

# 华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

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

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

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

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

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

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
<b>§ 8 投资组合报告</b>	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	71
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 .....	71
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 .....	71
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 .....	71
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 .....	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
8.12 投资组合报告附注 .....	72
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>72</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	73
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>73</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>74</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	74
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 .....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4 基金投资策略的改变 .....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
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 .....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.8 其他重大事件 .....	76
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>78</b>
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 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强	
基金主代码	019240	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 19 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	129,892,296.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019240	019241
报告期末下属分级基金的份额总额	88,382,327.60 份	41,509,968.75 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时 力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	1、股票投资策略 本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。 2、债券投资策略 3、资产支持证券投资策略 4、衍生品投资策略 5、存托凭证投资策略 6、融资及转融通证券出借业务的投资策略
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率 $\times$ 95% + 人民币活期存款税后利率 $\times$ 5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

	证大五道口广场 1 号 17 层	行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 21 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年 9 月 19 日(基金合同生效日)–2023 年 12 月 31 日	
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	2,931,649.39	564,423.88	3,473,947.75	1,637,927.73
本期利润	3,797,478.94	903,812.05	-1,091,066.99	-500,651.14
加权平均基金份额本期利润	0.0236	0.0130	-0.0047	-0.0047
本期加权平均净值利润率	2.65%	1.46%	-0.47%	-0.47%
本期基金份额净值增长率	5.89%	5.47%	-0.86%	-0.98%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	4,398,179.49	1,841,902.59	-1,734,231.02	-834,630.11
期末可供分配基金份额利润	0.0498	0.0444	-0.0086	-0.0098
期末基金资产净值	92,780,507.09	43,351,871.34	199,353,746.63	84,723,399.00
期末基金份额净值	1.0498	1.0444	0.9914	0.9902

3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	4.98%	4.44%	-0.86%	-0.98%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

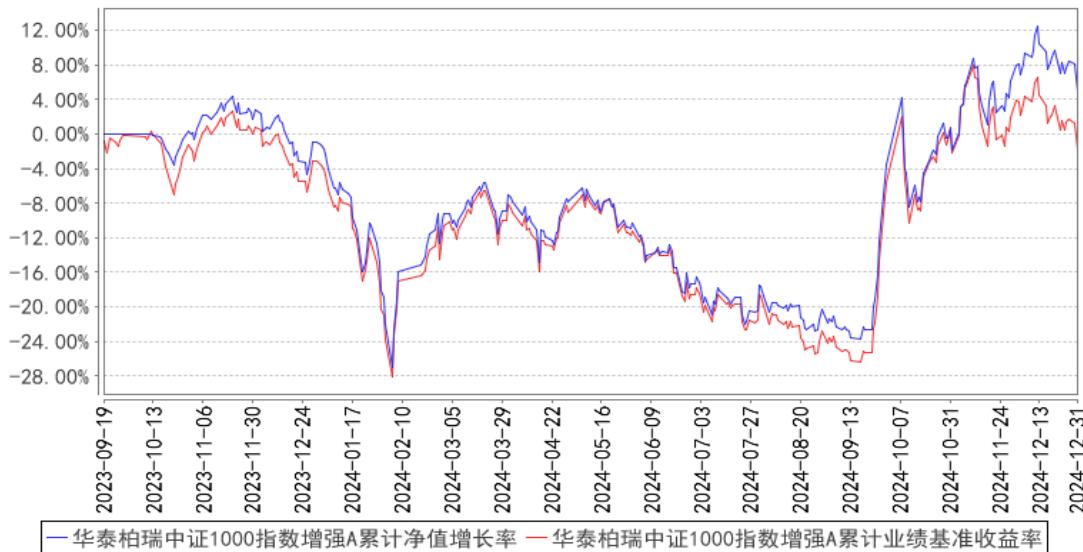
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.90%	2.22%	4.23%	2.28%	4.67%	-0.06%
过去六个月	26.99%	2.06%	20.68%	2.13%	6.31%	-0.07%
过去一年	5.89%	1.98%	1.41%	2.01%	4.48%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.98%	1.78%	-1.68%	1.83%	6.66%	-0.05%

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.79%	2.22%	4.23%	2.28%	4.56%	-0.06%
过去六个月	26.73%	2.06%	20.68%	2.13%	6.05%	-0.07%
过去一年	5.47%	1.98%	1.41%	2.01%	4.06%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.44%	1.78%	-1.68%	1.83%	6.12%	-0.05%

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

华泰柏瑞中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

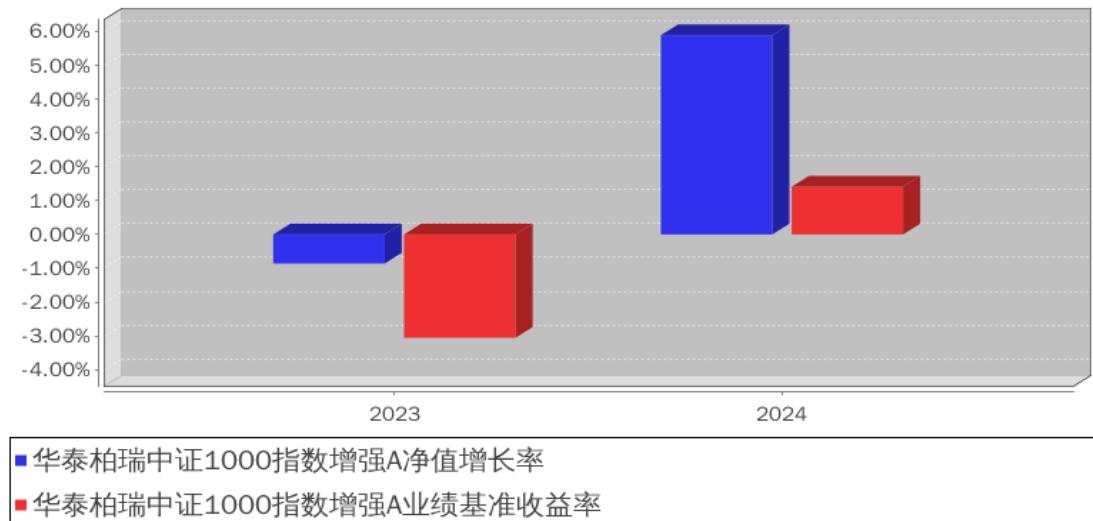


注：1、A类图示日期为2023年9月19日至2024年12月31日。C类图示日期为2023年9月19日至2024年12月31日。

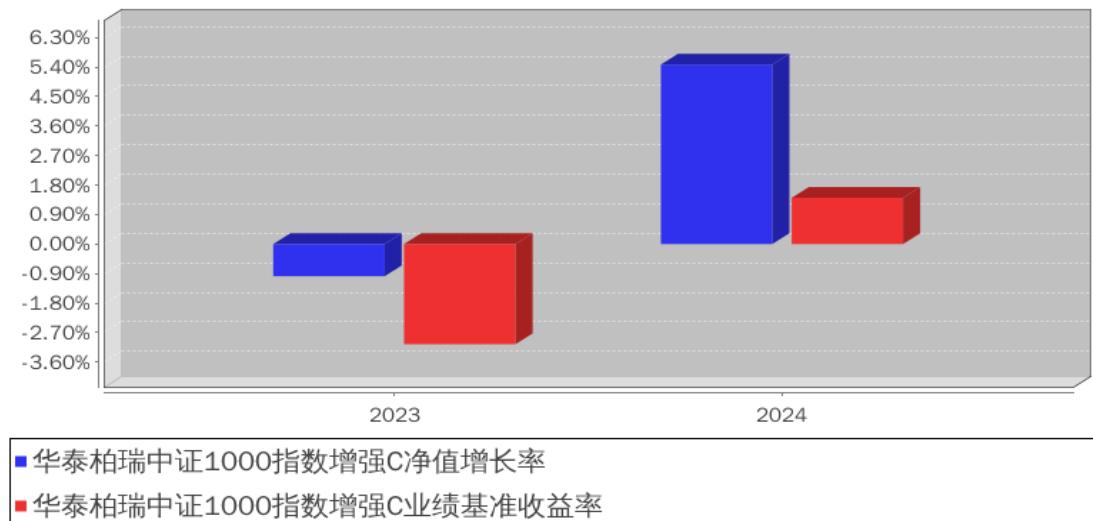
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

### 3.2.3 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

华泰柏瑞中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华泰柏瑞中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同自2023年9月19日起生效，2023年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
笪篁	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2023 年 9 月 19 日	-	10 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和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的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。

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

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同账户。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，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 全年，A 股一波三折，整体呈现先震荡下行，后反弹并维持高位震荡的走势。年初市场从短期资金流造成的剧烈波动中恢复，但数据显示经济基本面复苏依然缓慢，市场震荡下行。9 月底政府出台的一系列刺激政策大超市场预期，叠加外资空头回补，A 股迎来剧烈反弹。市场主要宽

基指数创出年内新高之后，股市活跃度维持在高位，主题行情持续到年底。全年看，A 股市场中银行、能源、公用事业等高股息相关行业整体表现较稳健，而以人工智能创新链为主的 TMT 相关行业，尤其是半导体产业链在后半程跑赢市场。

本报告期，代表大市值公司的上证 50、沪深 300 分别上涨 15.42% 和 14.68%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数上涨 18.76%；代表小市值公司的中证 1000 和中证 2000 指数同期涨幅分别为 1.20% 和 -2.14%。横向比较来看，代表核心资产的大市值公司和的高股息类上市公司，在全年来看跑赢中小市值公司。

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，在风格急剧切换的行情下，我们严控风险，力求减小组合超额的波动。由于我们始终保持高仓位运作，基本不做仓位择时，因而在本轮市场出现的急剧反弹中，超额收益虽受到仓位和份额申赎的拖累，但横向相比，影响相对较小。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.0498 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.89%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%，截至本报告期末华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.0444 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.47%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，A 股市场主要受国内外两方面因素影响。四季度，国内宏观经济数据已显示出止跌企稳迹象。随着地方政府“化债”问题提上日程表，以及央行实行适度宽松的货币政策，政府和企业的融资成本有望进一步降低，居民的还贷压力还将进一步减轻。同时我们预期财政将进一步发力，促消费扩内需的一系列增量政策仍将延续。海外，美国新一届政府即将上台，其贸易政策短期对中国的出口产业带来一定的不确定性，中长期我们仍然看好中国产业链的国际竞争力。年初以来，我们认为最大的变化在于，一系列突破性的科技成果及其转化已经扭转了市场之前对于国内科技产业链的担忧，在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的上升区间。考虑到外部仍有一定的不确定因素，在不出现极端情况的前提下，我们认为 A 股市场短期风险可控，对于中长期表现则更为乐观。

量化策略方面，在经历短期剧烈的反弹后，市场将会重新回到轮动的行情，绩优和有主题热度的股票更容易受到资金的关注，有利于技术面因子通过捕捉资金流特征，获取超额。另一方面，基本面因子挑选出绩优低估，且具有不错成长性的股票，增加模型的稳定性。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值仍有吸引力，经济基本面向好。我们在坚持控

制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，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遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P02894 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 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们认为，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</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 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 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>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	胡小骏   冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	12,208,738.81	15,664,360.49
结算备付金		426,646.47	71,767.95
存出保证金		571,756.80	—
交易性金融资产	7.4.7.2	123,381,633.19	268,494,208.10
其中：股票投资		123,381,633.19	268,494,208.10
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
债权投资	7.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	7.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	7.4.7.7	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		377,053.21	1,194,220.71
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.8	—	—
资产总计		136,965,828.48	285,424,557.25
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	—
应付赎回款		538,298.60	969,775.10

应付管理人报酬		99,502.79	210,483.91
应付托管费		24,875.69	52,620.99
应付销售服务费		15,731.50	32,320.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	155,041.47	82,210.73
负债合计		833,450.05	1,347,411.62
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	129,892,296.35	286,646,006.76
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	6,240,082.08	-2,568,861.13
净资产合计		136,132,378.43	284,077,145.63
负债和净资产总计		136,965,828.48	285,424,557.25

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额为 129,892,296.35 份，其中华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金 A 份额净值 1.0498 元，基金份额总额 88,382,327.60 份；华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金 C 份额净值 1.0444 元，基金份额总额 41,509,968.75 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业收入</b>		7,182,379.73	-437,132.39
1. 利息收入		48,357.77	612,146.22
其中：存款利息收入	7.4.7.13	48,357.77	109,433.28
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		-	502,712.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		5,546,486.34	5,490,970.63
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,828,887.50	5,401,171.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-

资产支持证券投资收益	7. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	7. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	7. 4. 7. 18	1, 409, 220. 12	-
股利收益	7. 4. 7. 19	2, 308, 378. 72	89, 798. 90
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, 205, 217. 72	-6, 703, 593. 61
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	382, 317. 90	163, 344. 37
<b>减: 二、营业总支出</b>		2, 481, 088. 74	1, 154, 585. 74
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	1, 651, 935. 96	762, 931. 26
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	412, 983. 99	190, 732. 80
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	249, 540. 00	120, 191. 68
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		5, 301. 30	-
8. 其他费用	7. 4. 7. 23	161, 327. 49	80, 730. 00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		4, 701, 290. 99	-1, 591, 718. 13
<b>减: 所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		4, 701, 290. 99	-1, 591, 718. 13
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4, 701, 290. 99	-1, 591, 718. 13

### 7.3 净资产变动表

会计主体: 华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	286,646,006.76	-	-2,568,861.13	284,077,145.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	286,646,006.76	-	-2,568,861.13	284,077,145.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 156,753,710.41	-	8,808,943.21	-147,944,767.20
(一)、综合收益总额	-	-	4,701,290.99	4,701,290.99
(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)	- 156,753,710.41	-	4,107,652.22	-152,646,058.19
其中：1.基金申购款	88,388,686.44	-	-2,595,388.89	85,793,297.55
2.基金赎回款	- 245,142,396.85	-	6,703,041.11	-238,439,355.74
(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	129,892,296.35	-	6,240,082.08	136,132,378.43
项目	上年度可比期间			
	2023 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	347,898,709.58	-	-	347,898,709.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-61,252,702.82	-	-2,568,861.13	-63,821,563.95
(一)、综合收益总额	-	-	-1,591,718.13	-1,591,718.13
(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)	-61,252,702.82	-	-977,143.00	-62,229,845.82
其中：1. 基金申购款	12,709,667.50	-	-271,496.56	12,438,170.94
2. 基金赎回款	-73,962,370.32	-	-705,646.44	-74,668,016.76
(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	286,646,006.76	-	-2,568,861.13	284,077,145.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1780 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 指数增强型

证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 347,748,610.52 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0486 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 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 347,898,709.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 150,099.06 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)、货币市场工具(含同业存单)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、资产支持证券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。在符合法律法规规定的情况下，本基金可以参与融资和转融通业务。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产的投资比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的资产比例不低于非现金资产基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

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

###### 债务工具

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

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，

仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。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

金融资产或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，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。

金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支

持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相

应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]140 号《关于明确金融-房地产开发-教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	12,208,738.81	15,664,360.49
等于：本金	12,207,871.66	15,663,275.50
加：应计利息	867.15	1,084.99
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	12,208,738.81	15,664,360.49

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	128,539,329.08	—	123,381,633.19	-5,157,695.89
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	128,539,329.08	-	123,381,633.19	-5,157,695.89	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	275,197,801.71	-	268,494,208.10	-6,703,593.61	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	275,197,801.71	-	268,494,208.10	-6,703,593.61	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日				备注	
	合同/名义 金额	公允价值				
		资产	负债			
利率衍 生工具	-	-	-	-	-	
货币衍 生工具	-	-	-	-	-	
权益衍 生工具	5,105,320.00	-	-	-	-	
其 中：股 指期货 投资	5,105,320.00	-	-	-	-	
其他衍 生工具	-	-	-	-	-	
合计	5,105,320.00	-	-	-	-	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日					
	合同/名义 金额	公允价值			备注	
		资产	负债			
利率衍	-	-	-	-	-	

生工具				
货币衍 生工具	-	-	-	-
权益衍 生工具	-	-	-	-
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
IM2501	中证 1000 股 指期货 2501	4.00	4,764,640.00	-340,680.00
合计				-340,680.00
减：可抵销期货 暂收款				-340,680.00
净额				0.00

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

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

## 7.4.7.6 其他债权投资

### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

## 7.4.7.8 其他资产

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	41.47	2,210.73
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	—	—
其中：交易所市场	—	—
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提费用	155,000.00	80,000.00
合计	155,041.47	82,210.73

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	201,087,977.65	201,087,977.65
本期申购	66,388,262.40	66,388,262.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-179,093,912.45	-179,093,912.45
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	88,382,327.60	88,382,327.60

## 华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	账面金额
上年度末	85,558,029.11	85,558,029.11
本期申购	22,000,424.04	22,000,424.04
本期赎回（以“-”号填列）	-66,048,484.40	-66,048,484.40
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	41,509,968.75	41,509,968.75

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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

## 华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,392,096.65	-4,126,327.67	-1,734,231.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,392,096.65	-4,126,327.67	-1,734,231.02
本期利润	2,931,649.39	865,829.55	3,797,478.94
本期基金份额交易产生的变动数	6,374,401.61	-4,039,470.04	2,334,931.57
其中：基金申购款	-3,640,448.80	1,888,145.74	-1,752,303.06
基金赎回款	10,014,850.41	-5,927,615.78	4,087,234.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,698,147.65	-7,299,968.16	4,398,179.49

## 华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	919,704.32	-1,754,334.43	-834,630.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	919,704.32	-1,754,334.43	-834,630.11
本期利润	564,423.88	339,388.17	903,812.05

本期基金份额交易产生的变动数	3,769,161.48	-1,996,440.83	1,772,720.65
其中：基金申购款	-1,942,833.37	1,099,747.54	-843,085.83
基金赎回款	5,711,994.85	-3,096,188.37	2,615,806.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,253,289.68	-3,411,387.09	1,841,902.59

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年9月19日（基金 合同生效日）至2023年 12月31日
活期存款利息收入	34,440.05	37,665.33
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	13,917.72	71,767.95
其他	-	-
合计	48,357.77	109,433.28

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年9月19日（基金 合同生效日）至2023年12月31 日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	1,828,887.50	5,401,171.73
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
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	1,828,887.50	5,401,171.73

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月	上年度可比期间 2023年9月19日（基金合

	31 日	同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,647,505,930.70	916,583,419.93
减: 卖出股票成本总额	2,642,624,008.87	908,743,602.09
减: 交易费用	3,053,034.33	2,438,646.11
买卖股票差价收入	1,828,887.50	5,401,171.73

#### 7.4.7.14.3 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

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

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

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

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

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	1,409,220.12	-

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金合同生 效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利 收益	2,308,378.72	89,798.90
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	2,308,378.72	89,798.90

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,545,897.72	-6,703,593.61
股票投资	1,545,897.72	-6,703,593.61
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-

贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-340,680.00	-
权证投资	-	-
期货投资	-340,680.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,205,217.72	-6,703,593.61

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	377,912.75	163,340.96
基金转换费收入	4,405.15	3.41
合计	382,317.90	163,344.37

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	30,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	-	400.00
银行划款手续费	6,327.49	330.00
合计	161,327.49	80,730.00

#### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、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
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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,651,935.96	762,931.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	693,402.40	318,882.56
应支付基金管理人的净管理费	958,533.56	444,048.70

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 0.80 %的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.80 % / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	412,983.99	190,732.80

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20 %的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20 % / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 1000 指 数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指 数增强 C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	122,426.26	122,426.26
华泰柏瑞基金管理有限公 司	0.00	1,110.30	1,110.30
合计	0.00	123,536.56	123,536.56
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 9 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 1000 指 数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指 数增强 C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	54,168.09	54,168.09
华泰柏瑞基金管理有限公 司	0.00	46.62	46.62
合计	0.00	54,214.71	54,214.71

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人按照与基金管理人约定的时间从基金资产中一次性支取。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	期末余额	2023 年 9 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	当期利息收入
招商银行	5,868,544.31	9,727.95	4,929,047.85	14,770.77

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单 位:股/ 张)	总金额
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	4,562	71,577.78
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券	688726	拉普拉斯	网下申购	7,979	140,270.82
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	1,296	33,696.00
华泰联合证券	301606	绿联科技	网下申购	2,406	51,031.26
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	1,010	29,310.20
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	6,477	73,125.33
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	2,059	46,039.24
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	2,934	63,755.82
上年度可比期间					
2023 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单 位:股/ 张)	总金额
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合证券	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	2.30	6.80	1,080	2,484.00	7,344.00	-

		日								
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	6.88	24.84	712	4,898.56	17,686.08	-
301551	无线传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	23.95	35.85	186	4,454.70	6,668.10	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	26.50	41.98	181	4,796.50	7,598.38	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	21.21	36.49	241	5,111.61	8,794.09	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	44.50	65.38	120	5,340.00	7,845.60	-

		日								
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	8.00	56.10	669	5,352.00	37,530.90	-
301613	新铝时代	2024 年 10 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	27.70	41.77	211	5,844.70	8,813.47	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	27.76	39.79	155	4,302.80	6,167.45	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	22.36	44.92	206	4,606.16	9,253.52	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	21.23	65.78	885	18,788.55	58,215.30	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	72.99	101.96	85	6,204.15	8,666.60	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	1,054	12,964.20	12,964.20	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月以上	新股锁定期内	12.30	12.30	118	1,451.40	1,451.40	-
603091	众鑫股份	2024 年 9 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	20.32	28.13	118	2,397.76	3,319.34	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-

		日								
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	18.65	22.61	103	1,920.95	2,328.83	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	17.39	17.95	113	1,965.07	2,028.35	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	40.00	41.35	75	3,000.00	3,101.25	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	11.25	29.44	678	7,627.50	19,960.32	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	11.29	53.68	648	7,315.92	34,784.64	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	55.18	165.78	120	6,621.60	19,893.60	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	27.08	48.95	286	7,744.88	13,999.70	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	19.06	33.58	299	5,698.94	10,040.42	-

		日								
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	17.58	33.06	798	14,028.84	26,381.88	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	7.16	15.44	1,353	9,687.48	20,890.32	-

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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和股指期货投资等。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，力争实现超越标的指数的投资收益，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的有效性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于本基金的托管人开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用

评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2024 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	12,208,738.81	-	-	-	-	-	12,208,738.81
结算备付金	426,646.47	-	-	-	-	-	426,646.47
存出保证金	571,756.80	-	-	-	-	-	571,756.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	123,381,633.19	123,381,633.19
应收申购款	-	-	-	-	-	377,053.21	377,053.21
资产总计	13,207,142.08	-	-	-	-	123,758,686.40	136,965,828.48
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	538,298.60	538,298.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	99,502.79	99,502.79
应付托管费	-	-	-	-	-	24,875.69	24,875.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,731.50	15,731.50
其他负债	-	-	-	-	-	155,041.47	155,041.47
负债总计	-	-	-	-	-	833,450.05	833,450.05
利率敏感度缺口	13,207,142.08	-	-	-	-	122,925,236.35	136,132,378.43
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	15,664,360.49	-	-	-	-	-	15,664,360.49
结算备付金	71,767.95	-	-	-	-	-	71,767.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	268,494,208.10	268,494,208.10
应收申购款	-	-	-	-	-	1,194,220.71	1,194,220.71
资产总计	15,736,128.44	-	-	-	-	269,688,428.81	285,424,557.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	969,775.10	969,775.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	210,483.91	210,483.91
应付托管费	-	-	-	-	-	52,620.99	52,620.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	32,320.89	32,320.89
其他负债	-	-	-	-	-	82,210.73	82,210.73
负债总计	-	-	-	-	-	1,347,411.62	1,347,411.62
利率敏感度缺口	15,736,128.44	-	-	-	-	268,341,017.19	284,077,145.63

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	123,381,633.19	90.63	268,494,208.10	94.51
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	—	—	—	—
合计	123,381,633.19	90.63	268,494,208.10	94.51

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	6,251,277.10	14,892,889.70
	业绩比较基准下降 5%	-6,251,277.10	-14,892,889.70

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	122,893,609.78	267,206,553.86
第二层次	14,415.60	1,137,290.00
第三层次	473,607.81	150,364.24
合计	123,381,633.19	268,494,208.10

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	150,364.24	150,364.24
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	305,230.95	305,230.95
转出第三层次	-	339,372.04	339,372.04
当期利得或损失总额	-	357,384.66	357,384.66
其中：计入损益的利得或	-	357,384.66	357,384.66

损失			
计入其他综合收益的利得或损失	-		
期末余额	-	473,607.81	473,607.81
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	-	289,930.36	289,930.36
项目		上年度可比期间 2023年9月19日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
		交易性金融资产	
		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	-	91,833.75	91,833.75
转出第三层次	-		
当期利得或损失总额	-	58,530.49	58,530.49
其中：计入损益的利得或损失	-	58,530.49	58,530.49
计入其他综合收益的利得或损失	-		
期末余额	-	150,364.24	150,364.24
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	-	58,530.49	58,530.49

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

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售	473,607.81	平均价格亚洲期权模型	预期波动率	0.2665~5.7444	负相关

期内的股票					
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	150,364.24	平均价格亚洲期权模型	预期波动率	0.5141~2.1775	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	123,381,633.19	90.08
	其中：股票	123,381,633.19	90.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	12,635,385.28	9.23
8	其他各项资产	948,810.01	0.69
9	合计	136,965,828.48	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,883,366.00	1.38
C	制造业	83,393,792.74	61.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,741,686.00	2.01
E	建筑业	2,994,205.00	2.20
F	批发和零售业	3,632,023.00	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	3,775,905.00	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,065,857.03	9.60
J	金融业	4,000,082.00	2.94
K	房地产业	1,451,827.00	1.07
L	租赁和商务服务业	2,140,097.00	1.57
M	科学研究和技术服务业	1,679,714.42	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	2,122,491.00	1.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	200,895.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	267,796.00	0.20
S	综合	31,896.00	0.02
	合计	123,381,633.19	90.63

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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

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	300088	长信科技	183,600	1,200,744.00	0.88
2	002063	远光软件	179,000	1,031,040.00	0.76
3	688352	颀中科技	69,600	844,248.00	0.62
4	300236	上海新阳	22,100	825,877.00	0.61
5	600664	哈药股份	199,500	823,935.00	0.61
6	300747	锐科激光	40,900	783,644.00	0.58
7	688432	有研硅	67,800	766,140.00	0.56

8	002023	海特高新	74,900	760,235.00	0.56
9	600531	豫光金铅	116,700	749,214.00	0.55
10	002967	广电计量	45,000	738,000.00	0.54
11	002550	千红制药	114,600	710,520.00	0.52
12	600478	科力远	171,900	709,947.00	0.52
13	688007	光峰科技	45,278	669,661.62	0.49
14	002446	盛路通信	99,400	651,070.00	0.48
15	301175	中科环保	117,700	635,580.00	0.47
16	601068	中铝国际	142,100	626,661.00	0.46
17	600100	同方股份	87,900	624,969.00	0.46
18	603989	艾华集团	40,000	603,200.00	0.44
19	300261	雅本化学	85,400	584,990.00	0.43
20	601369	陕鼓动力	66,800	581,160.00	0.43
21	300821	东岳硅材	71,800	557,168.00	0.41
22	300039	上海凯宝	89,300	551,874.00	0.41
23	600572	康恩贝	118,300	551,278.00	0.40
24	300702	天宇股份	33,000	549,780.00	0.40
25	000758	中色股份	106,900	528,086.00	0.39
26	600776	东方通信	47,000	525,930.00	0.39
27	600517	国网英大	94,500	520,695.00	0.38
28	000725	京东方 A	118,500	520,215.00	0.38
29	300674	宇信科技	26,400	515,328.00	0.38
30	600217	中再资环	96,700	512,510.00	0.38
31	600063	皖维高新	128,100	512,400.00	0.38
32	600667	太极实业	74,000	512,080.00	0.38
33	600267	海正药业	60,800	504,640.00	0.37
34	301339	通行宝	24,800	504,432.00	0.37
35	002537	海联金汇	87,700	504,275.00	0.37
36	002191	劲嘉股份	119,100	500,220.00	0.37
37	000062	深圳华强	22,200	497,280.00	0.37
38	000930	中粮科技	89,100	494,505.00	0.36
39	601096	宏盛华源	113,500	493,725.00	0.36
40	603327	福蓉科技	40,000	485,600.00	0.36
41	002456	欧菲光	39,700	475,606.00	0.35
42	300456	赛微电子	27,200	467,296.00	0.34
43	002414	高德红外	62,600	465,118.00	0.34
44	600420	国药现代	38,500	459,690.00	0.34
45	000686	东北证券	57,700	458,138.00	0.34
46	002061	浙江交科	112,100	457,368.00	0.34
47	000650	仁和药业	79,200	456,192.00	0.34
48	000025	特力 A	27,500	454,300.00	0.33
49	000885	城发环境	34,600	453,606.00	0.33
50	002183	怡亚通	100,900	453,041.00	0.33

51	000902	新洋丰	34,600	451,184.00	0.33
52	300123	亚光科技	77,500	449,500.00	0.33
53	600861	北京人力	23,200	448,920.00	0.33
54	600718	东软集团	41,600	448,032.00	0.33
55	300682	朗新集团	36,400	444,080.00	0.33
56	300663	科蓝软件	25,500	442,680.00	0.33
57	300773	拉卡拉	24,900	440,730.00	0.32
58	600552	凯盛科技	38,500	439,285.00	0.32
59	300768	迪普科技	25,000	437,500.00	0.32
60	605507	国邦医药	21,000	437,430.00	0.32
61	600248	陕建股份	97,600	437,248.00	0.32
62	300185	通裕重工	170,100	437,157.00	0.32
63	600110	诺德股份	109,200	436,800.00	0.32
64	600064	南京高科	55,500	431,235.00	0.32
65	002428	云南锗业	22,800	430,920.00	0.32
66	002176	江特电机	58,100	430,521.00	0.32
67	600877	电科芯片	32,600	429,994.00	0.32
68	300045	华力创通	20,400	426,156.00	0.31
69	301219	腾远钴业	9,400	424,974.00	0.31
70	000917	电广传媒	60,100	424,907.00	0.31
71	000821	京山轻机	34,100	424,545.00	0.31
72	000839	中信国安	136,500	420,420.00	0.31
73	002204	大连重工	83,300	414,834.00	0.30
74	300035	中科电气	27,700	414,115.00	0.30
75	603888	新华网	18,500	413,290.00	0.30
76	000828	东莞控股	38,600	412,634.00	0.30
77	000875	吉电股份	78,300	411,858.00	0.30
78	300315	掌趣科技	74,300	408,650.00	0.30
79	300618	寒锐钴业	12,100	408,617.00	0.30
80	300726	宏达电子	13,100	407,410.00	0.30
81	000557	西部创业	78,300	406,377.00	0.30
82	002399	海普瑞	38,000	406,220.00	0.30
83	300079	数码视讯	75,000	405,750.00	0.30
84	002626	金达威	26,700	403,170.00	0.30
85	300241	瑞丰光电	73,300	402,417.00	0.30
86	300416	苏试试验	34,200	402,192.00	0.30
87	002004	华邦健康	88,800	401,376.00	0.29
88	600116	三峡水利	57,100	399,129.00	0.29
89	600866	星湖科技	61,500	397,905.00	0.29
90	300666	江丰电子	5,700	395,865.00	0.29
91	688556	高测股份	35,400	395,772.00	0.29
92	603267	鸿远电子	10,900	394,907.00	0.29
93	600125	铁龙物流	65,800	390,194.00	0.29

94	301039	中集车辆	43,100	390,055.00	0.29
95	002534	西子洁能	35,100	389,961.00	0.29
96	000901	航天科技	35,500	389,435.00	0.29
97	002145	中核钛白	91,400	387,536.00	0.28
98	688128	中国电研	18,442	387,466.42	0.28
99	300366	创意信息	40,900	380,370.00	0.28
100	002125	湘潭电化	37,700	380,016.00	0.28
101	002101	广东鸿图	31,700	379,766.00	0.28
102	600812	华北制药	73,000	377,410.00	0.28
103	600703	三安光电	31,000	377,270.00	0.28
104	300036	超图软件	22,200	376,956.00	0.28
105	000035	中国天楹	77,100	375,477.00	0.28
106	600740	山西焦化	91,400	368,342.00	0.27
107	002099	海翔药业	71,100	366,876.00	0.27
108	000049	德赛电池	15,600	366,756.00	0.27
109	300576	容大感光	8,100	365,958.00	0.27
110	603025	大豪科技	23,900	364,475.00	0.27
111	600643	爱建集团	70,200	362,934.00	0.27
112	300455	航天智装	28,000	362,880.00	0.27
113	600888	新疆众和	51,100	362,810.00	0.27
114	300083	创世纪	55,700	362,607.00	0.27
115	000837	秦川机床	40,400	362,388.00	0.27
116	300429	强力新材	29,800	357,302.00	0.26
117	000528	柳工	29,600	356,976.00	0.26
118	600320	振华重工	90,700	355,544.00	0.26
119	688019	安集科技	2,550	355,368.00	0.26
120	688235	百济神州	2,200	354,244.00	0.26
121	300475	香农芯创	12,400	353,276.00	0.26
122	002249	大洋电机	60,000	352,200.00	0.26
123	301238	瑞泰新材	22,400	350,784.00	0.26
124	605376	博迁新材	12,100	350,295.00	0.26
125	002489	浙江永强	107,900	349,596.00	0.26
126	000969	安泰科技	30,900	344,535.00	0.25
127	600252	中恒集团	139,800	343,908.00	0.25
128	002036	联创电子	36,500	343,100.00	0.25
129	300066	三川智慧	86,800	341,992.00	0.25
130	300735	光弘科技	12,200	341,478.00	0.25
131	002267	陕天然气	40,300	340,535.00	0.25
132	600717	天津港	69,900	340,413.00	0.25
133	600269	赣粤高速	60,600	339,966.00	0.25
134	600399	抚顺特钢	58,400	338,720.00	0.25
135	002565	顺灏股份	111,400	338,656.00	0.25
136	300379	东方通	22,400	338,016.00	0.25

137	000029	深深房 A	22,200	334,332.00	0.25
138	601311	骆驼股份	40,300	334,087.00	0.25
139	300393	中来股份	53,200	332,500.00	0.24
140	000881	中广核技	45,200	331,316.00	0.24
141	002498	汉缆股份	97,300	329,847.00	0.24
142	603083	剑桥科技	8,100	328,860.00	0.24
143	688608	恒玄科技	1,000	325,370.00	0.24
144	603093	南华期货	27,300	324,870.00	0.24
145	600338	西藏珠峰	30,400	324,368.00	0.24
146	002506	协鑫集成	121,300	323,871.00	0.24
147	600330	天通股份	45,200	320,920.00	0.24
148	600728	佳都科技	67,900	317,772.00	0.23
149	000156	华数传媒	43,200	311,040.00	0.23
150	688009	中国通号	49,511	309,938.86	0.23
151	300130	新国都	14,200	307,572.00	0.23
152	600557	康缘药业	22,500	306,450.00	0.23
153	002151	北斗星通	11,500	305,210.00	0.22
154	600477	杭萧钢构	118,700	305,059.00	0.22
155	300369	绿盟科技	42,400	304,856.00	0.22
156	000776	广发证券	18,700	303,127.00	0.22
157	002079	苏州固锝	29,200	299,884.00	0.22
158	600133	东湖高新	32,000	299,200.00	0.22
159	002597	金禾实业	13,100	299,073.00	0.22
160	002349	精华制药	39,000	298,350.00	0.22
161	300363	博腾股份	18,900	298,053.00	0.22
162	600058	五矿发展	41,700	296,904.00	0.22
163	603690	至纯科技	11,800	296,298.00	0.22
164	000762	西藏矿业	13,700	294,550.00	0.22
165	300134	大富科技	25,000	293,250.00	0.22
166	600273	嘉化能源	36,700	292,499.00	0.21
167	301078	孩子王	25,700	292,466.00	0.21
168	002987	京北方	20,500	291,715.00	0.21
169	601015	陕西黑猫	87,300	291,582.00	0.21
170	605333	沪光股份	8,900	290,407.00	0.21
171	300598	诚迈科技	6,000	290,400.00	0.21
172	301526	国际复材	77,700	287,490.00	0.21
173	603496	恒为科技	10,500	285,390.00	0.21
174	000676	智度股份	33,700	285,102.00	0.21
175	002539	云图控股	36,300	283,866.00	0.21
176	600996	贵广网络	33,100	283,005.00	0.21
177	002745	木林森	32,400	282,528.00	0.21
178	000533	顺钠股份	46,600	282,396.00	0.21
179	001270	铖昌科技	7,400	281,940.00	0.21

180	300869	康泰医学	20,200	281,588.00	0.21
181	300507	苏奥传感	41,800	280,060.00	0.21
182	600623	华谊集团	39,600	277,200.00	0.20
183	600216	浙江医药	17,300	274,378.00	0.20
184	300227	光韵达	32,900	274,057.00	0.20
185	301511	德福科技	21,600	271,296.00	0.20
186	600640	国脉文化	22,600	269,844.00	0.20
187	000058	深赛格	33,600	269,808.00	0.20
188	600525	长园集团	55,100	268,888.00	0.20
189	300451	创业慧康	59,800	267,904.00	0.20
190	600751	海航科技	101,200	266,156.00	0.20
191	000090	天健集团	64,600	265,506.00	0.20
192	600783	鲁信创投	20,900	264,803.00	0.19
193	002567	唐人神	51,800	264,180.00	0.19
194	688549	中巨芯	31,000	264,120.00	0.19
195	603027	千禾味业	21,700	262,787.00	0.19
196	300383	光环新网	18,000	262,620.00	0.19
197	300357	我武生物	12,900	262,128.00	0.19
198	300725	药石科技	7,800	262,080.00	0.19
199	601107	四川成渝	49,700	259,931.00	0.19
200	002108	沧州明珠	72,400	259,916.00	0.19
201	600055	万东医疗	17,200	259,720.00	0.19
202	000970	中科三环	25,000	259,250.00	0.19
203	300184	力源信息	27,500	256,575.00	0.19
204	002060	广东建工	70,100	256,566.00	0.19
205	603678	火炬电子	8,400	256,200.00	0.19
206	600850	电科数字	10,700	255,730.00	0.19
207	300346	南大光电	6,600	254,694.00	0.19
208	002585	双星新材	47,600	254,184.00	0.19
209	601222	林洋能源	35,900	253,813.00	0.19
210	600966	博汇纸业	49,000	252,840.00	0.19
211	600550	保变电气	32,200	252,770.00	0.19
212	000737	北方铜业	32,400	252,720.00	0.19
213	003031	中瓷电子	4,800	251,472.00	0.18
214	301031	中熔电气	2,400	249,648.00	0.18
215	002376	新北洋	37,700	245,804.00	0.18
216	300398	飞凯材料	15,500	244,280.00	0.18
217	002378	章源钨业	37,700	243,919.00	0.18
218	600780	通宝能源	43,300	243,779.00	0.18
219	300319	麦捷科技	19,500	243,360.00	0.18
220	601375	中原证券	56,100	242,352.00	0.18
221	300181	佐力药业	15,700	241,152.00	0.18
222	603317	天味食品	17,800	237,452.00	0.17

223	300850	新强联	12,400	236,964.00	0.17
224	002701	奥瑞金	41,600	235,872.00	0.17
225	002153	石基信息	32,920	235,048.80	0.17
226	002091	江苏国泰	32,100	234,972.00	0.17
227	605111	新洁能	6,900	233,979.00	0.17
228	300783	三只松鼠	6,300	232,281.00	0.17
229	300259	新天科技	66,200	231,700.00	0.17
230	002326	永太科技	25,800	230,652.00	0.17
231	600210	紫江企业	34,700	229,367.00	0.17
232	600475	华光环能	25,400	228,854.00	0.17
233	600094	大名城	62,100	226,044.00	0.17
234	603100	川仪股份	10,400	224,120.00	0.16
235	000559	万向钱潮	36,200	222,630.00	0.16
236	002226	江南化工	41,000	222,220.00	0.16
237	000030	富奥股份	43,200	221,616.00	0.16
238	300433	蓝思科技	10,100	221,190.00	0.16
239	688206	概伦电子	11,600	219,356.00	0.16
240	002777	久远银海	12,700	218,694.00	0.16
241	000019	深粮控股	33,100	217,467.00	0.16
242	002546	新联电子	49,900	216,067.00	0.16
243	300034	钢研高纳	13,800	215,280.00	0.16
244	002243	力合科创	26,700	215,202.00	0.16
245	600879	航天电子	23,700	212,352.00	0.16
246	601866	中远海发	81,100	211,671.00	0.16
247	601208	东材科技	27,900	210,366.00	0.15
248	002549	凯美特气	33,600	205,968.00	0.15
249	301090	华润材料	29,600	205,424.00	0.15
250	002194	武汉凡谷	18,200	204,204.00	0.15
251	601022	宁波远洋	25,300	203,159.00	0.15
252	300244	迪安诊断	17,700	200,895.00	0.15
253	603919	金徽酒	10,200	199,920.00	0.15
254	600452	涪陵电力	18,700	198,033.00	0.15
255	300975	商络电子	17,600	198,000.00	0.15
256	600874	创业环保	33,100	197,607.00	0.15
257	000682	东方电子	18,400	197,064.00	0.14
258	300327	中颖电子	8,000	195,760.00	0.14
259	600380	健康元	17,300	194,971.00	0.14
260	300253	卫宁健康	27,100	194,036.00	0.14
261	300158	振东制药	44,200	190,944.00	0.14
262	601778	晶科科技	67,700	190,914.00	0.14
263	000517	荣安地产	85,400	190,442.00	0.14
264	600017	日照港	59,300	189,760.00	0.14
265	002588	史丹利	25,700	189,666.00	0.14

266	002164	宁波东力	37,700	188,877.00	0.14
267	002439	启明星辰	11,900	188,258.00	0.14
268	002747	埃斯顿	10,000	185,000.00	0.14
269	300247	融捷健康	50,900	182,222.00	0.13
270	300446	航天智造	11,000	181,610.00	0.13
271	601187	厦门银行	32,200	181,608.00	0.13
272	600645	中源协和	9,400	181,420.00	0.13
273	002755	奥赛康	14,200	180,482.00	0.13
274	002222	福晶科技	5,400	174,960.00	0.13
275	002389	航天彩虹	9,600	173,280.00	0.13
276	603699	纽威股份	7,800	172,926.00	0.13
277	000503	国新健康	15,500	170,190.00	0.13
278	600509	天富能源	26,300	170,161.00	0.12
279	601333	广深铁路	49,600	170,128.00	0.12
280	001236	弘业期货	17,600	169,664.00	0.12
281	300160	秀强股份	30,800	167,552.00	0.12
282	603799	华友钴业	5,700	166,782.00	0.12
283	300279	和晶科技	27,300	165,438.00	0.12
284	300142	沃森生物	13,600	164,288.00	0.12
285	000636	风华高科	11,400	163,590.00	0.12
286	000415	渤海租赁	42,800	161,356.00	0.12
287	603936	博敏电子	19,100	160,822.00	0.12
288	300460	惠伦晶体	13,200	160,248.00	0.12
289	002421	达实智能	46,700	160,181.00	0.12
290	603166	福达股份	22,000	159,940.00	0.12
291	688209	英集芯	9,000	159,030.00	0.12
292	000680	山推股份	16,100	156,170.00	0.11
293	300026	红日药业	41,200	156,148.00	0.11
294	300661	圣邦股份	1,900	155,382.00	0.11
295	300438	鹏辉能源	5,500	154,605.00	0.11
296	002011	盾安环境	14,300	154,583.00	0.11
297	603386	骏亚科技	13,900	154,568.00	0.11
298	002434	万里扬	24,900	154,380.00	0.11
299	000990	诚志股份	19,800	153,450.00	0.11
300	002254	泰和新材	16,300	153,220.00	0.11
301	300463	迈克生物	11,600	153,120.00	0.11
302	603055	台华新材	13,800	152,904.00	0.11
303	601555	东吴证券	19,600	152,880.00	0.11
304	002636	金安国纪	19,600	151,704.00	0.11
305	002106	莱宝高科	13,900	151,649.00	0.11
306	300166	东方国信	16,000	150,400.00	0.11
307	301050	雷电微力	2,900	149,582.00	0.11
308	688055	龙腾光电	36,200	149,506.00	0.11

309	601678	滨化股份	39,700	149,272.00	0.11
310	003039	顺控发展	11,400	149,112.00	0.11
311	300226	上海钢联	6,500	148,655.00	0.11
312	300281	金明精机	26,100	145,899.00	0.11
313	600268	国电南自	21,700	145,824.00	0.11
314	605577	龙版传媒	10,000	145,300.00	0.11
315	601399	国机重装	46,900	144,452.00	0.11
316	000012	南玻 A	27,300	144,144.00	0.11
317	688025	杰普特	3,000	142,500.00	0.10
318	000690	宝新能源	31,800	142,464.00	0.10
319	600651	飞乐音响	34,300	142,002.00	0.10
320	300129	泰胜风能	20,000	141,000.00	0.10
321	300180	华峰超纤	22,300	140,490.00	0.10
322	002522	浙江众成	35,900	140,369.00	0.10
323	688321	微芯生物	7,536	140,018.88	0.10
324	600662	外服控股	27,600	139,932.00	0.10
325	000563	陕国投 A	39,300	139,908.00	0.10
326	002468	申通快递	13,800	139,794.00	0.10
327	600305	恒顺醋业	17,500	139,650.00	0.10
328	600502	安徽建工	29,200	139,576.00	0.10
329	002020	京新药业	10,900	139,520.00	0.10
330	600361	创新新材	36,000	138,960.00	0.10
331	002476	宝莫股份	32,900	138,838.00	0.10
332	002645	华宏科技	20,200	137,764.00	0.10
333	000783	长江证券	20,100	137,082.00	0.10
334	002635	安洁科技	8,600	136,912.00	0.10
335	600195	中牧股份	20,400	136,884.00	0.10
336	601700	风范股份	30,300	136,350.00	0.10
337	002692	远程股份	34,600	135,632.00	0.10
338	600428	中远海特	18,300	133,590.00	0.10
339	600073	上海梅林	19,200	133,248.00	0.10
340	603127	昭衍新药	8,000	133,040.00	0.10
341	300655	晶瑞电材	14,200	132,912.00	0.10
342	601279	英利汽车	34,700	132,901.00	0.10
343	002317	众生药业	10,900	132,435.00	0.10
344	688088	虹软科技	3,400	131,104.00	0.10
345	600522	中天科技	9,100	130,312.00	0.10
346	300685	艾德生物	5,700	129,960.00	0.10
347	000736	中交地产	15,000	129,000.00	0.09
348	002258	利尔化学	15,500	128,185.00	0.09
349	601100	恒立液压	2,400	126,648.00	0.09
350	688586	江航装备	13,200	126,324.00	0.09
351	601777	力帆科技	16,500	126,225.00	0.09

352	603885	吉祥航空	9,100	124,670.00	0.09
353	600328	中盐化工	15,800	124,346.00	0.09
354	300846	首都在线	8,900	123,799.00	0.09
355	688409	富创精密	2,400	123,768.00	0.09
356	300748	金力永磁	6,900	123,372.00	0.09
357	300124	汇川技术	2,100	123,018.00	0.09
358	000100	TCL 科技	24,400	122,732.00	0.09
359	600757	长江传媒	12,800	122,496.00	0.09
360	000948	南天信息	7,300	122,129.00	0.09
361	605365	立达信	7,700	120,890.00	0.09
362	603618	杭电股份	22,100	120,003.00	0.09
363	300792	壹网壹创	5,000	120,000.00	0.09
364	600961	株冶集团	15,200	119,624.00	0.09
365	601677	明泰铝业	9,900	119,097.00	0.09
366	000612	焦作万方	18,500	118,770.00	0.09
367	002284	亚太股份	15,300	118,422.00	0.09
368	600686	金龙汽车	8,300	116,698.00	0.09
369	603169	兰石重装	21,200	115,540.00	0.08
370	601890	亚星锚链	14,800	115,292.00	0.08
371	688385	复旦微电	3,000	115,170.00	0.08
372	003010	若羽臣	4,100	114,390.00	0.08
373	688711	宏微科技	6,600	114,048.00	0.08
374	002451	摩恩电气	18,100	113,668.00	0.08
375	600928	西安银行	31,300	112,993.00	0.08
376	600739	辽宁成大	10,900	112,815.00	0.08
377	600326	西藏天路	17,400	112,404.00	0.08
378	301338	凯格精机	3,600	112,320.00	0.08
379	600998	九州通	21,800	111,616.00	0.08
380	000927	中国铁物	42,400	111,512.00	0.08
381	002827	高争民爆	4,400	111,364.00	0.08
382	600211	西藏药业	3,000	110,820.00	0.08
383	688779	长远锂科	20,800	110,656.00	0.08
384	600507	方大特钢	27,300	110,565.00	0.08
385	300568	星源材质	11,300	109,836.00	0.08
386	000623	吉林敖东	6,300	108,801.00	0.08
387	000966	长源电力	22,600	107,350.00	0.08
388	002500	山西证券	16,900	106,132.00	0.08
389	003021	兆威机电	1,400	103,474.00	0.08
390	300271	华宇软件	14,300	100,386.00	0.07
391	000790	华神科技	25,700	100,230.00	0.07
392	600595	中孚实业	35,200	99,616.00	0.07
393	601975	招商南油	31,800	99,534.00	0.07
394	000550	江铃汽车	4,200	98,490.00	0.07

395	300428	立中集团	6,000	97,800.00	0.07
396	002266	浙富控股	31,000	96,720.00	0.07
397	600770	综艺股份	22,900	95,951.00	0.07
398	000968	蓝焰控股	14,300	95,095.00	0.07
399	601101	昊华能源	11,500	94,645.00	0.07
400	300400	劲拓股份	5,800	94,076.00	0.07
401	300601	康泰生物	5,400	92,610.00	0.07
402	600459	贵研铂业	6,700	91,991.00	0.07
403	603583	捷昌驱动	3,700	91,427.00	0.07
404	605589	圣泉集团	3,800	89,604.00	0.07
405	600773	西藏城投	8,300	89,474.00	0.07
406	002673	西部证券	10,700	87,205.00	0.06
407	000089	深圳机场	12,400	85,436.00	0.06
408	300140	节能环保	14,100	84,459.00	0.06
409	002773	康弘药业	4,300	84,280.00	0.06
410	002716	湖南白银	24,700	83,733.00	0.06
411	300352	北信源	15,600	82,368.00	0.06
412	300019	硅宝科技	5,600	81,984.00	0.06
413	002100	天康生物	12,500	81,875.00	0.06
414	300861	美畅股份	4,100	81,795.00	0.06
415	300926	博俊科技	3,700	81,437.00	0.06
416	688232	新点软件	2,800	81,172.00	0.06
417	600771	广誉远	4,100	77,326.00	0.06
418	600331	宏达股份	10,100	76,962.00	0.06
419	603530	神马电力	3,100	76,601.00	0.06
420	002454	松芝股份	11,500	76,475.00	0.06
421	600197	伊力特	4,400	75,900.00	0.06
422	601528	瑞丰银行	13,300	74,879.00	0.06
423	600909	华安证券	12,200	73,932.00	0.05
424	002327	富安娜	8,300	73,372.00	0.05
425	002057	中钢天源	10,000	72,200.00	0.05
426	000567	海德股份	10,400	71,032.00	0.05
427	000935	四川双马	4,900	70,952.00	0.05
428	002237	恒邦股份	7,000	70,700.00	0.05
429	002928	华夏航空	9,100	70,616.00	0.05
430	002985	北摩高科	3,000	70,500.00	0.05
431	002461	珠江啤酒	7,100	70,219.00	0.05
432	300011	鼎汉技术	9,400	68,432.00	0.05
433	002961	瑞达期货	4,700	67,539.00	0.05
434	002703	浙江世宝	5,900	67,083.00	0.05
435	300200	高盟新材	8,100	67,068.00	0.05
436	600059	古越龙山	7,500	66,600.00	0.05
437	300119	瑞普生物	3,600	66,132.00	0.05

438	002442	龙星科技	11,000	66,110.00	0.05
439	002274	华昌化工	8,500	66,045.00	0.05
440	300304	云意电气	8,200	65,600.00	0.05
441	000404	长虹华意	8,800	65,120.00	0.05
442	300248	新开普	6,700	64,923.00	0.05
443	600219	南山铝业	16,500	64,515.00	0.05
444	600637	东方明珠	8,300	64,408.00	0.05
445	002654	万润科技	5,300	64,289.00	0.05
446	688131	皓元医药	1,800	64,260.00	0.05
447	300759	康龙化成	2,500	64,250.00	0.05
448	600867	通化东宝	7,900	63,674.00	0.05
449	601211	国泰君安	3,400	63,410.00	0.05
450	002268	电科网安	3,900	63,375.00	0.05
451	600114	东睦股份	3,900	63,063.00	0.05
452	600301	华锡有色	3,700	62,937.00	0.05
453	600468	百利电气	13,200	62,040.00	0.05
454	300402	宝色股份	4,200	61,950.00	0.05
455	600335	国机汽车	9,800	61,054.00	0.04
456	688686	奥普特	800	60,488.00	0.04
457	002886	沃特股份	3,600	59,832.00	0.04
458	002579	中京电子	7,400	58,460.00	0.04
459	688425	铁建重工	13,237	58,242.80	0.04
460	301626	苏州天脉	885	58,215.30	0.04
461	300341	麦克奥迪	3,300	57,783.00	0.04
462	000061	农产品	8,200	57,482.00	0.04
463	000551	创元科技	4,800	57,408.00	0.04
464	000597	东北制药	10,800	56,916.00	0.04
465	000672	上峰水泥	7,400	56,610.00	0.04
466	300171	东富龙	4,100	54,448.00	0.04
467	601827	三峰环境	6,200	53,196.00	0.04
468	002845	同兴达	3,500	53,060.00	0.04
469	300257	开山股份	5,800	52,896.00	0.04
470	301277	新天地	3,800	52,554.00	0.04
471	000965	天保基建	17,100	51,300.00	0.04
472	002192	融捷股份	1,600	51,040.00	0.04
473	688568	中科星图	1,000	51,030.00	0.04
474	600885	宏发股份	1,600	50,912.00	0.04
475	002615	哈尔斯	6,400	50,880.00	0.04
475	300136	信维通信	2,000	50,880.00	0.04
476	001208	华菱线缆	5,600	50,848.00	0.04
477	300120	经纬辉开	5,300	49,290.00	0.04
478	603337	杰克股份	1,600	48,736.00	0.04
479	301282	金禄电子	2,300	48,185.00	0.04

480	600863	内蒙华电	11,100	48,063.00	0.04
481	603205	健尔康	1,278	47,522.80	0.03
482	002043	兔宝宝	4,000	47,520.00	0.03
483	002097	山河智能	6,200	46,500.00	0.03
484	000727	冠捷科技	16,700	46,426.00	0.03
485	001213	中铁特货	11,100	46,287.00	0.03
486	301015	百洋医药	1,900	45,999.00	0.03
487	603687	大胜达	6,300	45,927.00	0.03
488	000700	模塑科技	6,500	45,630.00	0.03
489	600020	中原高速	10,800	45,576.00	0.03
490	002839	张家港行	10,200	44,574.00	0.03
491	300812	易天股份	2,000	44,080.00	0.03
492	600179	安通控股	15,100	42,733.00	0.03
493	600887	伊利股份	1,400	42,252.00	0.03
494	000850	华茂股份	10,000	41,300.00	0.03
495	000951	中国重汽	2,400	40,752.00	0.03
496	600821	金开新能	7,500	40,500.00	0.03
497	002511	中顺洁柔	5,800	39,498.00	0.03
498	600610	中毅达	9,300	39,339.00	0.03
499	300080	易成新能	8,900	38,893.00	0.03
500	603588	高能环境	7,400	38,776.00	0.03
501	000017	深中华 A	6,600	38,280.00	0.03
502	301611	珂玛科技	669	37,530.90	0.03
503	002185	华天科技	3,200	37,152.00	0.03
504	603052	可川科技	1,000	35,610.00	0.03
505	002196	方正电机	6,500	34,840.00	0.03
506	688605	先锋精科	648	34,784.64	0.03
507	601200	上海环境	4,200	34,314.00	0.03
508	300415	伊之密	1,700	34,102.00	0.03
509	688403	汇成股份	3,800	34,048.00	0.03
510	002906	华阳集团	1,100	33,825.00	0.02
511	002340	格林美	5,000	32,650.00	0.02
512	603308	应流股份	2,300	32,430.00	0.02
513	603299	苏盐井神	2,900	32,306.00	0.02
514	002562	兄弟科技	7,600	32,300.00	0.02
515	600805	悦达投资	7,200	31,896.00	0.02
516	300188	国投智能	2,300	31,717.00	0.02
517	300406	九强生物	2,300	30,728.00	0.02
518	002160	常铝股份	7,900	29,388.00	0.02
519	603638	艾迪精密	1,700	28,713.00	0.02
520	300634	彩讯股份	1,300	28,340.00	0.02
521	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.02
522	301153	中科江南	1,000	27,940.00	0.02

523	002544	普天科技	1,300	27,859.00	0.02
524	688262	国芯科技	1,000	27,700.00	0.02
525	300151	昌红科技	1,600	27,200.00	0.02
526	688726	拉普拉斯	798	26,381.88	0.02
527	601326	秦港股份	7,800	26,130.00	0.02
528	688266	泽璟制药	400	24,924.00	0.02
529	002212	天融信	3,800	24,510.00	0.02
530	002224	三力士	5,600	24,192.00	0.02
531	300322	硕贝德	1,800	23,598.00	0.02
532	300053	航宇微	1,800	23,562.00	0.02
533	002960	青鸟消防	2,000	23,340.00	0.02
534	002104	恒宝股份	3,400	22,984.00	0.02
535	688690	纳微科技	1,269	22,334.40	0.02
536	601083	锦江航运	2,300	21,896.00	0.02
537	600109	国金证券	2,500	21,825.00	0.02
538	688750	金天钛业	1,353	20,890.32	0.02
539	002455	百川股份	2,700	20,169.00	0.01
540	688449	联芸科技	678	19,960.32	0.01
541	688615	合合信息	120	19,893.60	0.01
542	600592	龙溪股份	2,000	19,760.00	0.01
543	688327	云从科技	1,600	19,360.00	0.01
544	603348	文灿股份	800	18,928.00	0.01
545	603612	索通发展	1,400	18,914.00	0.01
546	300510	金冠股份	4,400	18,656.00	0.01
547	301522	上大股份	712	17,686.08	0.01
548	600872	中炬高新	800	17,616.00	0.01
549	600959	江苏有线	5,100	17,085.00	0.01
550	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
551	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
552	300001	特锐德	700	15,365.00	0.01
553	600151	航天机电	1,900	15,162.00	0.01
554	603072	天和磁材	1,172	14,415.60	0.01
555	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
556	300480	光力科技	1,100	14,245.00	0.01
557	688708	佳驰科技	286	13,999.70	0.01
558	601377	兴业证券	2,200	13,772.00	0.01
559	002686	亿利达	2,500	13,400.00	0.01
560	600559	老白干酒	600	12,594.00	0.01
561	300579	数字认证	400	12,568.00	0.01
562	300004	南风股份	2,000	12,300.00	0.01
563	603171	税友股份	400	12,200.00	0.01
564	300770	新媒股份	300	12,123.00	0.01
565	002735	王子新材	1,300	12,038.00	0.01

566	600523	贵航股份	1,000	11,920.00	0.01
567	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
568	688710	益诺思	299	10,040.42	0.01
569	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
570	301622	英思特	206	9,253.52	0.01
571	301613	新铝时代	211	8,813.47	0.01
572	301606	绿联科技	241	8,794.09	0.01
573	301631	壹连科技	85	8,666.60	0.01
574	301552	科力装备	143	8,132.41	0.01
575	600528	中铁工业	1,000	8,060.00	0.01
576	301608	博实结	120	7,845.60	0.01
577	301603	乔锋智能	181	7,598.38	0.01
578	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.01
579	001391	国货航	1,080	7,344.00	0.01
580	000582	北部湾港	900	7,092.00	0.01
581	002093	国脉科技	900	7,020.00	0.01
582	001301	尚太科技	100	6,855.00	0.01
583	600495	晋西车轴	1,800	6,840.00	0.01
584	301585	蓝宇股份	186	6,668.10	0.00
585	000958	电投产融	1,000	6,230.00	0.00
586	301617	博苑股份	155	6,167.45	0.00
587	600562	国睿科技	300	5,979.00	0.00
588	003035	南网能源	1,400	5,852.00	0.00
589	300320	海达股份	600	5,760.00	0.00
590	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
591	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
592	600908	无锡银行	800	4,728.00	0.00
593	300353	东土科技	400	4,592.00	0.00
594	603997	继峰股份	400	4,580.00	0.00
595	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
596	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
597	603194	中力股份	118	3,319.34	0.00
598	603391	力聚热能	75	3,101.25	0.00
599	301321	翰博高新	200	2,880.00	0.00
600	603285	键邦股份	103	2,328.83	0.00
601	603310	巍华新材	113	2,028.35	0.00
602	300139	晓程科技	100	1,459.00	0.00
603	000045	深纺织 A	100	1,063.00	0.00
604	000088	盐田港	200	974.00	0.00
605	600916	中国黄金	100	862.00	0.00
606	600727	鲁北化工	100	741.00	0.00
607	600353	旭光电子	100	722.00	0.00
608	603993	洛阳钼业	100	665.00	0.00

## 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	300475	香农芯创	9,020,242.94	3.18
2	002174	游族网络	8,917,843.00	3.14
3	002043	兔宝宝	6,324,559.00	2.23
4	000762	西藏矿业	5,913,906.65	2.08
5	601918	新集能源	5,465,916.00	1.92
6	688568	中科星图	5,237,093.90	1.84
7	300065	海兰信	5,214,428.28	1.84
8	300134	大富科技	5,203,472.70	1.83
9	600776	东方通信	5,195,521.00	1.83
10	300618	寒锐钴业	4,938,257.39	1.74
11	600761	安徽合力	4,923,555.00	1.73
12	002292	奥飞娱乐	4,849,894.00	1.71
13	000032	深桑达 A	4,752,020.38	1.67
14	600667	太极实业	4,746,675.00	1.67
15	688110	东芯股份	4,721,976.16	1.66
16	301205	联特科技	4,695,434.00	1.65
17	300456	赛微电子	4,630,063.00	1.63
18	000552	甘肃能化	4,574,737.00	1.61
19	600718	东软集团	4,518,569.00	1.59
20	688167	炬光科技	4,481,918.56	1.58

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	002174	游族网络	8,855,597.00	3.12
2	300475	香农芯创	8,749,211.53	3.08
3	300065	海兰信	7,944,337.26	2.80
4	688110	东芯股份	6,584,687.74	2.32
5	002043	兔宝宝	6,407,345.00	2.26
6	601918	新集能源	6,264,554.00	2.21
7	002276	万马股份	5,773,419.00	2.03
8	688568	中科星图	5,608,143.95	1.97
9	000762	西藏矿业	5,525,587.00	1.95
10	002456	欧菲光	5,506,770.00	1.94
11	300613	富瀚微	5,434,359.68	1.91
12	002617	露笑科技	5,186,778.00	1.83

13	300455	航天智装	5,154,528.00	1.81
14	600556	天下秀	5,152,898.00	1.81
15	002405	四维图新	5,103,772.63	1.80
16	600718	东软集团	5,088,356.00	1.79
17	300762	上海瀚讯	5,058,414.00	1.78
18	601801	皖新传媒	5,000,012.00	1.76
19	688578	艾力斯	4,944,180.04	1.74
20	300618	寒锐钴业	4,837,021.00	1.70

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	2,495,965,536.24
卖出股票收入（成交）总额	2,647,505,930.70

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额

（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间因市场流动性或者股指期货贴水较大时，我们有使用股指期货套保调整或保持仓位。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	571,756.80
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	377,053.21
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	948,810.01

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
华泰柏瑞中证 1000	820	107,783.33	4,944,878.10	5.59	83,437,449.50	94.41

指数增强 A						
华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	660	62,893.89	0.00	0.00	41,509,968.75	100.00
合计	1,463	88,784.89	4,944,878.10	3.81	124,947,418.25	96.19

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	0.00	0.0000
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	45,233.43	0.1090
	合计	45,233.43	0.0348

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	0
	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 A	华泰柏瑞中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 19 日) 基金份额总额	237,197,469.05	110,701,240.53
本报告期期初基金 份额总额	201,087,977.65	85,558,029.11
本报告期基金总申 购份额	66,388,262.40	22,000,424.04

减：本报告期基金 总赎回份额	179,093,912.45	66,048,484.40
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	88,382,327.60	41,509,968.75

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

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

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

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

2024年7月11日，公司全体员工投票推选赵景云女士担任公司职工监事。

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金本年度支付给审计机构德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 35,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1

年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
中金财富 证券	3	5,140,537.0 36.03	100.00	1,399,283.8 6	100.00	-

注：1. 选择证券公司参与证券交易的标准

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

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

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

## 2. 选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

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

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

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

4. 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(%)
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 19 日

2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 05 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 27 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 18 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 02 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 24 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 27 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 19 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳前海财厚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 04 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 08 月 16 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 24 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 19 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 18 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 13 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 06 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 03 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日

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期内分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 日
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	2024 年 02 月 24 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 21 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》

- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日