保证金	127,364.26	-	-	-	-	280,636.80	408,001.06
交易性金融资产	-	-	-	23,001.51	21,701.57	136,011,358.63	136,056,061.71
应收清算款	-	-	-	-	-	228,716.81	228,716.81
资产总计	3,526,098.74	-	-	23,001.51	21,701.57	136,520,712.24	140,091,514.06

负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	870.40	870.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	60,234.05	60,234.05
应付托管费	-	-	-	-	-	12,046.83	12,046.83
其他负债	-	-	-	-	-	451,621.56	451,621.56
负债总计	-	-	-	-	-	524,772.84	524,772.84
利率敏感度缺口	3,526,098.74	-	-	-23,001.51	21,701.57	135,995,939.40	139,566,741.22
上年度末 2022 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	2,630,492.59	-	-	-	-	-	2,630,492.59
结算备付金	116,114.91	-	-	-	-	-	116,114.91
存出保证金	233,023.04	-	-	-	-	-	233,023.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-67,664.26	155,346,073.54	155,413,737.80
应收清算款	-	-	-	-	-	659,325.41	659,325.41
资产总计	2,979,630.54	-	-	-	-67,664.26	156,005,398.95	159,052,693.75
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	71,513.52	71,513.52
应付托管费	-	-	-	-	-	14,302.70	14,302.70
应付清算款	-	-	-	-	-	768,405.65	768,405.65
应交税费	-	-	-	-	-	0.53	0.53
其他负债	-	-	-	-	-	1,179,580.00	1,179,580.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,033,802.40	2,033,802.40
利率敏感度缺口	2,979,630.54	-	-	-	-67,664.26	153,971,596.55	157,018,891.35

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03% (2022 年 12 月 31 日：0.04%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 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 2023年12月31日		上年度末 2022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	136,011,358.63	97.45	155,346,073.54	98.93
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	-870.40	0.00	-	-
合计	136,010,488.23	97.45	155,346,073.54	98.93

注：其他包含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	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	中证 1000 指数上升 5%	6,767,650.86	7,616,337.89

	中证 1000 指数下降 5%	-6,767,650.86	-7,616,337.89
--	--------------------	---------------	---------------

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	135,438,421.92	154,935,138.65
第二层次	354,014.54	85,702.30
第三层次	263,625.25	392,896.85
合计	136,056,061.71	155,413,737.80

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 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	-	392,896.85	392,896.85
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	617,183.59	617,183.59
转出第三层次	-	1,150,796.81	1,150,796.81
当期利得或损失总额	-	404,341.62	404,341.62
其中：计入损益的利得或损失	-	404,341.62	404,341.62
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	263,625.25	263,625.25
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	-	75,599.58	75,599.58
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	404,897.03	404,897.03
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-12,000.18	-12,000.18
其中：计入损益的利得或损失	-	-12,000.18	-12,000.18
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	392,896.85	392,896.85
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	-	-12,000.18	-12,000.18

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，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	263,625.25	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1969~2.1752	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	392,896.85	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 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 2023 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 199,446,399.17 元(2022 年度：315,491,049.96 元)，其中包括以股票支付的申购款 58,057,132.05 元和以现金支付的申购款 141,389,267.12 元(2022 年度：其中包括以股票支付的申购款 99,574,503.00 元和以现金支付的申购款 215,916,546.96 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	136,011,358.63	97.09
	其中：股票	136,011,358.63	97.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,703.08	0.03
	其中：债券	44,703.08	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,398,734.48	2.43
8	其他各项资产	636,717.87	0.45
9	合计	140,091,514.06	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,043,451.40	0.75
B	采矿业	4,239,458.00	3.04
C	制造业	87,924,291.29	63.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,658,948.90	2.62
E	建筑业	2,644,310.00	1.89
F	批发和零售业	4,758,624.11	3.41
G	交通运输、仓储和邮政业	2,866,175.55	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,639,991.64	11.21
J	金融业	3,858,470.90	2.76
K	房地产业	2,486,843.00	1.78
L	租赁和商务服务业	1,561,364.20	1.12
M	科学研究和技术服务业	1,500,153.96	1.07

N	水利、环境和公共设施管理业	1,123,086.60	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	560,723.50	0.40
R	文化、体育和娱乐业	1,726,091.00	1.24
S	综合	85,434.00	0.06
	合计	135,677,418.05	97.21

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	310,576.88	0.22
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	4,998.20	0.00
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	5,762.16	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,980.75	0.00
M	科学研究和技术服务业	10,622.59	0.01
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	333,940.58	0.24

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	601099	太平洋	151,800	561,660.00	0.40
2	002436	兴森科技	37,700	555,321.00	0.40
3	002176	江特电机	38,100	514,350.00	0.37
4	002456	欧菲光	58,000	505,180.00	0.36
5	002405	四维图新	53,100	472,590.00	0.34
6	600777	新潮能源	151,500	463,590.00	0.33
7	300339	润和软件	17,800	462,444.00	0.33
8	300054	鼎龙股份	16,800	406,560.00	0.29
9	688617	惠泰医疗	1,025	398,212.50	0.29
10	300573	兴齐眼药	2,180	397,457.60	0.28
11	600872	中炬高新	14,000	393,400.00	0.28
12	300002	神州泰岳	43,700	386,745.00	0.28
13	300567	精测电子	4,400	385,528.00	0.28
14	600100	同方股份	52,200	383,670.00	0.27
15	000818	航锦科技	12,200	382,836.00	0.27
16	603179	新泉股份	7,400	375,254.00	0.27
17	600559	老白干酒	16,400	369,820.00	0.26
18	688017	绿的谐波	2,276	349,366.00	0.25
19	688235	百济神州	2,506	348,434.24	0.25
20	603087	甘李药业	6,600	347,490.00	0.25
21	300803	指南针	5,600	337,456.00	0.24
22	002261	拓维信息	22,400	336,896.00	0.24
23	002126	银轮股份	17,900	334,193.00	0.24
24	300346	南大光电	11,900	328,559.00	0.24
25	601567	三星医疗	15,800	323,900.00	0.23
26	000034	神州数码	10,600	317,046.00	0.23
27	300315	掌趣科技	61,500	316,725.00	0.23
28	603005	晶方科技	14,400	316,224.00	0.23
29	605589	圣泉集团	14,000	313,320.00	0.22
30	688327	云从科技	18,487	311,690.82	0.22
31	300459	汤姆猫	62,600	309,244.00	0.22
32	603979	金诚信	8,100	305,856.00	0.22
33	002318	久立特材	15,300	304,164.00	0.22
34	600711	盛屯矿业	69,700	302,498.00	0.22
35	600771	广誉远	11,100	299,589.00	0.21
36	002402	和而泰	20,800	297,232.00	0.21

37	688050	爱博医疗	1,710	294,188.40	0.21
38	002389	航天彩虹	15,600	290,160.00	0.21
39	300765	新诺威	7,920	290,030.40	0.21
40	688333	铂力特	2,439	282,680.10	0.20
41	688037	芯源微	2,110	281,917.10	0.20
42	600363	联创光电	8,200	278,800.00	0.20
43	300456	赛微电子	11,500	276,460.00	0.20
44	600728	佳都科技	47,800	273,416.00	0.20
45	002675	东诚药业	14,900	273,117.00	0.20
46	002145	中核钛白	60,290	270,099.20	0.19
47	000403	派林生物	9,900	269,676.00	0.19
48	600201	生物股份	25,000	269,250.00	0.19
49	000762	西藏矿业	9,400	268,840.00	0.19
50	002151	北斗星通	8,500	268,430.00	0.19
51	688639	华恒生物	2,062	259,605.80	0.19
52	688088	虹软科技	6,321	259,413.84	0.19
53	002212	天融信	26,500	259,170.00	0.19
54	688213	思特威	4,623	256,853.88	0.18
55	600641	万业企业	14,700	253,722.00	0.18
56	002221	东华能源	24,600	253,380.00	0.18
57	300476	胜宏科技	13,600	250,920.00	0.18
58	600422	昆药集团	12,000	250,320.00	0.18
59	603728	鸣志电器	3,800	250,230.00	0.18
60	600595	中孚实业	71,300	248,124.00	0.18
61	300068	南都电源	19,100	247,154.00	0.18
62	000860	顺鑫农业	11,600	246,964.00	0.18
63	300666	江丰电子	4,200	246,036.00	0.18
64	688608	恒玄科技	1,592	245,597.84	0.18
65	002317	众生药业	15,300	245,565.00	0.18
66	002837	英维克	8,880	244,022.40	0.17
67	002036	联创电子	23,800	242,998.00	0.17
68	688556	高测股份	6,231	242,946.69	0.17
69	601677	明泰铝业	21,360	242,222.40	0.17
70	601975	招商南油	86,500	242,200.00	0.17
71	002312	川发龙蟒	33,800	241,670.00	0.17
72	300182	捷成股份	47,500	241,300.00	0.17
73	002832	比音勒芬	7,600	240,920.00	0.17
74	300679	电连技术	5,800	240,700.00	0.17
75	688110	东芯股份	6,872	236,602.96	0.17
76	600330	天通股份	27,400	236,462.00	0.17
77	300777	中简科技	7,900	235,657.00	0.17
78	601375	中原证券	61,500	235,545.00	0.17
79	600685	中船防务	9,200	235,060.00	0.17

80	300775	三角防务	8,400	234,360.00	0.17
81	300101	振芯科技	10,200	232,866.00	0.17
82	688166	博瑞医药	6,635	232,225.00	0.17
83	601001	晋控煤业	18,800	231,804.00	0.17
84	300633	开立医疗	4,900	231,770.00	0.17
85	300298	三诺生物	7,600	231,040.00	0.17
86	600312	平高电气	18,200	230,958.00	0.17
87	300036	超图软件	11,000	229,900.00	0.16
88	600667	太极实业	32,700	229,881.00	0.16
89	300294	博雅生物	6,800	229,024.00	0.16
90	300458	全志科技	10,000	226,900.00	0.16
91	300627	华测导航	7,300	226,446.00	0.16
92	002332	仙琚制药	17,700	226,029.00	0.16
93	002222	福晶科技	7,600	224,428.00	0.16
94	688598	金博股份	3,206	224,099.40	0.16
95	002015	协鑫能科	18,100	224,078.00	0.16
96	600552	凯盛科技	16,800	223,944.00	0.16
97	000426	兴业银锡	24,600	223,368.00	0.16
98	603236	移远通信	4,154	223,277.50	0.16
99	000686	东北证券	31,400	222,940.00	0.16
100	603300	华铁应急	34,820	222,848.00	0.16
101	600877	声光电科	15,900	222,441.00	0.16
102	600123	兰花科创	20,090	221,793.60	0.16
103	002851	麦格米特	9,000	221,400.00	0.16
104	688019	安集科技	1,381	220,628.56	0.16
105	002139	拓邦股份	22,600	220,576.00	0.16
106	002544	普天科技	10,800	219,456.00	0.16
107	002182	宝武镁业	11,100	218,226.00	0.16
108	000032	深桑达 A	10,300	218,154.00	0.16
109	600821	金开新能	35,600	217,872.00	0.16
110	002747	埃斯顿	11,700	217,503.00	0.16
111	603477	巨星农牧	5,800	217,326.00	0.16
112	002245	蔚蓝锂芯	25,500	217,260.00	0.16
113	002610	爱康科技	99,800	215,568.00	0.15
114	000690	宝新能源	48,500	214,855.00	0.15
115	688116	天奈科技	7,390	214,605.60	0.15
116	000921	海信家电	10,500	214,200.00	0.15
117	002617	露笑科技	34,300	212,660.00	0.15
118	688578	艾力斯	5,078	211,549.48	0.15
119	300762	上海瀚讯	14,020	211,421.60	0.15
120	600761	安徽合力	11,600	211,236.00	0.15
121	300034	钢研高纳	10,380	211,233.00	0.15
122	002727	一心堂	9,100	210,756.00	0.15

123	300229	拓尔思	12,500	210,750.00	0.15
124	002100	天康生物	24,000	210,480.00	0.15
125	002484	江海股份	13,100	210,386.00	0.15
126	002063	远光软件	34,000	210,120.00	0.15
127	002643	万润股份	12,600	209,034.00	0.15
128	300674	宇信科技	12,800	208,384.00	0.15
129	300482	万孚生物	6,900	208,173.00	0.15
130	300624	万兴科技	2,200	208,120.00	0.15
131	603298	杭叉集团	8,300	206,504.00	0.15
132	300475	香农芯创	6,100	206,119.00	0.15
133	601222	林洋能源	32,200	205,758.00	0.15
134	002698	博实股份	13,500	205,065.00	0.15
135	603129	春风动力	2,000	204,480.00	0.15
136	605111	新洁能	5,404	204,433.32	0.15
137	002424	贵州百灵	25,100	203,561.00	0.15
138	000503	国新健康	15,400	202,972.00	0.15
139	000528	柳工	30,100	202,874.00	0.15
140	000810	创维数字	12,900	202,659.00	0.15
141	002354	天娱数科	36,700	202,584.00	0.15
142	000676	智度股份	23,200	202,536.00	0.15
143	301308	江波龙	2,200	202,510.00	0.15
144	600572	康恩贝	40,100	202,505.00	0.15
145	300735	光弘科技	8,600	202,444.00	0.15
146	002541	鸿路钢构	9,300	202,089.00	0.14
147	002335	科华数据	7,300	202,064.00	0.14
148	300525	博思软件	13,500	201,420.00	0.14
149	600621	华鑫股份	14,300	201,201.00	0.14
150	600456	宝钛股份	6,400	200,896.00	0.14
151	300393	中来股份	19,400	200,596.00	0.14
152	600718	东软集团	21,500	198,875.00	0.14
153	688066	航天宏图	4,705	198,739.20	0.14
154	601965	中国汽研	9,000	198,540.00	0.14
155	600338	西藏珠峰	16,300	198,208.00	0.14
156	603063	禾望电气	7,900	197,500.00	0.14
157	002011	盾安环境	14,300	196,625.00	0.14
158	600452	涪陵电力	14,876	196,363.20	0.14
159	002123	梦网科技	17,600	196,240.00	0.14
160	600850	电科数字	9,020	196,185.00	0.14
161	601333	广深铁路	75,600	195,804.00	0.14
162	688278	特宝生物	3,737	195,631.95	0.14
163	605090	九丰能源	7,000	195,510.00	0.14
164	300075	数字政通	11,100	195,360.00	0.14
165	300638	广和通	10,260	195,247.80	0.14

166	000035	中国天楹	39,400	194,636.00	0.14
167	300672	国科微	3,300	194,502.00	0.14
168	300166	东方国信	20,600	193,640.00	0.14
169	300130	新国都	8,000	193,600.00	0.14
170	688007	光峰科技	7,474	193,427.12	0.14
171	002984	森麒麟	6,700	193,295.00	0.14
172	601678	滨化股份	45,900	193,239.00	0.14
173	600612	老凤祥	2,800	193,200.00	0.14
174	002567	唐人神	25,700	192,750.00	0.14
175	688266	泽璟制药	3,629	192,119.26	0.14
176	600908	无锡银行	38,000	191,900.00	0.14
177	000875	吉电股份	43,600	191,840.00	0.14
178	002396	星网锐捷	10,600	191,542.00	0.14
179	600633	浙数文化	17,300	191,338.00	0.14
180	600596	新安股份	20,860	190,243.20	0.14
181	002174	游族网络	16,600	190,236.00	0.14
182	600116	三峡水利	25,200	189,756.00	0.14
183	300083	创世纪	29,900	189,267.00	0.14
184	600072	中船科技	10,200	189,108.00	0.14
185	002276	万马股份	18,500	189,070.00	0.14
186	600323	瀚蓝环境	10,900	188,897.00	0.14
187	300379	东方通	10,300	188,284.00	0.13
188	600587	新华医疗	7,300	188,267.00	0.13
189	600273	嘉化能源	21,900	188,121.00	0.13
190	600483	福能股份	22,650	187,315.50	0.13
191	603027	千禾味业	11,520	186,278.40	0.13
192	603197	保隆科技	3,300	186,120.00	0.13
193	002249	大洋电机	37,200	184,884.00	0.13
194	300188	国投智能	11,500	184,230.00	0.13
195	300323	华灿光电	25,000	183,000.00	0.13
196	603505	金石资源	6,736	182,882.40	0.13
197	601918	新集能源	34,600	182,342.00	0.13
198	600185	格力地产	25,200	182,196.00	0.13
199	601399	国机重装	64,300	181,969.00	0.13
200	600916	中国黄金	18,400	181,608.00	0.13
201	300079	数码视讯	31,900	181,511.00	0.13
202	688596	正帆科技	4,580	181,505.40	0.13
203	002183	怡亚通	40,500	181,440.00	0.13
204	300451	创业慧康	27,700	181,435.00	0.13
205	002099	海翔药业	25,200	181,188.00	0.13
206	603108	润达医疗	8,900	181,115.00	0.13
207	688167	炬光科技	1,583	180,462.00	0.13
208	300170	汉得信息	21,700	180,327.00	0.13

209	300747	锐科激光	7,650	180,004.50	0.13
210	601208	东材科技	14,500	179,510.00	0.13
211	603588	高能环境	27,440	179,457.60	0.13
212	002706	良信股份	20,300	179,249.00	0.13
213	688016	心脉医疗	915	178,086.45	0.13
214	603599	广信股份	12,260	177,770.00	0.13
215	601212	白银有色	66,000	177,540.00	0.13
216	300303	聚飞光电	29,900	177,307.00	0.13
217	603083	剑桥科技	4,700	177,284.00	0.13
218	600395	盘江股份	28,700	177,079.00	0.13
219	000415	渤海租赁	82,600	176,764.00	0.13
220	002351	漫步者	10,000	176,700.00	0.13
221	600285	羚锐制药	10,300	176,233.00	0.13
222	300236	上海新阳	5,000	176,100.00	0.13
223	600110	诺德股份	31,200	175,968.00	0.13
224	688139	海尔生物	4,336	175,694.72	0.13
225	600933	爱柯迪	8,000	175,520.00	0.13
226	600750	江中药业	8,400	175,392.00	0.13
227	000951	中国重汽	13,100	175,016.00	0.13
228	002292	奥飞娱乐	20,000	175,000.00	0.13
228	301035	润丰股份	2,500	175,000.00	0.13
229	000821	京山轻机	11,000	174,790.00	0.13
230	300655	晶瑞电材	17,920	174,361.60	0.12
231	300133	华策影视	29,700	174,339.00	0.12
232	603393	新天然气	5,700	174,249.00	0.12
233	600267	海正药业	18,600	174,096.00	0.12
234	603997	继峰股份	12,900	173,763.00	0.12
235	000917	电广传媒	31,700	173,716.00	0.12
236	002400	省广集团	31,300	173,715.00	0.12
237	300327	中颖电子	7,600	173,280.00	0.12
238	000923	河钢资源	10,300	173,040.00	0.12
239	000422	湖北宜化	16,500	172,590.00	0.12
240	600446	金证股份	14,900	172,393.00	0.12
241	300432	富临精工	16,400	172,200.00	0.12
242	002807	江阴银行	48,500	172,175.00	0.12
243	002020	京新药业	13,500	171,720.00	0.12
244	300773	拉卡拉	10,700	171,628.00	0.12
245	300232	洲明科技	19,500	171,600.00	0.12
246	000012	南玻 A	30,700	170,999.00	0.12
247	300035	中科电气	16,200	170,748.00	0.12
248	002091	江苏国泰	21,800	170,694.00	0.12
249	002745	木林森	19,700	170,602.00	0.12
250	603279	景津装备	7,700	170,247.00	0.12

251	002130	沃尔核材	22,500	169,875.00	0.12
252	600057	厦门象屿	25,300	169,763.00	0.12
253	002127	南极电商	43,600	169,604.00	0.12
254	002446	盛路通信	20,400	169,320.00	0.12
255	002737	葵花药业	6,500	168,870.00	0.12
256	600037	歌华有线	21,800	168,514.00	0.12
257	300343	联创股份	25,500	168,300.00	0.12
258	600645	中源协和	8,300	168,241.00	0.12
259	300226	上海钢联	5,900	168,091.00	0.12
260	688568	中科星图	3,421	167,834.26	0.12
261	600602	云赛智联	14,500	167,765.00	0.12
262	688033	天宜上佳	9,923	167,698.70	0.12
263	300693	盛弘股份	5,600	167,496.00	0.12
264	000902	新洋丰	14,700	167,433.00	0.12
265	300185	通裕重工	69,400	166,560.00	0.12
266	002597	金禾实业	7,600	166,516.00	0.12
267	300123	亚光科技	22,700	166,391.00	0.12
268	601519	大智慧	22,500	166,050.00	0.12
269	002701	奥瑞金	40,100	166,014.00	0.12
270	002906	华阳集团	4,700	165,675.00	0.12
271	300027	华谊兄弟	61,700	165,356.00	0.12
272	601860	紫金银行	65,300	165,209.00	0.12
273	000650	仁和药业	24,900	165,087.00	0.12
274	600179	安通控股	66,000	165,000.00	0.12
275	002085	万丰奥威	33,400	164,996.00	0.12
276	600206	有研新材	13,300	164,787.00	0.12
277	300065	海兰信	16,200	164,754.00	0.12
278	002079	苏州固锝	14,600	164,688.00	0.12
279	601137	博威合金	10,600	164,618.00	0.12
280	002004	华邦健康	35,300	164,498.00	0.12
281	002239	奥特佳	50,600	164,450.00	0.12
282	603678	火炬电子	6,200	164,114.00	0.12
283	600120	浙江东方	45,700	164,063.00	0.12
284	002038	双鹭药业	16,100	164,059.00	0.12
285	000681	视觉中国	11,100	163,170.00	0.12
286	600331	宏达股份	31,800	163,134.00	0.12
287	301050	雷电微力	2,800	163,128.00	0.12
288	600976	健民集团	2,500	163,125.00	0.12
289	600216	浙江医药	15,200	163,096.00	0.12
290	600064	南京高科	27,000	163,080.00	0.12
291	002324	普利特	12,400	163,060.00	0.12
292	688106	金宏气体	6,753	162,679.77	0.12
293	000727	冠捷科技	60,600	162,408.00	0.12

294	600055	万东医疗	9,500	162,260.00	0.12
295	600993	马应龙	6,700	162,006.00	0.12
296	688270	臻镭科技	2,369	161,992.22	0.12
297	002649	博彦科技	13,200	161,964.00	0.12
298	688262	国芯科技	5,509	161,634.06	0.12
299	002219	新里程	53,200	161,196.00	0.12
300	002777	久远银海	6,400	160,704.00	0.12
301	600601	方正科技	55,600	160,684.00	0.12
302	300457	赢合科技	8,700	160,428.00	0.11
303	000811	冰轮环境	11,800	160,126.00	0.11
304	600557	康缘药业	7,800	160,056.00	0.11
305	688083	中望软件	1,605	159,761.70	0.11
306	000543	皖能电力	25,200	157,752.00	0.11
307	603306	华懋科技	5,800	157,238.00	0.11
308	002291	遥望科技	16,700	156,646.00	0.11
309	600864	哈投股份	27,500	156,475.00	0.11
310	002171	楚江新材	20,900	156,332.00	0.11
311	300630	普利制药	6,900	156,078.00	0.11
312	600259	广晟有色	4,400	155,980.00	0.11
313	300332	天壕能源	19,600	155,820.00	0.11
314	688518	联赢激光	7,600	155,648.00	0.11
315	603690	至纯科技	6,040	155,228.00	0.11
316	002416	爱施德	16,700	155,143.00	0.11
317	300841	康华生物	2,000	155,080.00	0.11
318	603308	应流股份	10,800	154,764.00	0.11
319	300687	赛意信息	7,100	154,638.00	0.11
320	600252	中恒集团	61,500	154,365.00	0.11
321	300685	艾德生物	7,000	153,860.00	0.11
322	603565	中谷物流	18,685	153,777.55	0.11
323	600562	国睿科技	11,100	153,624.00	0.11
324	688388	嘉元科技	7,574	153,600.72	0.11
325	600577	精达股份	37,100	153,594.00	0.11
326	688739	成大生物	4,714	153,252.14	0.11
327	688700	东威科技	2,511	153,221.22	0.11
328	000829	天音控股	16,000	152,640.00	0.11
329	002421	达实智能	47,300	152,306.00	0.11
330	000851	高鸿股份	25,900	152,033.00	0.11
331	002773	康弘药业	8,200	151,208.00	0.11
332	600409	三友化工	27,500	150,975.00	0.11
333	600971	恒源煤电	13,500	150,525.00	0.11
334	601890	亚星锚链	15,200	150,480.00	0.11
335	600797	浙大网新	22,900	150,224.00	0.11
336	300077	国民技术	13,300	150,157.00	0.11

337	002839	张家港行	38,700	150,156.00	0.11
338	002539	云图控股	18,200	150,150.00	0.11
339	300113	顺网科技	10,700	149,800.00	0.11
340	300398	飞凯材料	9,500	149,720.00	0.11
341	300171	东富龙	8,300	149,317.00	0.11
342	002985	北摩高科	4,300	149,124.00	0.11
343	000555	神州信息	13,200	149,028.00	0.11
344	600586	金晶科技	22,300	148,964.00	0.11
345	600246	万通发展	22,900	148,621.00	0.11
346	600328	中盐化工	18,960	148,267.20	0.11
347	000712	锦龙股份	10,100	148,167.00	0.11
348	300910	瑞丰新材	3,220	147,926.80	0.11
349	600459	贵研铂业	10,300	147,908.00	0.11
350	600420	国药现代	15,100	147,829.00	0.11
351	600151	航天机电	22,400	147,616.00	0.11
352	601908	京运通	32,300	147,611.00	0.11
353	000969	安泰科技	16,400	147,436.00	0.11
354	600320	振华重工	44,400	147,408.00	0.11
355	000582	北部湾港	19,600	147,196.00	0.11
356	300827	上能电气	4,859	147,033.34	0.11
357	688575	亚辉龙	6,425	146,939.75	0.11
358	688023	安恒信息	1,325	146,929.25	0.11
359	600782	新钢股份	42,100	146,929.00	0.11
360	603033	三维股份	9,293	146,922.33	0.11
361	688321	微芯生物	6,661	146,208.95	0.10
362	300463	迈克生物	9,700	146,179.00	0.10
363	600266	城建发展	30,200	146,168.00	0.10
364	600478	科力远	29,707	146,158.44	0.10
365	601777	力帆科技	40,700	145,706.00	0.10
366	300319	麦捷科技	15,100	145,564.00	0.10
367	600986	浙文互联	26,600	145,236.00	0.10
368	300406	九强生物	7,600	145,160.00	0.10
369	300416	苏试试验	7,900	145,123.00	0.10
370	600063	皖维高新	33,700	144,910.00	0.10
371	600225	卓朗科技	38,100	144,780.00	0.10
372	002583	海能达	24,300	144,585.00	0.10
373	002428	云南锗业	11,700	144,261.00	0.10
374	300271	华宇软件	17,600	144,144.00	0.10
374	600740	山西焦化	28,600	144,144.00	0.10
375	000682	东方电子	17,900	144,095.00	0.10
376	000685	中山公用	19,700	144,007.00	0.10
377	000927	中国铁物	53,800	143,646.00	0.10
378	002840	华统股份	6,900	143,451.00	0.10

379	600556	天下秀	24,200	143,022.00	0.10
380	300366	创意信息	10,900	143,008.00	0.10
381	002467	二六三	30,800	142,912.00	0.10
382	600507	方大特钢	31,000	142,910.00	0.10
383	600963	岳阳林纸	24,100	141,949.00	0.10
384	002048	宁波华翔	10,900	141,809.00	0.10
385	300725	药石科技	3,600	141,372.00	0.10
386	002003	伟星股份	13,000	141,050.00	0.10
387	000049	德赛电池	5,190	140,752.80	0.10
388	688798	艾为电子	2,037	140,614.11	0.10
389	688322	奥比中光	3,740	140,549.20	0.10
390	000758	中色股份	31,200	140,400.00	0.10
391	688676	金盘科技	3,913	140,202.79	0.10
392	600688	上海石化	49,000	140,140.00	0.10
393	300260	新莱应材	4,600	139,978.00	0.10
394	300470	中密控股	3,700	139,860.00	0.10
395	000982	中银绒业	95,000	139,650.00	0.10
396	300180	华峰超纤	31,500	139,230.00	0.10
397	600775	南京熊猫	10,500	139,125.00	0.10
398	600720	祁连山	13,800	139,104.00	0.10
399	002237	恒邦股份	12,900	139,062.00	0.10
400	601718	际华集团	48,800	138,592.00	0.10
401	300593	新雷能	9,380	138,542.60	0.10
402	300085	银之杰	9,600	137,472.00	0.10
403	300031	宝通科技	7,400	137,196.00	0.10
404	600197	伊力特	6,300	137,025.00	0.10
405	600138	中青旅	12,900	136,998.00	0.10
406	002726	龙大美食	16,900	136,890.00	0.10
407	601200	上海环境	15,200	136,648.00	0.10
408	600211	西藏药业	2,800	136,640.00	0.10
409	300811	铂科新材	2,580	136,404.60	0.10
410	300738	奥飞数据	12,872	136,314.48	0.10
411	301155	海力风电	2,300	136,045.00	0.10
412	603348	文灿股份	3,500	135,800.00	0.10
413	300618	寒锐钴业	4,800	135,792.00	0.10
414	603919	金徽酒	5,500	135,410.00	0.10
415	600248	陕建股份	33,600	135,072.00	0.10
416	300348	长亮科技	13,100	135,061.00	0.10
417	688389	普门科技	5,994	134,924.94	0.10
418	000657	中钨高新	15,910	134,916.80	0.10
419	688289	圣湘生物	6,900	134,895.00	0.10
420	002390	信邦制药	30,300	134,532.00	0.10
421	000090	天健集团	29,200	134,320.00	0.10

422	300855	图南股份	4,440	134,088.00	0.10
423	600195	中牧股份	11,300	134,018.00	0.10
424	603323	苏农银行	32,200	133,952.00	0.10
425	600059	古越龙山	14,400	133,920.00	0.10
426	688158	优刻得	8,128	133,705.60	0.10
427	600366	宁波韵升	17,200	133,644.00	0.10
428	002081	金螳螂	35,500	133,480.00	0.10
429	601126	四方股份	9,400	133,104.00	0.10
430	600158	中体产业	17,100	133,038.00	0.10
431	600717	天津港	32,300	132,753.00	0.10
432	002216	三全食品	9,900	132,660.00	0.10
433	600578	京能电力	44,800	132,608.00	0.10
434	002217	合力泰	48,700	132,464.00	0.09
435	002458	益生股份	12,300	132,348.00	0.09
436	300151	昌红科技	7,200	132,336.00	0.09
437	688091	上海谊众	2,061	131,904.00	0.09
438	002233	塔牌集团	18,600	131,688.00	0.09
439	603128	华贸物流	17,800	131,542.00	0.09
440	688326	经纬恒润	1,130	131,136.50	0.09
441	002434	万里扬	17,600	131,120.00	0.09
442	600888	新疆众和	18,100	131,044.00	0.09
443	301031	中熔电气	1,000	130,760.00	0.09
444	002258	利尔化学	10,900	130,473.00	0.09
445	600635	大众公用	43,200	130,464.00	0.09
446	600869	远东股份	29,700	130,383.00	0.09
447	601019	山东出版	13,900	130,382.00	0.09
448	300623	捷捷微电	8,200	130,134.00	0.09
449	300109	新开源	7,200	129,888.00	0.09
450	600729	重庆百货	4,600	129,720.00	0.09
451	002215	诺普信	15,700	129,682.00	0.09
452	301239	普瑞眼科	1,500	129,000.00	0.09
453	300224	正海磁材	11,000	128,920.00	0.09
454	300203	聚光科技	8,100	128,385.00	0.09
455	601858	中国科传	5,200	128,284.00	0.09
456	600675	中华企业	40,700	128,205.00	0.09
457	600428	中远海特	23,900	128,104.00	0.09
458	600295	鄂尔多斯	13,200	128,040.00	0.09
459	002488	金固股份	17,800	127,804.00	0.09
460	688789	宏华数科	1,278	127,684.98	0.09
461	600210	紫江企业	27,100	127,370.00	0.09
462	000420	吉林化纤	43,700	127,167.00	0.09
463	301095	广立微	1,700	127,041.00	0.09
464	601952	苏垦农发	12,400	126,976.00	0.09

465	603566	普莱柯	5,600	126,840.00	0.09
466	002061	浙江交科	34,720	126,728.00	0.09
467	688123	聚辰股份	2,067	126,562.41	0.09
468	002585	双星新材	15,600	126,516.00	0.09
469	600098	广州发展	23,500	126,195.00	0.09
470	000028	国药一致	4,340	125,816.60	0.09
471	603876	鼎胜新材	10,040	125,801.20	0.09
472	601311	骆驼股份	15,700	125,757.00	0.09
473	000065	北方国际	11,200	125,664.00	0.09
474	301015	百洋医药	3,500	125,510.00	0.09
475	688707	振华新材	6,111	125,275.50	0.09
476	000627	天茂集团	44,100	125,244.00	0.09
477	301153	中科江南	1,600	125,232.00	0.09
478	300087	荃银高科	14,940	125,197.20	0.09
479	002929	润建股份	3,000	125,190.00	0.09
480	600277	亿利洁能	47,600	125,188.00	0.09
481	603100	川仪股份	4,500	124,740.00	0.09
482	600502	安徽建工	26,800	124,620.00	0.09
483	301171	易点天下	6,300	124,551.00	0.09
484	601369	陕鼓动力	15,600	124,488.00	0.09
485	688192	迪哲医药	2,600	124,410.00	0.09
486	600360	华微电子	17,200	124,356.00	0.09
487	603985	恒润股份	5,000	124,250.00	0.09
488	002006	精工科技	8,100	123,768.00	0.09
489	000767	晋控电力	41,100	123,711.00	0.09
490	300158	振东制药	18,300	123,525.00	0.09
491	600125	铁龙物流	20,400	123,420.00	0.09
492	002060	粤水电	25,100	123,241.00	0.09
493	002453	华软科技	10,900	123,170.00	0.09
494	300352	北信源	25,900	123,025.00	0.09
495	002214	大立科技	10,700	122,729.00	0.09
496	002108	沧州明珠	29,800	122,478.00	0.09
497	002635	安洁科技	7,500	122,475.00	0.09
498	301219	腾远钴业	3,110	122,440.70	0.09
499	002191	劲嘉股份	22,800	122,436.00	0.09
500	002859	洁美科技	4,900	122,255.00	0.09
501	301039	中集车辆	13,000	121,940.00	0.09
502	600776	东方通信	10,800	121,932.00	0.09
503	603556	海兴电力	4,200	121,926.00	0.09
504	002537	海联金汇	18,300	121,878.00	0.09
505	600477	杭萧钢构	37,000	121,730.00	0.09
506	603881	数据港	6,140	121,694.80	0.09
507	000915	华特达因	4,200	121,632.00	0.09

508	600996	贵广网络	13,500	120,960.00	0.09
509	300723	一品红	4,050	120,811.50	0.09
510	600773	西藏城投	11,000	120,560.00	0.09
511	688366	昊海生科	1,112	120,418.48	0.09
512	000837	秦川机床	11,200	120,400.00	0.09
513	300428	立中集团	5,700	120,384.00	0.09
514	601702	华峰铝业	6,700	120,265.00	0.09
515	688027	国盾量子	940	120,226.00	0.09
516	300598	诚迈科技	2,800	120,204.00	0.09
517	002023	海特高新	13,200	120,120.00	0.09
518	300770	新媒股份	3,100	119,908.00	0.09
519	002948	青岛银行	39,300	119,865.00	0.09
520	002163	海南发展	13,200	119,856.00	0.09
521	002124	天邦食品	32,800	119,064.00	0.09
522	000735	罗牛山	20,600	118,862.00	0.09
523	300369	绿盟科技	12,600	118,818.00	0.09
524	002498	汉缆股份	29,700	118,800.00	0.09
525	002550	千红制药	20,200	118,776.00	0.09
526	300634	彩讯股份	5,800	118,726.00	0.09
527	300761	立华股份	5,660	118,690.20	0.09
528	603888	新华网	4,700	118,393.00	0.08
529	000488	晨鸣纸业	30,500	118,340.00	0.08
530	688408	中信博	1,649	118,315.75	0.08
531	603766	隆鑫通用	22,900	118,164.00	0.08
532	000059	华锦股份	21,400	117,486.00	0.08
533	600389	江山股份	6,750	117,450.00	0.08
534	000901	航天科技	12,600	117,432.00	0.08
535	600531	豫光金铅	19,400	117,370.00	0.08
536	002068	黑猫股份	10,100	117,160.00	0.08
537	603713	密尔克卫	2,200	117,062.00	0.08
538	600682	南京新百	15,200	117,040.00	0.08
539	300409	道氏技术	10,500	116,970.00	0.08
540	002250	联化科技	16,400	116,932.00	0.08
541	688400	凌云光	4,320	116,640.00	0.08
542	000989	九芝堂	11,500	116,380.00	0.08
543	300663	科蓝软件	8,200	115,948.00	0.08
544	600335	国机汽车	13,000	115,700.00	0.08
545	688559	海目星	3,239	115,632.30	0.08
546	301047	义翘神州	1,400	115,360.00	0.08
547	002254	泰和新材	7,700	115,192.00	0.08
548	600305	恒顺醋业	12,500	115,125.00	0.08
549	300233	金城医药	6,900	114,954.00	0.08
550	600480	凌云股份	12,600	114,786.00	0.08

551	600449	宁夏建材	6,400	114,752.00	0.08
552	002847	盐津铺子	1,650	114,642.00	0.08
553	300820	英杰电气	2,000	114,560.00	0.08
554	300263	隆华科技	16,200	114,048.00	0.08
555	002960	青鸟消防	8,230	113,903.20	0.08
556	603638	艾迪精密	7,000	113,750.00	0.08
557	301071	力量钻石	3,520	113,696.00	0.08
558	600811	东方集团	57,100	113,629.00	0.08
559	300587	天铁股份	19,451	113,593.84	0.08
560	601028	玉龙股份	10,600	113,526.00	0.08
561	601619	嘉泽新能	32,100	113,313.00	0.08
562	000848	承德露露	14,400	113,040.00	0.08
563	600017	日照港	41,100	113,025.00	0.08
564	603466	风语筑	7,850	112,883.00	0.08
565	688711	宏微科技	2,709	112,396.41	0.08
566	603612	索通发展	7,300	112,347.00	0.08
567	688339	亿华通	2,453	112,200.22	0.08
568	000756	新华制药	5,500	112,090.00	0.08
569	000928	中钢国际	19,200	111,936.00	0.08
570	300726	宏达电子	3,700	111,703.00	0.08
571	002612	朗姿股份	5,800	111,534.00	0.08
572	600966	博汇纸业	17,900	111,159.00	0.08
573	300261	雅本化学	14,900	111,154.00	0.08
574	002626	金达威	6,800	111,044.00	0.08
575	002349	精华制药	12,500	110,875.00	0.08
576	000990	诚志股份	13,500	110,835.00	0.08
577	688239	航宇科技	2,304	110,062.08	0.08
578	300671	富满微	3,400	109,922.00	0.08
579	600223	鲁商发展	11,400	109,782.00	0.08
580	603368	柳药集团	5,800	109,736.00	0.08
581	002101	广东鸿图	7,200	109,656.00	0.08
582	600496	精工钢构	35,900	109,495.00	0.08
583	605123	派克新材	1,200	109,440.00	0.08
584	600997	开滦股份	14,300	109,109.00	0.08
585	300613	富瀚微	2,570	109,070.80	0.08
586	300039	上海凯宝	16,400	109,060.00	0.08
587	000552	甘肃能化	35,700	108,885.00	0.08
588	600812	华北制药	19,100	108,870.00	0.08
589	600313	农发种业	14,600	108,770.00	0.08
590	301358	湖南裕能	3,200	108,640.00	0.08
591	600643	爱建集团	21,300	108,630.00	0.08
592	000966	长源电力	24,500	108,535.00	0.08
593	601528	瑞丰银行	21,870	108,256.50	0.08

594	600623	华谊集团	16,800	108,192.00	0.08
595	002243	力合科创	13,600	108,120.00	0.08
596	000801	四川九洲	14,000	107,800.00	0.08
596	603169	兰石重装	17,500	107,800.00	0.08
597	300869	康泰医学	5,200	107,276.00	0.08
598	688318	财富趋势	849	107,228.70	0.08
599	603567	珍宝岛	8,800	107,008.00	0.08
600	002158	汉钟精机	4,800	106,848.00	0.08
601	603595	东尼电子	2,900	106,691.00	0.08
602	002581	未名医药	7,300	106,580.00	0.08
603	300596	利安隆	3,600	106,416.00	0.08
604	002895	川恒股份	5,600	106,400.00	0.08
605	300284	苏文科	19,400	105,730.00	0.08
606	603113	金能科技	13,100	105,717.00	0.08
607	600751	海航科技	40,100	105,062.00	0.08
608	300377	赢时胜	13,500	104,760.00	0.08
609	601011	宝泰隆	29,900	104,650.00	0.07
610	002605	姚记科技	4,700	104,434.00	0.07
611	600649	城投控股	28,200	104,340.00	0.07
612	603212	赛伍技术	6,000	104,220.00	0.07
613	002097	山河智能	17,000	104,210.00	0.07
614	300620	光库科技	2,300	104,190.00	0.07
615	001287	中电港	5,000	104,150.00	0.07
616	002283	天润工业	17,800	104,130.00	0.07
617	000016	深康佳 A	24,900	103,833.00	0.07
618	603008	喜临门	6,100	103,761.00	0.07
619	688131	皓元医药	1,993	103,755.58	0.07
620	601163	三角轮胎	7,200	103,752.00	0.07
621	688097	博众精工	3,080	103,488.00	0.07
622	003021	兆威机电	1,100	103,389.00	0.07
623	002226	江南化工	23,600	103,368.00	0.07
624	688127	蓝特光学	4,436	103,314.44	0.07
625	300119	瑞普生物	6,300	103,257.00	0.07
626	002041	登海种业	7,800	103,194.00	0.07
627	688202	美迪西	1,509	103,185.42	0.07
628	688018	乐鑫科技	1,002	103,155.90	0.07
629	600490	鹏欣资源	34,500	103,155.00	0.07
630	001270	铖昌科技	1,640	102,844.40	0.07
631	000603	盛达资源	9,300	102,765.00	0.07
631	001696	宗申动力	15,500	102,765.00	0.07
632	600006	东风汽车	17,800	102,706.00	0.07
633	601949	中国出版	12,700	102,616.00	0.07
634	688630	芯碁微装	1,200	102,444.00	0.07

635	300401	花园生物	8,600	101,566.00	0.07
636	603043	广州酒家	5,200	101,556.00	0.07
637	688198	佰仁医疗	815	101,491.95	0.07
638	301268	铭利达	3,400	101,422.00	0.07
639	600391	航发科技	5,300	101,336.00	0.07
640	300772	运达股份	9,500	101,080.00	0.07
641	605168	三人行	1,595	101,059.20	0.07
642	000828	东莞控股	9,400	100,956.00	0.07
643	600073	上海梅林	14,800	100,788.00	0.07
644	002705	新宝股份	6,900	100,533.00	0.07
645	688100	威胜信息	3,462	100,121.04	0.07
646	603636	南威软件	7,800	99,996.00	0.07
647	603896	寿仙谷	3,100	99,944.00	0.07
648	603871	嘉友国际	6,300	99,918.00	0.07
649	688439	振华风光	1,120	99,803.20	0.07
650	002218	拓日新能	22,100	99,671.00	0.07
651	603801	志邦家居	5,940	99,613.80	0.07
652	300358	楚天科技	9,300	99,510.00	0.07
653	603533	掌阅科技	5,000	99,400.00	0.07
654	002545	东方铁塔	13,900	99,385.00	0.07
655	300443	金雷股份	3,600	99,324.00	0.07
656	002928	华夏航空	13,900	99,246.00	0.07
657	000088	盐田港	20,300	99,064.00	0.07
657	603171	税友股份	2,800	99,064.00	0.07
658	000061	农产品	15,300	98,991.00	0.07
659	600787	中储股份	19,400	98,940.00	0.07
660	600075	新疆天业	22,900	98,928.00	0.07
661	688133	泰坦科技	2,134	98,910.90	0.07
662	605376	博迁新材	3,500	98,700.00	0.07
663	601606	长城军工	8,100	98,658.00	0.07
664	002043	兔宝宝	11,100	98,346.00	0.07
665	600550	保变电气	20,100	98,088.00	0.07
666	600361	创新新材	19,400	97,194.00	0.07
667	000006	深振业 A	21,100	96,849.00	0.07
668	688298	东方生物	2,704	96,695.04	0.07
669	002274	华昌化工	12,800	96,640.00	0.07
670	000567	海德股份	9,080	96,520.40	0.07
671	600284	浦东建设	15,300	96,390.00	0.07
672	688403	汇成股份	9,120	96,216.00	0.07
673	002967	广电计量	6,400	96,064.00	0.07
674	603123	翠微股份	9,000	95,850.00	0.07
675	300602	飞荣达	5,300	95,771.00	0.07
676	300639	凯普生物	10,250	95,735.00	0.07

677	002993	奥海科技	2,500	95,250.00	0.07
678	688696	极米科技	841	95,016.18	0.07
679	603118	共进股份	10,600	94,976.00	0.07
680	000795	英洛华	15,200	94,696.00	0.07
681	000950	重药控股	19,000	94,430.00	0.07
682	300455	航天智装	7,900	94,326.00	0.07
683	603699	纽威股份	6,800	94,248.00	0.07
684	000557	西部创业	19,500	94,185.00	0.07
685	600491	龙元建设	23,900	94,166.00	0.07
686	002440	闰土股份	15,400	93,940.00	0.07
687	300080	易成新能	19,400	93,896.00	0.07
688	600861	北京城乡	5,000	93,700.00	0.07
689	603906	龙蟠科技	7,500	93,450.00	0.07
690	300856	科思股份	1,500	93,345.00	0.07
691	688733	壹石通	3,185	93,224.95	0.07
692	000935	四川双马	5,200	93,184.00	0.07
693	601801	皖新传媒	13,400	93,130.00	0.07
694	002077	大港股份	6,100	93,025.00	0.07
695	300497	富祥药业	9,900	92,664.00	0.07
696	002987	京北方	4,980	92,528.40	0.07
697	603187	海容冷链	6,100	92,476.00	0.07
698	002697	红旗连锁	18,400	91,632.00	0.07
699	600882	妙可蓝多	5,700	91,599.00	0.07
700	601882	海天精工	3,500	91,525.00	0.07
701	300143	盈康生命	8,600	91,418.00	0.07
702	002206	海利得	18,200	91,364.00	0.07
703	301080	百普赛斯	1,550	91,357.00	0.07
704	002941	新疆交建	7,000	91,140.00	0.07
705	600340	华夏幸福	52,300	91,002.00	0.07
706	600058	五矿发展	9,700	90,986.00	0.07
707	002051	中工国际	11,200	90,944.00	0.07
708	002194	武汉凡谷	9,200	90,712.00	0.06
709	002979	雷赛智能	4,200	90,510.00	0.06
710	603328	依顿电子	11,100	90,465.00	0.06
711	601969	海南矿业	13,700	90,283.00	0.06
712	600610	中毅达	9,600	90,144.00	0.06
713	601326	秦港股份	31,600	90,060.00	0.06
714	688048	长光华芯	1,433	89,806.11	0.06
715	002125	湘潭电化	8,400	89,796.00	0.06
716	603936	博敏电子	8,600	89,784.00	0.06
717	600955	维远股份	5,000	89,750.00	0.06
718	605507	国邦医药	5,100	89,556.00	0.06
719	000550	江铃汽车	4,700	89,441.00	0.06

720	601609	金田股份	13,200	89,364.00	0.06
721	600007	中国国贸	4,600	89,148.00	0.06
722	002135	东南网架	15,400	89,012.00	0.06
723	600169	太原重工	37,700	88,972.00	0.06
724	300821	东岳硅材	10,700	88,810.00	0.06
725	002556	辉隆股份	15,100	88,788.00	0.06
726	300134	大富科技	8,600	88,752.00	0.06
727	600508	上海能源	6,400	88,704.00	0.06
728	300792	壹网壹创	3,700	88,689.00	0.06
729	000672	上峰水泥	11,000	88,660.00	0.06
730	300267	尔康制药	27,600	88,596.00	0.06
731	601963	重庆银行	12,700	88,392.00	0.06
732	300382	斯莱克	8,900	88,377.00	0.06
733	688381	帝奥微	3,480	88,113.60	0.06
734	002320	海峡股份	15,100	88,033.00	0.06
735	603229	奥翔药业	6,660	87,978.60	0.06
736	603666	亿嘉和	2,800	87,892.00	0.06
737	000048	京基智农	4,800	87,840.00	0.06
738	603920	世运电路	4,800	87,744.00	0.06
739	002242	九阳股份	6,900	87,699.00	0.06
740	301238	瑞泰新材	5,000	87,650.00	0.06
741	000718	苏宁环球	33,800	87,542.00	0.06
742	003012	东鹏控股	10,600	87,450.00	0.06
743	000913	钱江摩托	7,000	87,290.00	0.06
744	688686	奥普特	779	87,248.00	0.06
745	301087	可孚医疗	2,300	87,170.00	0.06
746	002891	中宠股份	3,300	86,955.00	0.06
747	002489	浙江永强	28,600	86,944.00	0.06
748	000719	中原传媒	8,900	86,597.00	0.06
749	603583	捷昌驱动	4,300	86,129.00	0.06
750	002646	天佑德酒	6,300	85,743.00	0.06
751	300768	迪普科技	5,800	85,724.00	0.06
752	600458	时代新材	9,300	85,653.00	0.06
753	600770	综艺股份	17,400	85,434.00	0.06
754	603010	万盛股份	7,900	85,241.00	0.06
755	600691	阳煤化工	26,500	85,065.00	0.06
756	605020	永和股份	3,400	85,034.00	0.06
757	600172	黄河旋风	22,600	84,524.00	0.06
758	600835	上海机电	7,100	84,277.00	0.06
759	001213	中铁特货	20,000	84,000.00	0.06
760	688508	芯朋微	1,706	83,952.26	0.06
761	688383	新益昌	799	83,727.21	0.06
762	000597	东北制药	15,600	83,460.00	0.06

763	600575	淮河能源	34,600	83,386.00	0.06
764	601515	东风股份	20,580	83,143.20	0.06
765	600710	苏美达	11,700	82,953.00	0.06
766	300662	科锐国际	3,000	82,860.00	0.06
767	600780	通宝能源	10,100	82,820.00	0.06
768	000560	我爱我家	36,800	82,800.00	0.06
769	603730	岱美股份	5,685	82,375.65	0.06
770	300527	中船应急	10,800	82,296.00	0.06
771	301078	孩子王	10,000	82,100.00	0.06
772	600648	外高桥	8,300	81,838.00	0.06
773	601015	陕西黑猫	18,200	81,536.00	0.06
774	600217	中再资环	18,600	81,468.00	0.06
775	301069	凯盛新材	3,800	81,396.00	0.06
776	301175	中科环保	16,300	81,337.00	0.06
777	688776	国光电气	833	81,125.87	0.06
778	300737	科顺股份	13,200	81,048.00	0.06
779	002746	仙坛股份	11,500	80,960.00	0.06
780	601101	昊华能源	12,800	80,896.00	0.06
781	002516	旷达科技	16,400	80,852.00	0.06
782	301216	万凯新材	5,700	80,541.00	0.06
783	600012	皖通高速	7,300	80,446.00	0.06
784	002741	光华科技	5,400	80,298.00	0.06
785	000600	建投能源	16,000	80,160.00	0.06
786	003040	楚天龙	4,100	80,155.00	0.06
787	300183	东软载波	5,300	79,977.00	0.06
788	688232	新点软件	2,208	79,929.60	0.06
789	002913	奥士康	2,600	79,690.00	0.06
790	688261	东微半导	952	79,577.68	0.06
791	002573	清新环境	16,000	79,200.00	0.06
792	002461	珠江啤酒	10,000	79,000.00	0.06
793	000062	深圳华强	7,000	78,890.00	0.06
794	002204	大连重工	17,200	78,604.00	0.06
795	688409	富创精密	1,003	78,544.93	0.06
796	688586	江航装备	7,081	78,528.29	0.06
797	000498	山东路桥	13,900	78,396.00	0.06
798	002088	鲁阳节能	5,500	78,375.00	0.06
799	603718	海利生物	7,300	78,183.00	0.06
800	300783	三只松鼠	4,300	77,615.00	0.06
801	603105	芯能科技	6,700	77,586.00	0.06
802	300579	数字认证	3,000	77,580.00	0.06
803	000881	中广核技	10,700	77,575.00	0.06
804	603733	仙鹤股份	4,800	77,472.00	0.06
804	603989	艾华集团	3,600	77,472.00	0.06

805	688046	药康生物	3,820	76,973.00	0.06
806	600639	浦东金桥	7,600	76,836.00	0.06
807	000968	蓝焰控股	10,800	76,788.00	0.06
808	600783	鲁信创投	6,600	76,428.00	0.05
809	601921	浙版传媒	10,000	76,400.00	0.05
810	000688	国城矿业	7,400	76,294.00	0.05
811	600874	创业环保	13,700	76,035.00	0.05
812	002190	成飞集成	4,000	75,880.00	0.05
813	688356	键凯科技	709	75,437.60	0.05
814	000736	中交地产	7,700	75,383.00	0.05
815	688238	和元生物	8,380	75,336.20	0.05
816	601069	西部黄金	6,200	74,772.00	0.05
817	002034	旺能环境	4,900	74,725.00	0.05
818	688660	电气风电	14,505	74,555.70	0.05
819	600662	外服控股	15,500	74,400.00	0.05
820	600163	中闽能源	17,000	74,290.00	0.05
821	603915	国茂股份	4,500	74,160.00	0.05
822	002645	华宏科技	6,500	73,450.00	0.05
823	000789	万年青	10,700	73,402.00	0.05
824	301205	联特科技	700	73,325.00	0.05
825	603719	良品铺子	3,400	73,304.00	0.05
826	002267	陕天然气	10,000	73,300.00	0.05
827	002302	西部建设	11,300	73,224.00	0.05
828	300973	立高食品	1,500	72,825.00	0.05
829	600604	市北高新	15,700	72,691.00	0.05
830	603055	台华新材	6,000	72,240.00	0.05
831	002307	北新路桥	17,000	72,080.00	0.05
832	600929	雪天盐业	11,100	71,595.00	0.05
833	002932	明德生物	3,100	71,207.00	0.05
834	300653	正海生物	2,450	71,099.00	0.05
835	603301	振德医疗	2,900	71,050.00	0.05
836	603938	三孚股份	3,920	70,481.60	0.05
837	301089	拓新药业	1,300	70,213.00	0.05
838	603609	禾丰股份	8,200	70,192.00	0.05
839	000869	张裕 A	2,900	70,006.00	0.05
840	600810	神马股份	9,400	69,936.00	0.05
841	002815	崇达技术	7,300	69,934.00	0.05
842	002314	南山控股	24,100	69,890.00	0.05
843	603439	贵州三力	3,700	69,856.00	0.05
844	000737	北方铜业	12,000	69,600.00	0.05
845	301207	华兰疫苗	2,500	69,500.00	0.05
846	000029	深深房 A	5,900	69,384.00	0.05
847	002990	盛视科技	2,000	69,060.00	0.05

848	002901	大博医疗	1,700	69,003.00	0.05
849	601869	长飞光纤	2,500	68,650.00	0.05
850	601886	江河集团	10,300	68,598.00	0.05
851	600657	信达地产	19,100	68,569.00	0.05
852	688680	海优新材	1,035	67,947.75	0.05
853	002866	传艺科技	3,200	67,904.00	0.05
854	300696	爱乐达	3,900	67,899.00	0.05
855	300767	震安科技	3,900	67,782.00	0.05
856	301217	铜冠铜箔	5,700	67,602.00	0.05
857	000885	城发环境	5,900	66,906.00	0.05
858	000025	特力A	4,200	66,822.00	0.05
859	688392	骄成超声	800	66,728.00	0.05
860	603098	森特股份	4,900	66,689.00	0.05
861	688337	普源精电	1,518	66,594.66	0.05
862	603025	大豪科技	5,020	66,565.20	0.05
863	300206	理邦仪器	6,500	66,365.00	0.05
864	300702	天宇股份	3,040	65,998.40	0.05
865	301267	华夏眼科	2,050	65,784.50	0.05
866	603281	江瀚新材	2,500	65,725.00	0.05
867	603396	金辰股份	1,200	65,580.00	0.05
868	688526	科前生物	3,217	65,562.46	0.05
869	600475	华光环能	6,300	65,520.00	0.05
870	603995	甬金股份	3,400	65,382.00	0.05
871	688206	概伦电子	2,956	64,440.80	0.05
872	002768	国恩股份	3,000	64,260.00	0.05
873	002549	凯美特气	6,500	63,570.00	0.05
874	600876	凯盛新能	4,500	63,135.00	0.05
875	000813	德展健康	19,300	63,111.00	0.05
876	002201	正威新材	8,720	63,045.60	0.05
877	301291	明阳电气	2,211	62,703.96	0.04
878	688315	诺禾致源	2,679	62,527.86	0.04
879	002534	西子洁能	5,000	62,450.00	0.04
880	001301	尚太科技	1,700	62,254.00	0.04
881	688173	希荻微	3,523	61,969.57	0.04
882	002782	可立克	4,400	61,820.00	0.04
883	688268	华特气体	916	61,720.08	0.04
884	603489	八方股份	1,120	61,544.00	0.04
885	301327	华宝新能	800	61,120.00	0.04
886	000030	富奥股份	11,400	60,876.00	0.04
887	000791	甘肃能源	10,900	60,713.00	0.04
888	300953	震裕科技	1,100	60,698.00	0.04
889	002378	章源钨业	10,710	60,618.60	0.04
890	688380	中微半导	2,520	60,127.20	0.04

891	688001	华兴源创	1,715	59,939.25	0.04
892	002677	浙江美大	5,900	59,649.00	0.04
893	603299	苏盐井神	7,000	59,640.00	0.04
894	688185	康希诺	800	59,616.00	0.04
895	603297	永新光学	600	59,610.00	0.04
896	603363	傲农生物	9,800	59,486.00	0.04
897	000761	本钢板材	16,600	59,262.00	0.04
898	600903	贵州燃气	7,500	59,175.00	0.04
899	601330	绿色动力	8,900	59,096.00	0.04
900	300887	谱尼测试	5,000	59,050.00	0.04
901	603013	亚普股份	3,400	58,752.00	0.04
902	002053	云南能投	6,100	58,682.00	0.04
903	300894	火星人	3,600	58,464.00	0.04
904	605222	起帆电缆	3,000	57,840.00	0.04
905	605333	沪光股份	2,900	57,710.00	0.04
906	003006	百亚股份	3,800	57,608.00	0.04
907	603170	宝立食品	3,400	57,494.00	0.04
908	600400	红豆股份	20,600	57,474.00	0.04
909	301060	兰卫医学	4,300	57,147.00	0.04
910	603071	物产环能	3,700	56,240.00	0.04
911	301293	三博脑科	900	56,178.00	0.04
912	300208	青岛中程	8,300	55,444.00	0.04
913	301090	华润材料	5,100	55,386.00	0.04
914	002724	海洋王	6,700	55,074.00	0.04
915	002275	桂林三金	3,800	55,062.00	0.04
916	000019	深粮控股	7,300	55,042.00	0.04
917	002950	奥美医疗	5,800	54,984.00	0.04
918	300755	华致酒行	3,000	54,870.00	0.04
919	001311	多利科技	1,100	54,461.00	0.04
920	301325	曼恩斯特	700	54,278.00	0.04
921	002978	安宁股份	1,700	53,822.00	0.04
922	300741	华宝股份	2,500	53,525.00	0.04
923	600510	黑牡丹	9,400	53,110.00	0.04
924	603877	太平鸟	3,100	52,948.00	0.04
925	688209	英集芯	2,956	52,794.16	0.04
926	000517	荣安地产	21,300	52,185.00	0.04
927	600696	岩石股份	2,900	52,171.00	0.04
928	002959	小熊电器	1,000	51,930.00	0.04
929	002838	道恩股份	4,000	51,240.00	0.04
930	001258	立新能源	6,300	50,904.00	0.04
931	688368	晶丰明源	470	50,731.80	0.04
932	603032	德新科技	2,480	50,344.00	0.04
933	688372	伟测科技	640	50,176.00	0.04

934	002918	蒙娜丽莎	3,700	50,098.00	0.04
935	002991	甘源食品	700	50,022.00	0.04
936	605009	豪悦护理	1,300	49,621.00	0.04
937	301165	锐捷网络	1,300	49,257.00	0.04
938	603093	南华期货	4,100	49,200.00	0.04
939	002651	利君股份	6,900	47,748.00	0.03
940	000058	深赛格	6,600	47,322.00	0.03
941	688499	利元亨	1,239	47,181.12	0.03
942	601811	新华文轩	3,400	46,444.00	0.03
943	600618	氯碱化工	5,100	46,410.00	0.03
944	003009	中天火箭	1,000	46,110.00	0.03
945	688190	云路股份	640	45,843.20	0.03
946	603208	江山欧派	1,530	45,425.70	0.03
947	605338	巴比食品	2,100	45,108.00	0.03
948	603693	江苏新能	4,020	45,064.20	0.03
949	002946	新乳业	3,900	44,772.00	0.03
950	301301	川宁生物	5,300	44,520.00	0.03
951	688275	万润新能	720	44,402.40	0.03
952	688161	威高骨科	1,071	44,392.95	0.03
953	300860	锋尚文化	800	43,704.00	0.03
954	002961	瑞达期货	2,900	43,210.00	0.03
955	603983	丸美股份	1,700	42,959.00	0.03
956	001308	康冠科技	1,530	42,809.40	0.03
957	003039	顺控发展	2,800	42,448.00	0.03
958	688031	星环科技	640	41,644.80	0.03
959	600403	大有能源	10,700	40,660.00	0.03
960	001338	永顺泰	3,300	39,798.00	0.03
961	605369	拱东医疗	700	39,074.00	0.03
962	688351	微电生理	1,470	37,705.50	0.03
963	603530	神马电力	1,800	37,332.00	0.03
964	603057	紫燕食品	1,700	36,686.00	0.03
965	301367	怡和嘉业	300	36,525.00	0.03
966	001337	四川黄金	1,300	35,919.00	0.03
967	001236	弘业期货	3,200	35,776.00	0.03
968	601022	宁波远洋	3,200	35,488.00	0.03
969	688128	中国电研	1,690	34,678.80	0.02
970	002265	建设工业	3,000	34,080.00	0.02
971	301200	大族数控	900	33,993.00	0.02
972	601068	中铝国际	6,900	31,878.00	0.02
973	002287	奇正藏药	1,400	31,486.00	0.02
974	603132	金徽股份	2,300	31,464.00	0.02
975	002096	易普力	2,900	30,044.00	0.02
976	002911	佛燃能源	2,600	29,796.00	0.02

977	301363	美好医疗	800	29,440.00	0.02
978	603103	横店影视	1,600	28,448.00	0.02
979	688152	麒麟信安	400	28,028.00	0.02
980	001323	慕思股份	900	27,450.00	0.02
981	601279	英利汽车	4,700	27,401.00	0.02
982	301177	迪阿股份	900	26,541.00	0.02
983	001322	箭牌家居	2,100	24,906.00	0.02
984	301246	宏源药业	900	23,382.00	0.02
985	301286	侨源股份	800	23,248.00	0.02
986	605365	立达信	1,200	22,332.00	0.02
987	301180	万祥科技	1,200	21,708.00	0.02
988	603162	海通发展	1,200	21,264.00	0.02
989	301381	赛维时代	655	19,686.95	0.01
990	301262	海看股份	600	18,690.00	0.01
991	301316	慧博云通	800	18,592.00	0.01
992	001269	欧晶科技	340	18,173.00	0.01
993	301376	致欧科技	693	16,576.56	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	688800	瑞可达	1,760	70,716.80	0.05
2	301487	盟固利	599	24,535.04	0.02
3	301526	国际复材	2,185	9,723.25	0.01
4	301348	蓝箭电子	196	8,735.72	0.01
5	301488	豪恩汽电	124	8,567.16	0.01
6	301566	达利凯普	369	8,169.66	0.01
7	301510	固高科技	224	7,842.24	0.01
8	301421	波长光电	127	7,539.99	0.01
9	301225	恒勃股份	195	6,981.00	0.01
10	688543	国科军工	116	6,484.40	0.00
11	688582	芯动联科	164	6,341.88	0.00
12	301516	中远通	397	6,157.47	0.00
13	688627	精智达	70	6,140.40	0.00
14	301413	安培龙	101	5,877.19	0.00
15	301172	君逸数码	151	5,762.16	0.00
16	301558	三态股份	373	4,998.20	0.00
17	301292	海科新源	253	4,895.55	0.00
18	688603	天承科技	66	4,893.24	0.00
19	301499	维科精密	169	4,889.17	0.00
20	301578	辰奕智能	70	4,782.40	0.00
21	688563	航材股份	79	4,778.71	0.00

22	301508	中机认检	179	4,775.72	0.00
23	301261	恒工精密	91	4,627.35	0.00
24	301486	致尚科技	92	4,347.00	0.00
25	301555	惠柏新材	131	4,249.64	0.00
26	301568	思泰克	116	4,127.28	0.00
27	301459	丰茂股份	103	4,103.52	0.00
28	301272	英华特	73	3,896.74	0.00
29	301498	乖宝宠物	100	3,881.00	0.00
30	688610	埃科光电	76	3,876.00	0.00
31	301202	朗威股份	120	3,816.00	0.00
32	301489	思泉新材	59	3,782.49	0.00
33	301329	信音电子	170	3,779.10	0.00
34	301507	民生健康	236	3,740.60	0.00
35	301251	威尔高	106	3,666.54	0.00
36	301533	威马农机	109	3,614.44	0.00
37	301509	金凯生科	57	3,547.11	0.00
38	301456	盘古智能	115	3,494.85	0.00
39	301505	苏州规划	97	3,473.57	0.00
40	301393	昊帆生物	56	3,324.72	0.00
41	688602	康鹏科技	276	3,052.56	0.00
42	301550	斯菱股份	70	3,049.90	0.00
43	301517	陕西华达	69	3,014.61	0.00
44	301518	长华化学	126	2,899.26	0.00
45	301529	福赛科技	70	2,651.60	0.00
46	301500	飞南资源	125	2,611.25	0.00
47	001239	永达股份	122	2,430.24	0.00
48	301520	万邦医药	45	2,373.30	0.00
49	301548	崇德科技	39	2,300.61	0.00
50	301371	敷尔佳	61	2,292.38	0.00
51	301515	港通医疗	81	2,289.87	0.00
52	603004	鼎龙科技	73	2,276.87	0.00
53	301559	中集环科	124	2,261.76	0.00
54	001326	联域股份	44	2,140.16	0.00
55	603373	安邦护卫	57	1,980.75	0.00
56	001358	兴欣新材	39	1,722.24	0.00
57	001306	夏厦精密	22	1,657.92	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	300002	神州泰岳	1,065,021.00	0.68
2	603345	安井食品	965,926.00	0.62
3	300502	新易盛	952,277.00	0.61
4	002405	四维图新	902,139.00	0.57
5	002436	兴森科技	808,991.10	0.52
6	002176	江特电机	718,184.00	0.46
7	300567	精测电子	679,359.00	0.43
8	002517	恺英网络	673,933.00	0.43
9	002044	美年健康	673,612.00	0.43
10	002472	双环传动	642,909.00	0.41
11	002558	巨人网络	638,727.00	0.41
12	002456	欧菲光	600,985.00	0.38
13	300339	润和软件	568,592.00	0.36
14	300394	天孚通信	565,620.00	0.36
15	300054	鼎龙股份	560,590.00	0.36
16	002212	天融信	560,323.00	0.36
17	300346	南大光电	552,505.00	0.35
18	300666	江丰电子	547,306.00	0.35
19	300459	汤姆猫	532,216.00	0.34
20	000818	航锦科技	529,371.00	0.34

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	300502	新易盛	2,086,692.00	1.33
2	002517	恺英网络	1,261,215.00	0.80
3	002558	巨人网络	1,199,793.00	0.76
4	300394	天孚通信	1,171,088.00	0.75
5	002044	美年健康	1,120,966.00	0.71
6	002472	双环传动	1,119,288.00	0.71
7	002405	四维图新	1,021,765.51	0.65
8	002463	沪电股份	945,237.24	0.60
9	002240	盛新锂能	836,430.00	0.53
10	002262	恩华药业	836,167.00	0.53
11	000423	东阿阿胶	832,953.00	0.53
12	000933	神火股份	825,281.00	0.53
13	002436	兴森科技	796,753.00	0.51
14	002176	江特电机	796,206.32	0.51
15	300567	精测电子	740,684.00	0.47
16	300395	菲利华	700,576.00	0.45
17	300114	中航电测	697,549.00	0.44
18	301236	软通动力	692,195.00	0.44

19	300339	润和软件	650,271.71	0.41
20	300118	东方日升	645,297.00	0.41

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	172,818,118.80
卖出股票收入（成交）总额	174,434,427.83

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,703.08	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,703.08	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113069	博 23 转债	230	23,001.51	0.02
2	127100	神码转债	217	21,701.57	0.02

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，欧菲光（002456）在报告编制日前一年内曾受到深圳证监局的处罚。

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	408,001.06
2	应收清算款	228,716.81
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	636,717.87

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	301487	盟固利	24,535.04	0.02	新股锁定期内
2	301526	国际复材	9,723.25	0.01	新股锁定期内
3	301348	蓝箭电子	8,735.72	0.01	新股锁定期内
4	301488	豪恩汽电	8,567.16	0.01	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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,187	65,890.34	74,399,882.00	51.63	69,702,300.00	48.37

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	BARCLAYS BANK PLC	21,000,000.00	14.57
2	中信证券股份有限公司	11,256,888.00	7.81
3	广发证券股份有限公司	8,796,600.00	6.10
4	兴银理财有限责任公司—兴银理财兴承恒享封闭式1号净值型理财产品	5,191,200.00	3.60
5	中国国际金融股份有限公司	5,136,100.00	3.56
6	方正证券股份有限公司	5,106,594.00	3.54
7	张岳旋	4,100,600.00	2.85
8	山西黎氏阁家居产业发展有限公司	4,000,000.00	2.78
9	张婷婷	3,186,100.00	2.21
10	华泰证券股份有限公司	3,172,400.00	2.20

	司		
--	---	--	--

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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（2021年3月15日） 基金份额总额	222,602,182.00
本报告期期初基金份额总额	156,602,182.00
本报告期基金总申购份额	195,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	207,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	144,102,182.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

2023年4月18日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

本基金托管人的专门基金托管部门有如下重大人事变动：

2023年7月23日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部副总经理职务，另有任用。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

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、公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 3 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	6	340,771,177.20	100.00	316,502.74	100.00	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专题研究报告。

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

3、本报告期内, 无变更租用证券公司交易单元的情况。

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(%)
招商证券	574,998.65	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月26日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月23日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月23日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与贵州省贵文文化基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月16日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023年12月13日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	证监会规定报刊和网站	2023年11月08日
7	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可转换公司债券	证监会规定报刊和网站	2023年11月01日

	的关联交易公告		
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 20 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止尚智逢源(北京)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 19 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 22 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 17 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 08 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 05 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 02 日
18	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可转换公司债券的关联交易的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 26 日
19	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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 25 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 12 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承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 11 日

22	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可转换公司债券的关联交易的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 06 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国人寿保险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	2023 年 06 月 27 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	2023 年 06 月 21 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 16 日
26	关于同意东海证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 06 月 08 日
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	2023 年 06 月 03 日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 16 日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 11 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 05 月 09 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 04 月 29 日
32	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	2023 年 04 月 19 日
33	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 04 月 11 日
34	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可转换公司债券的关联交易的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 04 月 08 日
35	华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 30 日
36	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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 29 日

37	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 22 日
38	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 21 日
39	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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 02 月 25 日
40	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 02 月 23 日
41	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与博时财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 02 月 08 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	20230705-20230724;	21,000,000.00	0.00	0.00	21,000,000.00	14.57

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

2024 年 3 月 30 日