

# 华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金于 2022 年 7 月 21 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2022 年 7 月 21 日开始计算。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 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	58

7.7 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 .....	59
7.8 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 .....	59
7.9 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 .....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
7.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
8.3 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 .....	60
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
10.2 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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
11.1 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 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞积极优选股票	
基金主代码	001097	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	690,404,887.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞积极优选股票 A	华泰柏瑞积极优选股票 C
下属分级基金的交易代码	001097	016283
报告期末下属分级基金的份额总额	298,148,371.65 份	392,256,516.10 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以对经济周期和产业周期的研究判断为基础，优选受益于经济发展、市场改革且处于行业领先地位的上市公司证券，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：80%*沪深 300 指数收益率+20%*中债国债总指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-888-0001	021-60637228
传真	021-38601799	021-60635778
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	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
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 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	华泰柏瑞积极优选股票 A	华泰柏瑞积极优选股票 C	
本期已实现收益	-2,811,799.99	-6,804,155.50	
本期利润	17,230,042.44	21,656,709.50	
加权平均基金份额本期利润	0.0835	0.0622	
本期加权平均净值利润率	7.56%	5.66%	
本期基金份额净值增长率	10.27%	9.90%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利润	41,132,695.27	51,841,764.13
	期末可供分配基金份额利润	0.1380	0.1322
	期末基金资产净值	339,281,066.92	444,098,280.23
	期末基金份额净值	1.138	1.132

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	13.80%	4.43%

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

华泰柏瑞积极优选股票 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
过去一个月	2.06%	1.55%	1.00%	0.69%	1.06%	0.86%
过去三个月	4.21%	1.49%	-3.89%	0.66%	8.10%	0.83%
过去六个月	10.27%	1.32%	-0.28%	0.67%	10.55%	0.65%
过去一年	6.06%	1.59%	-11.16%	0.79%	17.22%	0.80%
过去三年	46.65%	1.73%	-4.90%	0.96%	51.55%	0.77%
自基金合同生效起至今	13.80%	1.77%	2.44%	1.13%	11.36%	0.64%

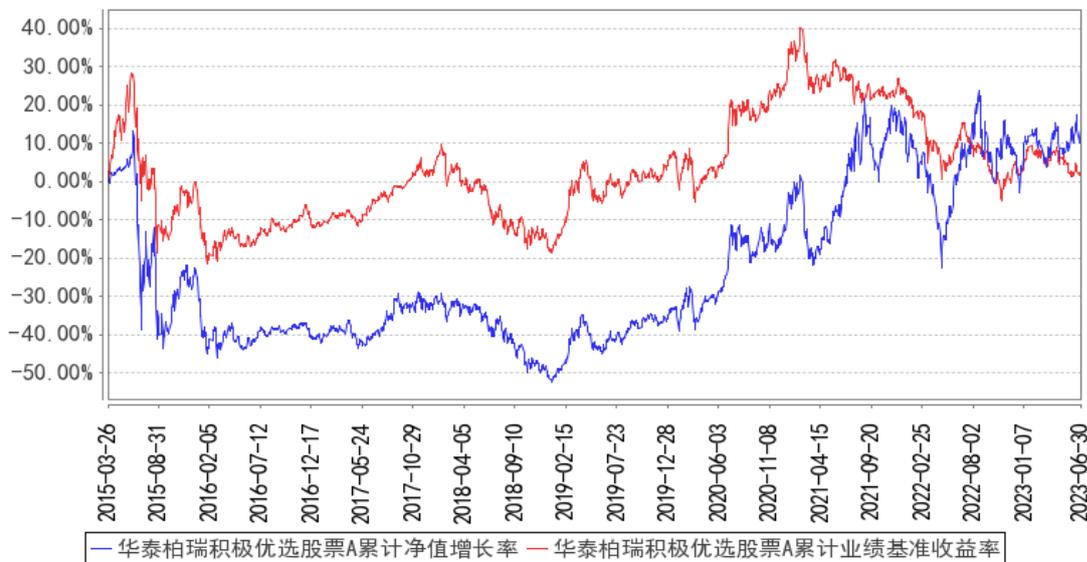
华泰柏瑞积极优选股票 C

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
过去一个月	1.98%	1.54%	1.00%	0.69%	0.98%	0.85%
过去三个月	4.04%	1.47%	-3.89%	0.66%	7.93%	0.81%
过去六个月	9.90%	1.32%	-0.28%	0.67%	10.18%	0.65%
自基金合同生效起至今	4.43%	1.60%	-7.92%	0.79%	12.35%	0.81%

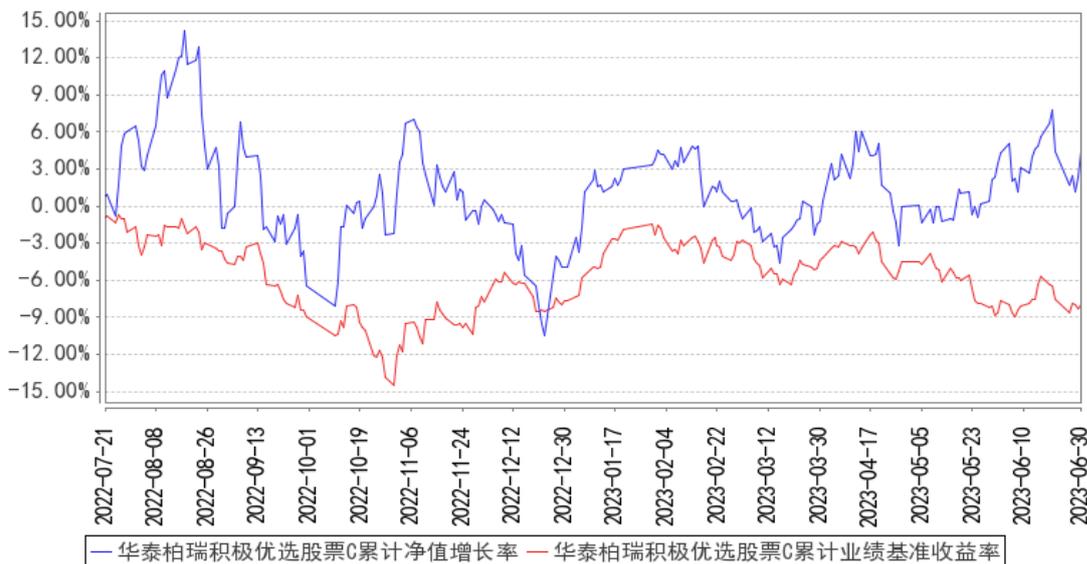
注：本基金于 2022 年 7 月 21 日新增 C 类份额，C 类指标计算日期为 2022 年 7 月 21 日至 2023 年 6 月 30 日。

### 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

华泰柏瑞积极优选股票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



华泰柏瑞积极优选股票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：A类图示日期为 2015 年 3 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2022 年 7 月 21 日至 2023 年 6 月 30 日。

## § 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、华泰柏瑞精选回报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、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞景利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。截至 2023 年 6 月 30 日,公司基金管理规模为 3,348.66 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		
杜聪	本基金的基金经理	2020 年 8 月 26 日	-	9 年	复旦大学金融学硕士，曾任大成基金管理有限公司研究员。2016 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任投资研究部研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。2020 年 8 月起任华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金的基金经理。
钱建江	本基金的基金经理助理	2022 年 11 月 16 日	-	8 年	华中科技大学系统工程专业硕士。曾任国元证券研究中心机械行业研究员、太平洋证券研究院机械行业研究员。2021 年 6 月

					加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2022 年 6 月起任基金经理助理。
陈文凯	本基金的基金经理助理	2022 年 11 月 16 日	-	8 年	上海交通大学金融专业硕士。曾担任中金公司食品饮料分析师。2019 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2021 年 12 月起任基金经理助理。

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。杜聪 2023 年 8 月 17 日离任本基金基金经理。陈文凯 2023 年 8 月 1 日离任本基金基金经理助理。钱建江 2023 年 8 月 17 日离任本基金基金经理助理。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，其中 1 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 4 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

基金投研理念是以自下而上的深入基本面研究为核心，选择具备可持续高质量成长且估值有吸引力的公司进行投资。积极优选在本报告期内坚持这个理念不放松，努力在成长行业里面挖掘具备竞争优势的公司并长期持有。

整体上看好 2023 年下半年行情，主要是外部环境相比于 2022 年大概率会更加稳定一些。

### 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积极优选股票 A 的基金份额净值为 1.138 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.27%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%，截至本报告期末华泰柏瑞积极优选股票 C 的基金份额净值为 1.132 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.90%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

创新产业在 2023 年下半年的机会，可能表现在：

1、元宇宙硬件创新。21 年 Quest2 打开元宇宙正向循环，内容产业链和硬件产业链互相促进开始加速发展。Quest2 更多是游戏主机（历史全球每年销量 0.5 亿部）的对标，且目前触达到了销量天花板。未来随着硅基 OLED、瞳距自动调节、更加便携化、甚至于 AR 光波导等技术发展及内容（如办公、社交）更加丰富，元宇宙硬件销量可向手机（历史全球每年销量天花板 16 亿部）逐步靠近，且单价有所上升，能看到或有数百倍的行业成长潜力。在这个长期成长过程中，提升用户体验的硬件创新及爆款应用至关重要。苹果 MR 虽然产品还未正式对公众销售，但从评测视频及发布会来看，其软硬件创新有可能带来行业增速拐点，里面机会值得重点关注。

2、汽车电动化和智能化。汽车电动化行业因为国内需求增速降速导致贝塔较弱，不过前期下跌可能已经释放大部分风险。目前对行业景气度有较好指引意义的碳酸锂价格已经从低位回升 2 个多月，行业基本面已经好转，且复合箔、磷酸锰铁锂、SiC、硅基负极等新材料的逐步导入有望带来结构性的机会。另外特斯拉 FSD 将在明年推出 V12 版本，该版本所使用的技术路径相比之前版本有明显变化，如果上路取得不错效果，汽车智能化或将迎来加速发展。

3、新能源消纳。2023 年下半年开始，新能源新增装机量的瓶颈可能在于消纳能力，消纳行业有望迎来加速发展。短期看，全球气候变化导致今明两年高温，缺电问题可能突出，催动产业加速适应新型电力系统建设的需求。关注储能、功率预测、现货交易、火电灵活性改造投资机会。另外光伏组件价格跳跃式降价，氢能商用化的核心矛盾点——成本也会跟随加速下降，目前行业也在拐点向上。

4、人工智能。海外人工智能技术发展超预期，行业空间大叠加进入事实加速阶段，但落实到 A 股上，前期更多是主题概念投资，但未来大概率会有公司有成熟的产品及商业模式出现，可投资性随时间推移不断提升。AI 算力由于确定性相对较高，因此在 AI 早期行情中表现较为突出。后续 AI 行情是否能持续且创出新高，要看 AI 应用落地进展是否能超预期。由于具身智能概率的提出，机器人作为人工智能的终局思维方向，机会可能和人工智能板块趋同。

5、半导体国产替代。目前设备端的预期回报率普遍不够，设计端和材料端的预期回报率较为充足，对半导体国产化替代的研究重点可能会放在设计端，积极探索需求有恢复迹象的细分领域。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	93,096,959.87	35,453,749.00
结算备付金		3,830,502.73	848,060.98
存出保证金		354,373.01	82,519.52
交易性金融资产	6.4.7.2	707,549,387.30	225,001,613.35
其中：股票投资		707,549,387.30	225,001,613.35
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		15,464,112.39	-
应收股利		-	-
应收申购款		121,753.88	239,137.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		820,417,089.18	261,625,080.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		8,070,428.19	8,811,009.66
应付赎回款		24,943,262.58	192,518.31
应付管理人报酬		1,097,431.95	249,629.05
应付托管费		182,905.33	41,604.83
应付销售服务费		275,087.53	36,332.64
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	6.4.7.9	2,468,626.45	592,927.97
负债合计		37,037,742.03	9,924,022.46
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	690,404,887.75	244,171,626.40
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	92,974,459.40	7,529,431.66
净资产合计		783,379,347.15	251,701,058.06
负债和净资产总计		820,417,089.18	261,625,080.52

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 690,404,887.75 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.138 元，基金份额总额 298,148,371.65 份；下属 C 类基金份额净值 1.132 元，基金份额总额 392,256,516.10 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		45,364,517.08	-11,257,472.81
1. 利息收入		150,260.58	30,492.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	150,260.58	30,492.56
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,621,288.22	-12,887,991.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,696,694.17	-13,192,556.21
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,075,405.95	304,564.43
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）	6.4.7.20	48,502,707.43	1,589,819.89
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	332,837.29	10,206.52
<b>减：二、营业总支出</b>		6,477,765.14	1,214,352.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,499,441.99	957,931.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	749,907.08	159,655.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,129,310.38	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	99,105.69	96,765.45
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		38,886,751.94	-12,471,825.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		38,886,751.94	-12,471,825.21
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		38,886,751.94	-12,471,825.21

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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(基金净值)	244,171,626.40	-	7,529,431.66	251,701,058.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	244,171,626.40	-	7,529,431.66	251,701,058.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	446,233,261.35	-	85,445,027.74	531,678,289.09
(一)、综合收益总额	-	-	38,886,751.94	38,886,751.94
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	446,233,261.35	-	46,558,275.80	492,791,537.15
其中：1. 基金申购款	842,468,894.47	-	82,813,061.50	925,281,955.97
2. 基金赎回款	-396,235,633.12	-	-36,254,785.70	-432,490,418.82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	690,404,887.75	-	92,974,459.40	783,379,347.15
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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(基金净值)	131,034,729.10	-	22,200,677.81	153,235,406.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	131,034,729.10	-	22,200,677.81	153,235,406.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,287,464.91	-	-12,788,703.46	-15,076,168.37
(一)、综合收益总额	-	-	-12,471,825.21	-12,471,825.21
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,287,464.91	-	-316,878.25	-2,604,343.16
其中：1. 基金申购款	5,879,148.79	-	26,019.61	5,905,168.40
2. 基金赎回款	-8,166,613.70	-	-342,897.86	-8,509,511.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	128,747,264.19	-	9,411,974.35	138,159,238.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金(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[2015]第 250 号《关于准予华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和

《华泰柏瑞积极优选股票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 1,706,729,101.43 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(2015)第 186 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金合同》于 2015 年 3 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,706,941,661.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 212,560.10 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞积极优选股票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，包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、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、权证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)。本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的 80%-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 80%X 沪深 300 指数收益率+20%X 中债国债总指数收益率。

根据本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 7 月 21 日发布的《关于华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，本基金自 2022 年 7 月 21 日起增设 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取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；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，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。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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 2023 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 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》、《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间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 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	93,096,959.87
等于：本金	93,087,388.97
加：应计利息	9,570.90
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	93,096,959.87

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	662,090,737.06	-	707,549,387.30	45,458,650.24
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	662,090,737.06	-	707,549,387.30	45,458,650.24

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	76.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,381,769.18
其中：交易所市场	2,381,769.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	2,468,626.45

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞积极优选股票 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	119,275,850.88	119,275,850.88
本期申购	220,065,410.73	220,065,410.73
本期赎回 (以“-”号填列)	-41,192,889.96	-41,192,889.96
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	298,148,371.65	298,148,371.65

华泰柏瑞积极优选股票 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	124,895,775.52	124,895,775.52
本期申购	622,403,483.74	622,403,483.74
本期赎回 (以“-”号填列)	-355,042,743.16	-355,042,743.16
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	392,256,516.10	392,256,516.10

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未有其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞积极优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,292,118.72	-17,455,928.72	3,836,190.00
本期利润	-2,811,799.99	20,041,842.43	17,230,042.44
本期基金份额交易产生的变动数	31,868,533.11	-11,802,070.28	20,066,462.83
其中：基金申购款	39,112,259.17	-15,747,516.62	23,364,742.55
基金赎回款	-7,243,726.06	3,945,446.34	-3,298,279.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,348,851.84	-9,216,156.57	41,132,695.27

华泰柏瑞积极优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	21,910,637.25	-18,217,395.59	3,693,241.66
本期利润	-6,804,155.50	28,460,865.00	21,656,709.50
本期基金份额交易产生的变动数	48,836,922.05	-22,345,109.08	26,491,812.97
其中：基金申购款	107,778,489.50	-48,330,170.55	59,448,318.95
基金赎回款	-58,941,567.45	25,985,061.47	-32,956,505.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,943,403.80	-12,101,639.67	51,841,764.13

#### 6.4.7.13 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6月30日	
活期存款利息收入	128,183.47	
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	20,354.78	
其他	1,722.33	
合计	150,260.58	

注：其他为结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 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6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,696,694.17	
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	-5,696,694.17	

##### 6.4.7.14.2 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6月30日	
卖出股票成交总额	1,821,195,279.92	
减：卖出股票成本总额	1,821,081,522.42	
减：交易费用	5,810,451.67	
买卖股票差价收入	-5,696,694.17	

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,075,405.95
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	2,075,405.95

#### 6.4.7.20 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6月30日
1. 交易性金融资产	48,502,707.43
股票投资	48,502,707.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	48,502,707.43

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	314,230.75
基金转换费收入	18,606.54
合计	332,837.29

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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,325.24
银行间费用	9,000.00
合计	99,105.69

#### 6.4.7.24 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，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	8,520.00	0.00	64,581,257.95	11.62

##### 6.4.10.1.2 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。

##### 6.4.10.1.3 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6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	5.11	0.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	59,783.42	11.73	-	-

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	4,499,441.99	957,931.63
其中：支付销售机构的客户维护费	720,346.77	441,364.30

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.2.2 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 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	749,907.08	159,655.32

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞积极优选股票	华泰柏瑞积极优选股票	合计
	A	C	
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	645,625.61	645,625.61
合计	0.00	645,625.61	645,625.61
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞积极优选股票 A	华泰柏瑞积极优选股票 C	合计
合计	-	-	-

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 0.6% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	93,096,959.87	128,183.47	13,107,423.60	26,598.05

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

#### 6.4.10.7 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 6 月 30 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
华泰联合证券有限责任公司	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券有限责任公司	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券有限责任公司	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券有限责任公司	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券有限责任公司	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合证券有限责任公司	688469	中芯集成	网下申购	55,197	314,070.93
华泰联合证券有限责任公司	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券有限责任公司	688472	阿特斯	网下申购	27,127	301,109.70
华泰联合证券有限责任公司	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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
华泰联合证券有限责任公司	301207	华兰疫苗	网下申购	836	47,551.68

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：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。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	11.88	21.02	661	7,852.68	13,894.22	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定期内	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定期内	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	38.13	31.03	1,162	44,307.06	36,056.86	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定期内	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定期内	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定期内	5.00	8.96	1,341	6,705.00	12,015.36	-

301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定期内	32.34	31.86	550	17,787.00	17,523.00	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定期内	20.67	26.17	481	9,942.27	12,587.77	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定期内	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定期内	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	76.80	107.95	300	23,040.00	32,385.00	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定期内	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	73.45	46.64	166	12,192.70	7,742.24	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定期内	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定期内	23.77	42.89	344	8,176.88	14,754.16	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定期内	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定期内	33.73	31.85	228	7,690.44	7,261.80	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定期内	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定期内	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股锁定期内	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股锁定期内	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定期内	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定期内	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定期内	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-

301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	19.99	16.90	475	9,495.25	8,027.50	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期内	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	6.58	7.58	1,561	10,271.38	11,832.38	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	10.36	11.84	584	6,050.24	6,914.56	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	11.66	12.26	516	6,016.56	6,326.16	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股锁定期内	17.80	17.89	502	8,935.60	8,980.78	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股锁定期内	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定期内	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定期内	36.15	38.13	517	18,689.55	19,713.21	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定期内	19.86	18.06	3,085	61,268.10	55,715.10	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定期内	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定期内	12.10	12.07	1,535	18,573.50	18,527.45	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定期内	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定期内	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	37.88	29.49	1,734	65,683.92	51,135.66	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	75.00	90.76	214	16,050.00	19,422.64	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定期内	5.69	5.41	5,520	31,408.80	29,863.20	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定期内	11.10	17.04	2,713	30,114.30	46,229.52	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定期内	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-

688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	39.99	36.71	504	20,154.96	18,501.84	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定期内	245.56	122.11	129	21,363.72	15,752.19	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定期内	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定期内	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股锁定期内	152.38	135.97	173	26,361.74	23,522.81	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688539	高华科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定期内	38.22	43.49	5,334	203,865.48	231,975.66	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定期内	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定期内	21.17	23.50	717	15,178.89	16,849.50	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定期内	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定期内	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定期内	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定期内	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，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。

2、基金还可作为特定投资者，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。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、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设定限售期的新股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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### 6.4.12.4 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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和债券投资等。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

#### 6.4.13.2 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中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 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 2023 年 6 月 30 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。

##### 6.4.13.3.1 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 6.4.12。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 6 月 30 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 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
<b>资产</b>							
银行存款	93,096,959.87	-	-	-	-	-	93,096,959.87
结算备付金	3,830,502.73	-	-	-	-	-	3,830,502.73
存出保证金	354,373.01	-	-	-	-	-	354,373.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-707,549,387.30	707,549,387.30
应收申购款	-	-	-	-	-	121,753.88	121,753.88
应收清算款	-	-	-	-	-	15,464,112.39	15,464,112.39
资产总计	97,281,835.61	-	-	-	-	-723,135,253.57	820,417,089.18
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,943,262.58	24,943,262.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,097,431.95	1,097,431.95
应付托管费	-	-	-	-	-	182,905.33	182,905.33
应付清算款	-	-	-	-	-	8,070,428.19	8,070,428.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	275,087.53	275,087.53
其他负债	-	-	-	-	-	2,468,626.45	2,468,626.45
负债总计	-	-	-	-	-	37,037,742.03	37,037,742.03
利率敏感度缺口	97,281,835.61	-	-	-	-	-686,097,511.54	783,379,347.15
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
<b>资产</b>							
银行存款	35,453,749.00	-	-	-	-	-	35,453,749.00
结算备付金	848,060.98	-	-	-	-	-	848,060.98
存出保证金	82,519.52	-	-	-	-	-	82,519.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-225,001,613.35	225,001,613.35
应收申购款	-	-	-	-	-	239,137.67	239,137.67
资产总计	36,384,329.50	-	-	-	-	-225,240,751.02	261,625,080.52
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	192,518.31	192,518.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	249,629.05	249,629.05
应付托管费	-	-	-	-	-	41,604.83	41,604.83
应付清算款	-	-	-	-	-	8,811,009.66	8,811,009.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	36,332.64	36,332.64
其他负债	-	-	-	-	-	592,927.97	592,927.97
负债总计	-	-	-	-	-	9,924,022.46	9,924,022.46
利率敏感度缺口	36,384,329.50	-	-	-	-	-215,316,728.56	251,701,058.06

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	707,549,387.30	90.32	225,001,613.35	89.39
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	707,549,387.30	90.32	225,001,613.35	89.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

沪深 300 指数上升 5%	31,019,337.91	11,183,249.65
沪深 300 指数下降 5%	-31,019,337.91	-11,183,249.65

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	705,514,911.47	224,682,298.95
第二层次	716,382.54	-
第三层次	1,318,093.29	319,314.40
合计	707,549,387.30	225,001,613.35

###### 6.4.14.2.2 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 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)。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	707,549,387.30	86.24
	其中：股票	707,549,387.30	86.24
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	96,927,462.60	11.81
8	其他各项资产	15,940,239.28	1.94
9	合计	820,417,089.18	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	-	-
C	制造业	377,188,479.49	48.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	15,038,421.91	1.92
F	批发和零售业	50,079.85	0.01
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	240,674,439.93	30.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	47,713,431.22	6.09
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	26,810,478.00	3.42
S	综合	-	-
	合计	707,549,387.30	90.32

### 7.2.2 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。

### 7.3 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	301162	国能日新	523,860	41,322,076.80	5.27
2	688025	杰普特	394,997	34,502,987.95	4.40
3	002315	焦点科技	787,312	31,492,480.00	4.02
4	300567	精测电子	324,579	30,883,691.85	3.94
5	002475	立讯精密	840,300	27,267,735.00	3.48
6	300750	宁德时代	109,480	25,047,929.20	3.20
7	301045	天禄科技	886,800	23,482,464.00	3.00
8	300188	美亚柏科	1,127,400	23,438,646.00	2.99
9	002254	泰和新材	950,813	23,266,394.11	2.97
10	300769	德方纳米	196,888	21,702,964.24	2.77
11	002992	宝明科技	347,500	21,642,300.00	2.76
12	688248	南网科技	500,966	19,232,084.74	2.46
13	002846	英联股份	1,401,400	17,965,948.00	2.29
14	002230	科大讯飞	259,400	17,628,824.00	2.25
15	688590	新致软件	772,038	17,548,423.74	2.24
16	603105	芯能科技	1,037,000	17,514,930.00	2.24
17	300394	天孚通信	163,380	17,453,885.40	2.23
18	688496	清越科技	850,657	16,911,061.16	2.16
19	605376	博迁新材	524,700	16,465,086.00	2.10
20	688372	伟测科技	107,404	16,448,922.60	2.10
21	300170	汉得信息	1,405,200	16,216,008.00	2.07
22	300299	富春股份	2,048,200	16,057,888.00	2.05
23	688501	青达环保	717,058	15,954,540.50	2.04

24	603186	华正新材	462,400	15,906,560.00	2.03
25	301052	果麦文化	316,300	15,599,916.00	1.99
26	603000	人民网	533,120	15,567,104.00	1.99
27	688392	骄成超声	139,134	15,442,482.66	1.97
28	300982	苏文电能	248,179	15,029,720.24	1.92
29	601226	华电重工	1,911,200	14,983,808.00	1.91
30	688111	金山办公	31,303	14,781,902.66	1.89
31	003035	南网能源	1,893,700	13,483,144.00	1.72
32	688232	新点软件	250,240	13,465,414.40	1.72
33	002517	恺英网络	853,500	13,434,090.00	1.71
34	300513	恒实科技	946,700	13,111,795.00	1.67
35	300364	中文在线	629,100	11,210,562.00	1.43
36	688630	芯碁微装	93,043	7,817,472.86	1.00
37	301387	光大同创	155,900	7,690,547.00	0.98
38	300031	宝通科技	263,000	6,501,360.00	0.83
39	300257	开山股份	133,800	2,029,746.00	0.26
40	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.04
41	688539	高华科技	5,334	231,975.66	0.03
42	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
43	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
44	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
45	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
46	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
47	688249	晶合集成	3,085	55,715.10	0.01
48	688443	智翔金泰	1,734	51,135.66	0.01
49	688472	阿特斯	2,713	46,229.52	0.01
50	301291	明阳电气	1,162	36,056.86	0.00
51	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
52	301325	曼恩斯特	300	32,385.00	0.00
53	688469	中芯集成	5,520	29,863.20	0.00
54	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
55	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
56	688531	日联科技	173	23,522.81	0.00
57	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
58	688146	中船特气	517	19,713.21	0.00
59	688458	美芯晟	214	19,422.64	0.00
60	688352	颀中科技	1,535	18,527.45	0.00
61	688484	南芯科技	504	18,501.84	0.00
62	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
63	301307	美利信	550	17,523.00	0.00
64	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
65	688552	航天南湖	717	16,849.50	0.00
66	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00

67	688507	索辰科技	129	15,752.19	0.00
68	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
69	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
70	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
71	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
72	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
73	301358	湖南裕能	344	14,754.16	0.00
74	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
75	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
76	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
77	001287	中电港	661	13,894.22	0.00
78	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
79	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
80	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
81	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
82	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
83	301317	鑫磊股份	481	12,587.77	0.00
84	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
85	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
86	301301	川宁生物	1,341	12,015.36	0.00
87	601061	中信金属	1,561	11,832.38	0.00
88	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
89	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
90	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
91	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
92	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
93	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
94	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
95	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
96	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
97	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
98	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
99	603135	中重科技	502	8,980.78	0.00
100	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
101	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
102	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
103	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
104	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
105	301439	泓淋电力	475	8,027.50	0.00
106	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
107	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
108	301345	涛涛车业	166	7,742.24	0.00
109	301373	凌玮科技	228	7,261.80	0.00

110	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
111	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
112	601065	江盐集团	584	6,914.56	0.00
113	601133	柏诚股份	516	6,326.16	0.00
114	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
115	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
116	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
117	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
118	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
119	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
120	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	605376	博迁新材	46,478,930.36	18.47
2	300394	天孚通信	44,410,732.78	17.64
3	002315	焦点科技	37,569,419.88	14.93
4	688025	杰普特	37,544,017.12	14.92
5	002291	遥望科技	36,913,149.00	14.67
6	688392	骄成超声	35,176,377.12	13.98
7	301162	国能日新	32,964,439.20	13.10
8	000503	国新健康	32,689,405.00	12.99
9	002254	泰和新材	32,597,351.82	12.95
10	002230	科大讯飞	31,037,507.92	12.33
11	601226	华电重工	30,648,518.67	12.18
12	300274	阳光电源	29,680,127.00	11.79
13	300188	美亚柏科	29,633,737.35	11.77
14	300750	宁德时代	27,063,888.20	10.75
15	688678	福立旺	26,962,113.53	10.71
16	002475	立讯精密	26,776,859.00	10.64
17	300031	宝通科技	26,731,863.08	10.62
18	000690	宝新能源	26,024,736.00	10.34
19	688318	财富趋势	25,697,172.40	10.21
20	003021	兆威机电	25,519,366.73	10.14
21	603019	中科曙光	25,481,232.02	10.12
22	300253	卫宁健康	25,427,280.60	10.10
23	301045	天禄科技	24,983,790.14	9.93
24	300567	精测电子	24,866,996.61	9.88
25	603000	人民网	24,094,738.80	9.57
26	688496	清越科技	23,753,437.88	9.44
27	688232	新点软件	23,675,687.85	9.41

28	688248	南网科技	23,196,890.32	9.22
29	300624	万兴科技	22,482,028.95	8.93
30	300459	汤姆猫	22,382,968.00	8.89
31	300033	同花顺	22,371,913.00	8.89
32	002517	恺英网络	21,388,870.71	8.50
33	688297	中无人机	20,876,404.20	8.29
34	300769	德方纳米	20,853,158.00	8.28
35	300299	富春股份	20,656,252.00	8.21
36	603105	芯能科技	20,329,567.87	8.08
37	603927	中科软	19,665,999.55	7.81
38	002992	宝明科技	18,784,730.00	7.46
39	300982	苏文电能	18,600,680.60	7.39
40	601677	明泰铝业	18,318,394.00	7.28
41	002791	坚朗五金	18,160,286.40	7.22
42	603737	三棵树	18,159,326.57	7.21
43	688111	金山办公	18,070,865.87	7.18
44	301052	果麦文化	18,008,700.45	7.15
45	688590	新致软件	17,984,769.02	7.15
46	603186	华正新材	17,868,296.28	7.10
47	002846	英联股份	17,857,747.76	7.09
48	300118	东方日升	17,796,913.74	7.07
49	300513	恒实科技	17,582,054.60	6.99
50	003035	南网能源	16,955,795.00	6.74
51	300693	盛弘股份	16,676,728.60	6.63
52	300257	开山股份	16,482,663.00	6.55
53	000021	深科技	15,974,719.00	6.35
54	688122	西部超导	15,626,594.39	6.21
55	603051	鹿山新材	15,623,369.64	6.21
56	300170	汉得信息	15,341,225.00	6.10
57	688372	伟测科技	14,814,535.14	5.89
58	600556	天下秀	14,724,896.00	5.85
59	300130	新国都	14,535,793.00	5.78
60	688031	星环科技	14,476,428.98	5.75
61	002769	普路通	14,149,774.00	5.62
62	300235	方直科技	13,635,059.88	5.42
63	688502	茂莱光学	13,570,208.61	5.39
64	603501	韦尔股份	13,226,740.89	5.25
65	688095	福昕软件	13,125,078.28	5.21
66	300413	芒果超媒	13,124,214.00	5.21
67	002402	和而泰	12,908,461.64	5.13
68	002970	锐明技术	12,898,305.94	5.12
69	300364	中文在线	12,760,021.88	5.07
70	688246	嘉和美康	12,722,766.54	5.05

71	000719	中原传媒	12,409,132.70	4.93
72	688475	萤石网络	12,188,014.74	4.84
73	300082	奥克股份	12,115,510.16	4.81
74	603039	ST 泛微	11,933,412.60	4.74
75	688083	中望软件	11,465,928.82	4.56
76	002410	广联达	11,376,460.00	4.52
77	300059	东方财富	11,373,259.00	4.52
78	688501	青达环保	11,371,841.78	4.52
79	688789	宏华数科	10,834,680.77	4.30
80	002131	利欧股份	10,768,117.00	4.28
81	688037	芯源微	10,731,850.46	4.26
82	688188	柏楚电子	10,709,940.31	4.26
83	002415	海康威视	10,645,844.00	4.23
84	601360	三六零	10,457,725.00	4.15
85	600415	小商品城	10,386,934.84	4.13
86	002865	钧达股份	10,253,221.00	4.07
87	300451	创业慧康	10,212,874.50	4.06
88	300034	钢研高纳	10,150,355.00	4.03
89	603916	苏博特	10,023,177.00	3.98
90	301018	申菱环境	9,858,747.00	3.92
91	300081	恒信东方	9,314,572.00	3.70
92	002271	东方雨虹	9,147,259.00	3.63
93	301387	光大同创	9,074,464.74	3.61
94	301312	智立方	9,068,021.64	3.60
95	002837	英维克	8,763,456.00	3.48
96	002046	国机精工	8,674,766.90	3.45
97	300687	赛意信息	8,445,097.48	3.36
98	603918	金桥信息	8,091,335.83	3.21
99	603061	金海通	8,064,412.64	3.20
100	000636	风华高科	7,715,790.00	3.07
101	688630	芯碁微装	7,635,751.24	3.03
102	600373	中文传媒	7,469,024.82	2.97
103	300803	指南针	7,454,401.00	2.96
104	600237	铜峰电子	7,283,959.00	2.89
105	301078	孩子王	7,232,870.00	2.87
106	300788	中信出版	6,846,174.00	2.72
107	300654	世纪天鸿	6,840,037.40	2.72
108	688223	晶科能源	6,780,036.57	2.69
109	601900	南方传媒	6,688,952.87	2.66
110	301360	荣旗科技	6,648,202.70	2.64
111	600207	安彩高科	6,463,385.00	2.57
112	002539	云图控股	6,460,910.00	2.57
113	300078	思创医惠	6,454,549.00	2.56

114	301035	润丰股份	6,443,517.00	2.56
115	002088	鲁阳节能	6,400,598.60	2.54
116	688036	传音控股	6,117,307.79	2.43
117	688099	晶晨股份	6,104,057.39	2.43
118	300348	长亮科技	6,085,565.00	2.42
119	688244	永信至诚	6,071,307.68	2.41
120	688515	裕太微	6,048,696.12	2.40
121	600271	航天信息	5,878,708.00	2.34
122	688486	龙迅股份	5,851,965.04	2.32
123	002602	世纪华通	5,813,976.73	2.31
124	002913	奥士康	5,700,855.69	2.26
125	300002	神州泰岳	5,698,862.00	2.26
126	300251	光线传媒	5,690,332.00	2.26
127	688225	亚信安全	5,644,691.51	2.24
128	300571	平治信息	5,576,262.00	2.22
129	000810	创维数字	5,450,873.00	2.17
130	300435	中泰股份	5,413,276.00	2.15
131	688588	凌志软件	5,410,368.15	2.15
132	301208	中亦科技	5,364,794.00	2.13
133	300827	上能电气	5,346,196.00	2.12
134	601668	中国建筑	5,326,957.00	2.12
135	603660	苏州科达	5,315,455.00	2.11
136	300212	易华录	5,248,345.00	2.09
137	603888	新华网	5,239,529.00	2.08
138	002555	三七互娱	5,190,431.00	2.06
139	600754	锦江酒店	5,103,645.00	2.03
140	688143	长盈通	5,074,940.30	2.02
141	600266	城建发展	5,068,232.96	2.01
142	002876	三利谱	5,041,752.90	2.00

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

#### 7.4.2 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	300394	天孚通信	37,238,802.08	14.79
2	003021	兆威机电	37,066,140.00	14.73
3	002291	遥望科技	34,987,942.16	13.90
4	000503	国新健康	33,236,459.00	13.20
5	688392	骄成超声	32,648,425.66	12.97
6	605376	博迁新材	31,579,905.84	12.55
7	300274	阳光电源	28,803,755.00	11.44
8	603019	中科曙光	27,954,874.83	11.11
9	688318	财富趋势	26,818,652.31	10.65

10	300459	汤姆猫	26,621,894.81	10.58
11	688678	福立旺	25,330,380.17	10.06
12	300253	卫宁健康	25,235,323.80	10.03
13	300750	宁德时代	23,042,650.80	9.15
14	300624	万兴科技	22,084,137.52	8.77
15	002791	坚朗五金	22,077,125.00	8.77
16	000690	宝新能源	21,887,176.00	8.70
17	688297	中无人机	20,801,872.00	8.26
18	300033	同花顺	20,670,940.00	8.21
19	601677	明泰铝业	20,649,336.53	8.20
20	002254	泰和新材	19,592,042.80	7.78
21	002230	科大讯飞	18,513,418.00	7.36
22	688496	清越科技	18,354,773.34	7.29
23	300031	宝通科技	18,341,697.00	7.29
24	000021	深科技	18,144,160.00	7.21
25	002865	钧达股份	17,956,388.00	7.13
26	603737	三棵树	17,884,470.55	7.11
27	688502	茂莱光学	17,725,706.46	7.04
28	603927	中科软	17,453,243.83	6.93
29	688223	晶科能源	16,348,316.51	6.50
30	300118	东方日升	16,134,088.52	6.41
31	603051	鹿山新材	15,491,394.04	6.15
32	301018	申菱环境	15,161,033.58	6.02
33	688025	杰普特	15,131,825.03	6.01
34	300693	盛弘股份	14,826,742.42	5.89
35	688095	福昕软件	14,645,081.79	5.82
36	300235	方直科技	14,624,727.00	5.81
37	002180	纳思达	14,511,404.74	5.77
38	688475	萤石网络	14,045,571.70	5.58
39	688246	嘉和美康	13,872,200.45	5.51
40	600556	天下秀	13,260,083.00	5.27
41	601226	华电重工	13,084,296.64	5.20
42	688122	西部超导	13,017,053.59	5.17
43	688031	星环科技	12,901,146.93	5.13
44	300130	新国都	12,865,329.12	5.11
45	002769	普路通	12,731,024.00	5.06
46	002970	锐明技术	12,541,541.46	4.98
47	002837	英维克	12,519,240.00	4.97
48	603501	韦尔股份	12,447,048.05	4.95
49	300413	芒果超媒	12,245,656.12	4.87
50	300082	奥克股份	12,150,697.00	4.83
51	300059	东方财富	11,924,038.51	4.74
52	300257	开山股份	11,872,853.00	4.72

53	002131	利欧股份	11,779,378.00	4.68
54	000719	中原传媒	11,610,425.00	4.61
55	301312	智立方	11,576,259.54	4.60
56	600415	小商品城	11,450,704.76	4.55
57	601360	三六零	11,424,892.00	4.54
58	002402	和而泰	10,884,754.98	4.32
59	002410	广联达	10,761,139.00	4.28
60	688789	宏华数科	10,606,650.35	4.21
61	002415	海康威视	10,593,823.00	4.21
62	300451	创业慧康	10,578,463.00	4.20
63	603039	ST 泛微	10,564,000.00	4.20
64	688083	中望软件	10,547,965.72	4.19
65	301360	荣旗科技	10,485,714.37	4.17
66	688408	中信博	10,468,354.08	4.16
67	300654	世纪天鸿	10,369,249.03	4.12
68	300034	钢研高纳	9,800,810.30	3.89
69	301162	国能日新	9,610,865.40	3.82
70	002271	东方雨虹	9,438,195.16	3.75
71	603061	金海通	9,406,004.44	3.74
72	688037	芯源微	9,377,876.39	3.73
73	300990	同飞股份	9,279,472.00	3.69
74	688188	柏楚电子	9,184,669.76	3.65
75	300687	赛意信息	9,014,299.75	3.58
76	603916	苏博特	8,867,132.00	3.52
77	603027	千禾味业	8,663,254.76	3.44
78	601369	陕鼓动力	8,623,554.00	3.43
79	603000	人民网	8,536,681.00	3.39
80	002046	国机精工	8,445,466.00	3.36
81	603918	金桥信息	8,422,203.80	3.35
82	300081	恒信东方	8,412,991.80	3.34
83	002315	焦点科技	8,359,643.00	3.32
84	000400	许继电气	8,232,878.57	3.27
85	601900	南方传媒	8,094,434.00	3.22
86	688663	新风光	8,019,780.95	3.19
87	300831	派瑞股份	7,974,621.00	3.17
88	002517	恺英网络	7,949,079.96	3.16
89	301078	孩子王	7,904,212.00	3.14
90	301035	润丰股份	7,492,462.00	2.98
91	000636	风华高科	7,377,374.00	2.93
92	688232	新点软件	7,344,092.34	2.92
93	600237	铜峰电子	7,255,459.00	2.88
94	300803	指南针	7,146,614.00	2.84
95	300002	神州泰岳	7,132,643.00	2.83

96	600373	中文传媒	6,933,167.00	2.75
97	300788	中信出版	6,781,360.00	2.69
98	600207	安彩高科	6,644,415.00	2.64
99	600754	锦江酒店	6,522,095.00	2.59
100	688244	永信至诚	6,510,158.57	2.59
101	688588	凌志软件	6,073,884.57	2.41
102	002088	鲁阳节能	6,069,631.80	2.41
103	688099	晶晨股份	6,027,980.37	2.39
104	002539	云图控股	5,997,051.00	2.38
105	301266	宇邦新材	5,987,650.75	2.38
106	002913	奥士康	5,960,219.00	2.37
107	002555	三七互娱	5,819,248.00	2.31
108	603888	新华网	5,735,365.00	2.28
109	000810	创维数字	5,499,457.00	2.18
110	300251	光线传媒	5,499,069.00	2.18
111	603660	苏州科达	5,458,519.00	2.17
112	300571	平治信息	5,427,266.00	2.16
113	600271	航天信息	5,364,593.02	2.13
114	300212	易华录	5,360,761.58	2.13
115	002602	世纪华通	5,357,393.00	2.13
116	601668	中国建筑	5,350,311.00	2.13
117	688225	亚信安全	5,236,251.30	2.08
118	600522	中天科技	5,211,913.00	2.07
119	300435	中泰股份	5,209,297.00	2.07
120	002669	康达新材	5,157,681.00	2.05
121	300078	思创医惠	5,151,516.72	2.05
122	300567	精测电子	5,151,161.00	2.05
123	603359	东珠生态	5,118,351.00	2.03
124	688486	龙迅股份	5,087,547.37	2.02

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 7.4.3 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	2,255,126,588.94
卖出股票收入（成交）总额	1,821,195,279.92

注：“买入股票成本”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。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

**7.7 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。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 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。

**7.12.2 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。

**7.12.3 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	354,373.01
2	应收清算款	15,464,112.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	121,753.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,940,239.28

**7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 (%)
华泰柏瑞积极优选股票 A	30,760	9,692.73	164,049,069.10	55.02	134,099,302.55	44.98
华泰柏瑞积极优选股票 C	15,219	25,774.13	381,064,374.51	97.15	11,192,141.59	2.85
合计	44,971	15,352.22	545,113,443.61	78.96	145,291,444.14	21.04

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）。

### 8.2 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	华泰柏瑞积极优选股票 A	5,931,051.27	1.9893
	华泰柏瑞积极优选股票 C	53,109.00	0.0135
	合计	5,984,160.27	0.8668

### 8.3 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	华泰柏瑞积极优选股票 A	>100
	华泰柏瑞积极优选股票 C	0
	合计	>100

本基金基金经理持有本 开放式基金	华泰柏瑞积极优选股票 A	50~100
	华泰柏瑞积极优选股票 C	0
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞积极优选股票 A	华泰柏瑞积极优选股票 C
基金合同生效日 (2015 年 3 月 26 日) 基金份额总额	1,706,941,661.53	-
本报告期期初基金份 额总额	119,275,850.88	124,895,775.52
本报告期基金总申购 份额	220,065,410.73	622,403,483.74
减：本报告期基金总 赎回份额	41,192,889.96	355,042,743.16
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	298,148,371.65	392,256,516.10

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 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。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 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。

### 10.6.2 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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 (%)	
粤开证券	1	740,031,520.57	18.21	681,791.31	18.60	-
中泰证券	2	488,100,858.24	12.01	454,030.44	12.39	-
中信建投	3	459,551,175.76	11.31	394,818.68	10.77	-
东方财富证券	2	377,628,376.91	9.29	351,685.41	9.59	-
华宝证券	2	307,028,380.46	7.55	285,938.09	7.80	-
信达证券	3	258,636,049.68	6.36	189,141.08	5.16	-
天风证券	2	239,463,407.48	5.89	227,803.65	6.21	-
长江证券	2	203,400,501.52	5.00	189,424.95	5.17	-
招商证券	4	192,344,940.01	4.73	177,207.47	4.83	-
东北证券	2	145,261,613.73	3.57	135,277.61	3.69	-
德邦证券	2	130,329,906.88	3.21	94,557.15	2.58	-
民生证券	4	117,560,279.13	2.89	108,308.74	2.95	-
金元证券	2	115,932,680.28	2.85	106,808.93	2.91	-
银泰证券	1	107,413,324.88	2.64	100,036.10	2.73	-
东海证券	2	68,896,024.5	1.70	64,162.91	1.75	-

		5				
世纪证券	2	60,617,924.88	1.49	56,454.42	1.54	-
南京证券	2	52,054,758.44	1.28	48,478.59	1.32	-
华泰证券	6	8,520.00	0.00	5.11	0.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商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满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。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) 具备研究实力, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时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, 新增银泰证券、东莞证券、山西证券的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
德邦证	-	-	-	-	-	-

券						
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证	-	-	-	-	-	-

券						
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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 6 月 27 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 21 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 6 月 3 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 5 月 9 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 4 月 29 日
6	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 4 月 19 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 14 日
8	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 4 月 11 日

9	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 3 月 30 日
10	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 3 月 22 日
11	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 3 月 21 日
12	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 2 月 23 日
13	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 2 月 08 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 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

### 12.3 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

2023 年 8 月 31 日