

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 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。

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金于 2020 年 8 月 20 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 8 月 20 日开始计算。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	55
7.1 期末基金资产组合情况	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	67
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	67
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	67

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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	75
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞创新升级混合	
基金主代码	000566	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 5 月 6 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	480,060,592.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞创新升级混合 A	华泰柏瑞创新升级混合 C
下属分级基金的交 易代码	000566	010028
报告期末下属分级 基金的份额总额	465,049,172.08 份	15,011,420.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄 证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄 证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818

法定代表人	贾波	葛海蛟
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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 弄证大五道口广场 1 号楼 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)		
	华泰柏瑞创新升级混合 A	华泰柏瑞创新升级混合 C	
本期已实现收益	-65,543,741.08	-2,108,865.50	
本期利润	-45,909,115.94	-1,804,487.44	
加权平均基金份额本期利润	-0.0727	-0.0779	
本期加权平均净值利润率	-2.54%	-2.85%	
本期基金份额净值增长率	-2.61%	-2.96%	
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	669,952,926.70	24,375,843.99
	期末可供分配基金份额利润	1.4406	1.6238
	期末基金资产净值	1,282,292,461.66	39,387,264.88
	期末基金份额净值	2.757	2.624

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	338.77%	-3.82%

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

华泰柏瑞创新升级混合 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	1.21%	0.98%	1.06%	0.72%	0.15%	0.26%
过去三个月	-4.47%	1.08%	-2.92%	0.69%	-1.55%	0.39%
过去六个月	-2.61%	1.02%	4.73%	0.68%	-7.34%	0.34%
过去一年	-11.15%	1.17%	-4.10%	0.72%	-7.05%	0.45%
过去三年	12.50%	1.54%	-2.78%	0.84%	15.28%	0.70%
自基金合同生效起至今	338.77%	1.60%	53.40%	1.01%	285.37%	0.59%

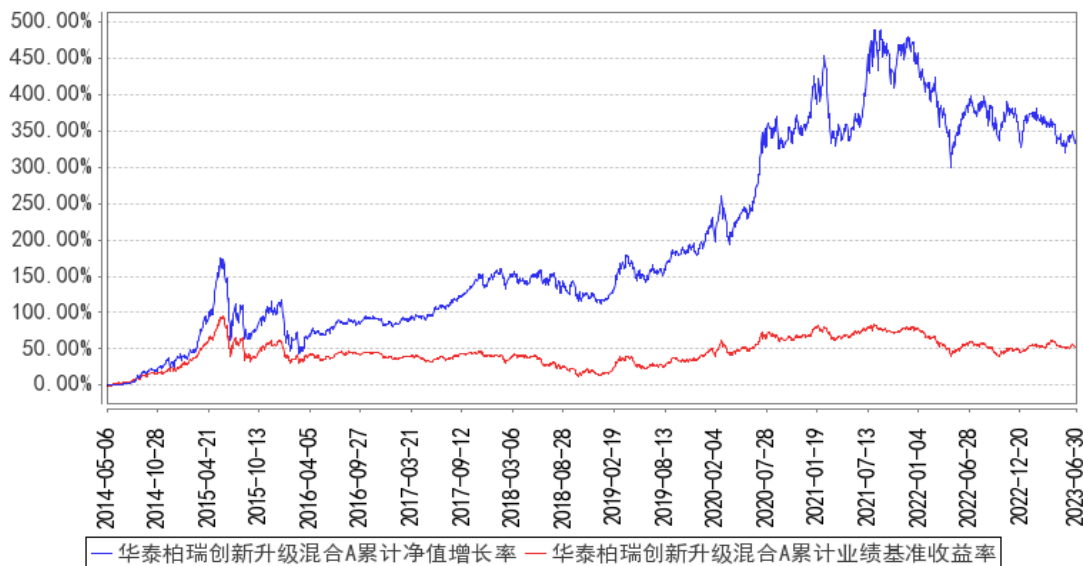
华泰柏瑞创新升级混合 C

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	1.16%	0.98%	1.06%	0.72%	0.10%	0.26%
过去三个月	-4.62%	1.07%	-2.92%	0.69%	-1.70%	0.38%
过去六个月	-2.96%	1.03%	4.73%	0.68%	-7.69%	0.35%
过去一年	-11.83%	1.17%	-4.10%	0.72%	-7.73%	0.45%
自基金合同生效起至今	-3.82%	1.52%	-8.92%	0.81%	5.10%	0.71%

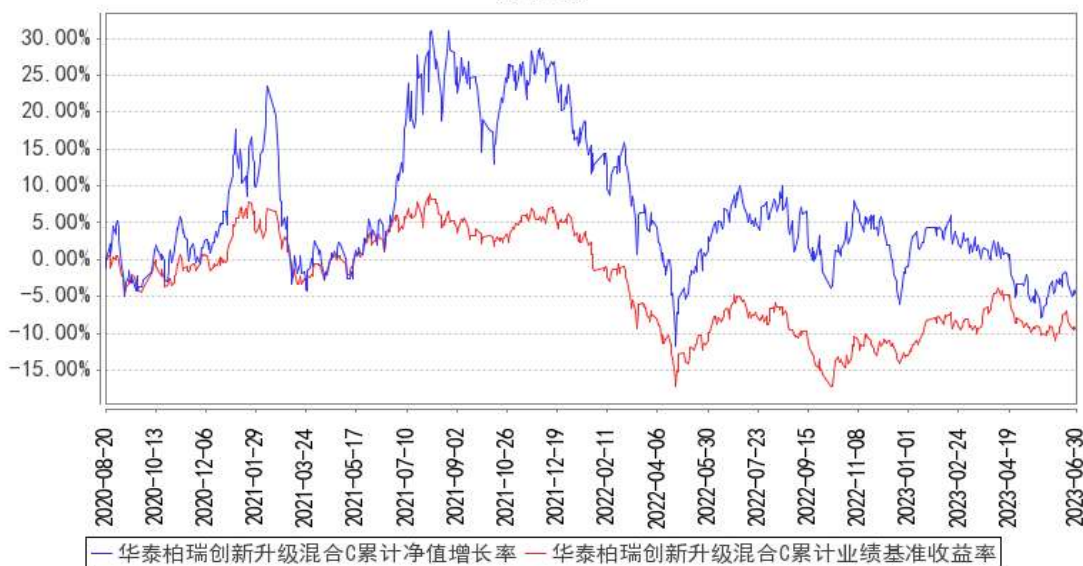
注：本基金于 2020 年 8 月 20 日新增 C 类份额。C 类份额的计算期间为 2020 年 8 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。

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

华泰柏瑞创新升级混合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



华泰柏瑞创新升级混合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 2014 年 5 月 6 日至 2023 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2020 年 8 月 20 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		
王林军	本基金的基金经理助理	2021 年 12 月 20 日	2023 年 6 月 1 日	6 年	清华大学电气工程专业硕士。2017 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。历任研究部助理研究员、研究员、基金经理助理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金的基金经理。
吴邦栋	投资二部副总监、本基金的基金经理	2023 年 6 月 9 日	-	12 年	上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,任高级研究员兼

					<p>基金经理助理。2018 年 3 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 8 月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 12 月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2022 年 1 月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、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的基金经理。</p>
谭笑	研究部副总监、本基金的基金经理助理	2022 年 11 月 8 日	-	9 年	<p>山东大学金融学硕士。2014 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任研究部副总监兼基金经理助理。</p>
张慧	总经理助理、主动权益投资总监、本基金的基金经理	2014 年 5 月 6 日	2023 年 6 月 9 日	16 年	<p>经济学硕士。2007 年 7 月至 2010 年 6 月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理、投资部副总监、投资研究部副总监、投资研究部总监、主动权益投资总监，2021 年 12 月起任公司总经理助理。2013 年 9 月至 2018 年 5 月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014 年 5 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月至 2020 年 8 月任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2019 年</p>

					11 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞匠心汇选混合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。谭笑 2023 年 8 月 1 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

2023 年上半年，市场在年初大涨后再度进入到震荡波动的状态。一季度尤其是 1 月份，防疫政策优化提振情绪，市场普遍看好国内经济复苏，叠加外资大幅流入，带动指数显著修复。但 2 月份开始，随着高频数据分化修复，市场对于经济复苏强度的预期开始出现分歧，同时美联储加息预期升温、海外硅谷银行破产等外部风险持续扰动，行情逐步陷入震荡波动。至 3 月，随着两会过后市场对于经济和政策预期的分歧逐渐弥合，行业轮动速度开始放缓，市场震荡上行，主线加速聚焦数字经济 TMT 等方向。进入二季度，4 月上旬 TMT 延续 3 月以来的涨势，顺周期方向也温和上涨，带动指数上行。至 4 月中旬，一季度经济数据超预期之下，市场短暂迎来经济预期的上修，风格转向大盘、价值。但 4 月下旬开始，TMT 由于过度拥挤而大跌。此后经济数据回落、预期边际变差，尤其 5 月份开始，市场更开始担忧经济复苏的持续性。市场进一步回调。直至 6 月，市场开始低位震荡。整个上半年，中证 500 涨 2.29%，沪深 300 跌 0.75%，创业板指跌 5.61%。风格上，小盘强于大盘，价值强于成长。结构上，受益于 AIGC 技术进步驱动的 TMT 板块显著领涨，而消费、医药表现落后。

政策层面，海外进入紧缩周期尾声，而国内政策宽松继续推进。年初经济压力较小，且市场信心较强。3 月 5 日政府工作报告明确 2023 年“国内生产总值增长 5%左右”等主要发展目标，并确定赤字率拟安排 3%，专项债拟安排 3.8 万亿，基本符合预期。但 4、5 月开始，经济压力逐步显现，市场信心转弱，各项政策宽松措施加速落地呵护。6 月 16 日国常会明确指出“针对经济形势的变化，必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好”，并研究出台推动经济持续回升向好的一批政策措施。6 月 30 日央行二季度货币政策例会又重提“加大逆周期调节力度”，并要求“克服困难、乘势而上”、“切实支持扩大内需”。7 月 24 日政治局会议进一步释放利好，稳定市场信心、提振市场情绪。与此同时，海外上半年在衰退交易和紧缩交易间反复角力，在 2023 年 2 月、3 月、5 月加息 25bp、6 月暂停加息后，7 月再次加息 25bp。当前来看，加息或已接近尾声，但美联储“数据依赖”的路径意味着后续市场与联储间的预期博弈可能仍未结束。

宏观经济数据方面，整体呈现年初脉冲式修复后增长斜率逐渐放缓、回归中枢的特征。1 月需求快速回暖，但由于春节等因素生产未能跟进复苏。至 2 月，复工复产推进之下，生产快速跟进，生产上行快于需求。而 3 月，随着需求在高基数之上没有进一步加速，导致前期偏快的生产、库存都出现回落。至 4 月经济数据承压特征明显。5 月复苏动能依然偏弱。但 6 月，随着稳增长政

策加码支撑，经济下行压力最大的时候可能在逐渐过去，并呈现出初步的筑底迹象。具体来看，上半年 GDP 累计同比 5.5%，其中二季度 GDP 同比为 6.3%，略低于市场平均预期的 6.8%。但从经济数据 6 月单月的边际变化来看，筑底的特征或在初步形成。工业增加值环比季调回升，固定资产投资环比季调回升，消费两年复合增速回升，服务业生产指数两年复合增速回升。

行业层面，上半年对应市场先 β 后 α 的行情变化，主线上也经历了周期成长引领普涨到数字经济、中特估主线确认，再到两条主线交替轮动的过程。节奏上，年初普涨中，受益于经济复苏预期快速升温以及市场风险偏好回暖，前期表现相对落后的以新能源车产业链，以及以信创、半导体等为代表的成长板块涨幅领先。而 2 月市场震荡中，“数字经济”和“中特估”主线逐步确认。此后 3 月以来，行情在两条主线间交替轮动。先是 3 月开始，主线聚焦数字经济 TMT 等方向，至 4 月中旬，随着数字经济拥挤度升至高位，叠加经济预期短暂上修，中特估、顺周期领跑，TMT 震荡回调。此后 4 月下旬，TMT 大跌拖累市场情绪。进入 5 月，市场经济悲观预期升温，“中特估”方向显著回调拖累市场表现，而前期大幅调整的 TMT 反而逆市企稳。直至 5 月底，政策宽松预期升温下金融、地产链等方向有所反弹，数字经济更开始演绎新一轮行情。行至 6 月中旬，随着各项宽松政策落地、经济悲观预期修正下，新能源、汽车等前期落后板块迎来上涨。但 6 月下旬，海外央行货币紧缩的尾部风险、人民币贬值压力以及各类国际地缘风险等外部风险再度冲击风险偏好，导致市场回调、TMT 领跌。

本基金在报告期内继续保持行业及个股景气度选股的思路，整体来说行业配置上较为均衡，成长股比例略有增加，主要以医药以及高端制造类的成长个股为主。

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创新升级混合 A 的基金份额净值为 2.757 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.61%，同期业绩比较基准收益率为 4.73%，截至本报告期末华泰柏瑞创新升级混合 C 的基金份额净值为 2.624 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.96%，同期业绩比较基准收益率为 4.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，随着积极因素积累、悲观预期修正，下半年市场有望迎来修复：一方面，美国经济已逐渐开始出现“瑕疵”，下半年来自美债利率上行、汇率贬值、外资流出等的外部压力有望逐步缓和。另一方面，国内 2 季度 GDP 数据虽略不及预期，但 6 月经济数据已经边际回暖：生产端，尽管工业增加值、服务业生产指数两年复合增速仍低于疫情前水平，但 5-6 月已出现持续改善。消费端，边际上居民收入改善，5-6 月商品消费加速。投资端，基建、制造业投资维持强势。并且，

政策呵护也在陆续落地，7月政治局会议进一步释放积极信号。

结构上，会关注：1) 阶段性经济悲观预期修复和政策呵护预期升温窗口，包括与经济相关性较强的顺周期、消费板块，以及军工新能源为代表的科技制造，都可能有低位修复机会；2) 下半年“数字经济”主线或比较明确，仍是中长期市场战略性聚焦的方向，会继续关注。

操作方面，二季度财报期过后，选股的有效性将会大大增强，我们仍在保持仓位不变的情况下，坚持精选细分景气行业，自下而上挖掘个股，在组合方面剔除一些财报低于预期的品种，加入一些现金流提前复苏，或季报增速超预期的个股。整体来说，在关注前面提到的宏观面几个不确定性因素的同时，综合考虑组合盈利增长和估值的匹配程度，对结构进一步优化。

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

基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。本基金本报告期未进行收益分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	287,900,411.26	95,263,298.51
结算备付金		1,968,566.02	27,595,203.92
存出保证金		557,326.41	649,899.98
交易性金融资产	6.4.7.2	1,102,283,173.41	1,780,082,344.85
其中：股票投资		1,014,532,371.22	1,693,264,858.55
基金投资		-	-
债券投资		87,750,802.19	86,817,486.30
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		9,639,657.61	-
应收股利		-	-
应收申购款		162,058.24	270,366.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,402,511,192.95	1,903,861,113.32

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
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		17,016,107.48	11,024,148.40
应付赎回款		56,290,036.75	2,261,272.15
应付管理人报酬		1,867,186.05	2,502,911.62
应付托管费		311,197.69	417,151.97
应付销售服务费		29,023.89	41,826.59
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	5,317,914.55	5,318,799.35
负债合计		80,831,466.41	21,566,110.08
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	480,060,592.97	665,948,073.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	841,619,133.57	1,216,346,930.19
净资产合计		1,321,679,726.54	1,882,295,003.24
负债和净资产总计		1,402,511,192.95	1,903,861,113.32

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 480,060,592.97 份，其中下属 A 类基金份额净值 2.757 元，基金份额总额 465,049,172.08 份；下属 C 类基金份额净值 2.624 元，基金份额总额 15,011,420.89 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		-31,045,830.29	-270,181,376.00
1. 利息收入		401,114.26	486,413.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	401,114.26	486,413.68
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）		-51,846,311.88	-418,474,904.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-57,844,856.63	-426,758,071.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	891,015.89	747,368.40
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	5,107,528.86	7,535,798.12
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	19,939,003.20	146,167,680.01
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	460,364.13	1,639,435.14
减：二、营业总支出		16,667,773.09	17,862,702.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,948,140.21	15,088,945.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,324,690.05	2,514,824.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	253,818.49	116,415.02
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	141,124.34	142,517.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,713,603.38	-288,044,078.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,713,603.38	-288,044,078.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-47,713,603.38	-288,044,078.53
----------	--	----------------	-----------------

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

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)	665,948,073.05	-	1,216,346,930.19	1,882,295,003.24
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)	665,948,073.05	-	1,216,346,930.19	1,882,295,003.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-185,887,480.08	-	-374,727,796.62	-560,615,276.70
(一)、综合收益总额	-	-	-47,713,603.38	-47,713,603.38
(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)	-185,887,480.08	-	327,014,193.24	-512,901,673.32
其中：1. 基金申购款	98,500,519.61	-	187,089,150.67	285,589,670.28
2. 基金赎回款	-284,387,999.69	-	-514,103,343.91	-798,491,343.60
(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)	480,060,592.97	-	841,619,133.57	1,321,679,726.54
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)	685,919,519.65	-	1,716,709,104.40	2,402,628,624.05
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)	685,919,519.65	-	1,716,709,104.40	2,402,628,624.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,468,421.40	-	352,266,011.63	-388,734,433.03
(一)、综合收益总额	-	-	288,044,078.53	-288,044,078.53
(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)	-36,468,421.40	-	-64,221,933.10	-100,690,354.50
其中：1. 基金申购款	222,172,263.48	-	464,802,308.00	686,974,571.48
2. 基金赎回款	-	-	-	-
	258,640,684.88	-	529,024,241.10	-787,664,925.98
(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)	649,451,098.25	-	1,364,443,092.77	2,013,894,191.02
-----------------	----------------	---	------------------	------------------

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：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
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

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金(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[2014]88号《关于核准华泰柏瑞创新升级混合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《华泰柏瑞创新升级混合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267,666,871.23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(2014)第224号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》于2014年5月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为267,739,518.28份基金份额,其中认购资金利息折合72,647.05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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同和托管协议的公告》,本基金自2020年8月20日起增加收取销售服务费的C类份额,并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的C类份额后,原有的基金份额全部自动划归为本基金A类份额。对投资者申购时收取申购费用,赎回时收取赎回费用,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;对投资者申购时不收取申购费用,但在赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金增加C类基金份额后,将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新升级混合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

(须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票及存托凭证占基金资产的比例为 30%-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金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 1 年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%。

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》、《华泰柏瑞创新升级混合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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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	287,900,411.26
等于：本金	287,875,660.11
加：应计利息	24,751.15
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	287,900,411.26

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	1,018,740,442.94	-	1,014,532,371.22	-4,208,071.72	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	86,171,941.00	1,759,402.19	87,750,802.19	-180,541.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	86,171,941.00	1,759,402.19	87,750,802.19	-180,541.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,104,912,383.94	1,759,402.19	1,102,283,173.41	-4,388,612.72	

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	195,534.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,013,283.78
其中：交易所市场	5,013,283.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	5,317,914.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞创新升级混合 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	644,489,115.02	644,489,115.02
本期申购	84,733,376.53	84,733,376.53
本期赎回（以“-”号填列）	-264,173,319.47	-264,173,319.47
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	465,049,172.08	465,049,172.08

华泰柏瑞创新升级混合 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	21,458,958.03	21,458,958.03
本期申购	13,767,143.08	13,767,143.08
本期赎回（以“-”号填列）	-20,214,680.22	-20,214,680.22
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	15,011,420.89	15,011,420.89

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

华泰柏瑞创新升级混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,004,613,611.05	175,164,641.92	1,179,778,252.97
本期利润	-65,543,741.08	19,634,625.14	-45,909,115.94
本期基金份额交易产生的变动数	-269,116,943.27	-47,508,904.18	-316,625,847.45
其中：基金申购款	133,060,258.60	29,330,882.07	162,391,140.67
基金赎回款	-402,177,201.87	-76,839,786.25	-479,016,988.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	669,952,926.70	147,290,362.88	817,243,289.58

华泰柏瑞创新升级混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,611,356.69	-9,042,679.47	36,568,677.22
本期利润	-2,108,865.50	304,378.06	-1,804,487.44
本期基金份额交易产生的变动数	-13,444,269.80	3,055,924.01	-10,388,345.79
其中：基金申购款	29,466,714.10	-4,768,704.10	24,698,010.00
基金赎回款	-42,910,983.90	7,824,628.11	-35,086,355.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,058,221.39	-5,682,377.40	24,375,843.99

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	314,874.74
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	81,124.08
其他	5,115.44
合计	401,114.26

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	-57,844,856.63

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	-57,844,856.63

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	6,267,402,936.50
减：卖出股票成本总额	6,307,209,652.31
减：交易费用	18,038,140.82
买卖股票差价收入	-57,844,856.63

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	891,015.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	891,015.89

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	5,107,528.86
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	5,107,528.86

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	19,939,003.20

股票投资	19,896,703.20
债券投资	42,300.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	19,939,003.20

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	446,205.83
基金转换费收入	14,158.30
合计	460,364.13

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	9,000.00
银行划款手续费	23,028.40
合计	141,124.34

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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、基金销售机构
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。

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	393,119,510.21	3.32	1,279,711,856.72	12.93

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	362,181.21	3.34	362,181.21	7.22
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	1,166,201.55	12.88	-	-

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	13,948,140.21	15,088,945.43
其中：支付销售机构的客户维护 费	2,399,993.96	2,367,098.59

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	2,324,690.05	2,514,824.21

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

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		
	华泰柏瑞创新升级混合 A	华泰柏瑞创新升级混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	39,324.16	39,324.16
合计	0.00	39,324.16	39,324.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞创新升级混合 A	华泰柏瑞创新升级混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	19,899.47	19,899.47
合计	0.00	19,899.47	19,899.47

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 0.8% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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
中国银行股份有限公司	287,900,411.26	314,874.74	129,254,945.49	365,301.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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	301408.SZ	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137.SH	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688478.SH	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合证券	688469.SH	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	688512.SH	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472.SH	阿特斯	网下申购	31,301	347,441.10
华泰联合证券	300804.SZ	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688429.SH	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	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合证券	688209	英集芯	网下申购	6,822	165,297.06
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64

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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
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	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-

				内						
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
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	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
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	2023	6个月	新	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

	塑科技	年3月1日		股锁定期内						
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	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-

				内						
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
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	-
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	687	22,217.58	21,887.82	-
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	2023年1	6个月	新股	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

	股份	月 12 日		锁定期内						
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	364	27,955.20	39,293.80	-
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	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

				期 内						
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	2,023	48,086.71	86,766.47	-
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	277	9,343.21	8,822.45	-
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	-

301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
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	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚	2023年6月	1个月内	新股	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-

	科技	月 30 日	(含)	未上市						
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	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
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	628	11,178.40	11,234.92	-

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	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定期内	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
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	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定期内	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创	2023年6月	6个月	新股	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

	能源	月 20 日		锁定期内						
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	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	11.10	17.04	3,131	34,754.10	53,352.24	-
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	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-

				期 内							
688484	南 芯 科 技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-	
688486	龙 迅 股 份	2023 年 2 月 10 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-	
688502	茂 莱 光 学	2023 年 2 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-	
688507	索 辰 科 技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-	
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	346	52,723.48	47,045.62	-	

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	-
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	956	20,238.52	22,466.00	-
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	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
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	2023年6月	1个月内	新股	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-

	科技	月 30 日	(含)	未上市						
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	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-

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

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。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相对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同责任，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(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上市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
资产							
银行存款	287,900,411.26	-	-	-	-	-	287,900,411.26
结算备付金	1,968,566.02	-	-	-	-	-	1,968,566.02
存出保证金	557,326.41	-	-	-	-	-	557,326.41
交易性金融资产	-	-87,750,802.19	-	-	-	-1,014,532,371.22	1,102,283,173.41
应收申购款	-	-	-	-	-	162,058.24	162,058.24
应收清算款	-	-	-	-	-	9,639,657.61	9,639,657.61
资产总计	290,426,303.69	-87,750,802.19	-	-	-	-1,024,334,087.07	1,402,511,192.95
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	56,290,036.75	56,290,036.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,867,186.05	1,867,186.05
应付托管费	-	-	-	-	-	311,197.69	311,197.69
应付清算款	-	-	-	-	-	17,016,107.48	17,016,107.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29,023.89	29,023.89
其他负债	-	-	-	-	-	5,317,914.55	5,317,914.55
负债总计	-	-	-	-	-	80,831,466.41	80,831,466.41
利率敏感度 缺口	290,426,303.69	-87,750,802.19	-	-	-	943,502,620.66	1,321,679,726.54
上年度末 2022年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	95,263,298.51	-	-	-	-	-	95,263,298.51
结算备付金	27,595,203.92	-	-	-	-	-	27,595,203.92
存出保证金	649,899.98	-	-	-	-	-	649,899.98
交易性金融资产	-	-86,817,486.30	-	-	-	-1,693,264,858.55	1,780,082,344.85
应收申购款	-	-	-	-	-	270,366.06	270,366.06
资产总计	123,508,402.41	-86,817,486.30	-	-	-	-1,693,535,224.61	1,903,861,113.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,261,272.15	2,261,272.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,502,911.62	2,502,911.62
应付托管费	-	-	-	-	-	417,151.97	417,151.97

应付清算款	-	-	-	-	11,024,148.40	11,024,148.40
应付销售服务费	-	-	-	-	41,826.59	41,826.59
其他负债	-	-	-	-	5,318,799.35	5,318,799.35
负债总计	-	-	-	-	21,566,110.08	21,566,110.08
利率敏感度缺口	123,508,402.41	-86,817,486.30	-	-	-1,671,969,114.53	1,882,295,003.24

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.64%(2022 年 12 月 31 日：4.61%)，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	1,014,532,371.22	76.76	1,693,264,858.55	89.96
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	1,014,532,371.22	76.76	1,693,264,858.55	89.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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）
	中证 500 指数上升 5%	53,395,682.83	82,439,030.87
	中证 500 指数下降 5%	-53,395,682.83	-82,439,030.87

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	1,011,749,376.21	1,691,609,621.83
第二层次	88,467,184.73	86,817,486.30
第三层次	2,066,612.47	1,655,236.72

合计	1,102,283,173.41	1,780,082,344.85
----	------------------	------------------

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	1,014,532,371.22	72.34
	其中：股票	1,014,532,371.22	72.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,750,802.19	6.26
	其中：债券	87,750,802.19	6.26
	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	289,868,977.28	20.67
8	其他各项资产	10,359,042.26	0.74

9	合计	1,402,511,192.95	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	340,720.10	0.03
B	采矿业	413,952.84	0.03
C	制造业	692,526,170.32	52.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,656,537.40	0.73
E	建筑业	652,099.92	0.05
F	批发和零售业	79,782,643.96	6.04
G	交通运输、仓储和邮政业	361,562.88	0.03
H	住宿和餐饮业	236,749.20	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,998,320.56	10.97
J	金融业	9,240,109.59	0.70
K	房地产业	48,036,593.89	3.63
L	租赁和商务服务业	168,004.93	0.01
M	科学研究和技术服务业	26,614,829.17	2.01
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	1,312,954.39	0.10
R	文化、体育和娱乐业	176,295.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,014,532,371.22	76.76

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	603456	九洲药业	3,632,600	99,460,588.00	7.53
2	002929	润建股份	1,193,732	51,819,906.12	3.92
3	002912	中新赛克	1,064,825	46,862,948.25	3.55
4	601512	中新集团	5,008,008	46,724,714.64	3.54
5	605266	健之佳	488,404	40,942,907.32	3.10

6	000989	九 芝 堂	2,921,000	40,426,640.00	3.06
7	000739	普洛药业	2,270,427	40,277,374.98	3.05
8	600566	济川药业	1,363,104	39,584,540.16	3.00
9	600436	片仔癀	137,556	39,390,536.16	2.98
10	300408	三环集团	1,339,596	39,317,142.60	2.97
11	603233	大参林	1,364,416	38,217,292.16	2.89
12	300723	一品红	1,269,912	37,208,421.60	2.82
13	603309	维力医疗	2,058,700	31,848,089.00	2.41
14	301080	百普赛斯	420,700	26,428,374.00	2.00
15	688278	特宝生物	555,925	24,410,666.75	1.85
16	688401	路维光电	648,535	24,346,003.90	1.84
17	688403	汇成股份	1,742,666	21,295,378.52	1.61
18	600941	中国移动	226,007	21,086,453.10	1.60
19	688687	凯因科技	678,806	20,024,777.00	1.52
20	000423	东阿阿胶	367,300	19,632,185.00	1.49
21	688182	灿勤科技	759,691	19,167,003.93	1.45
22	603676	卫信康	1,348,365	18,634,404.30	1.41
23	601728	中国电信	3,308,400	18,626,292.00	1.41
24	300394	天孚通信	152,400	16,280,892.00	1.23
25	300308	中际旭创	104,300	15,379,035.00	1.16
26	300389	艾比森	721,600	14,698,992.00	1.11
27	002409	雅克科技	200,200	14,590,576.00	1.10
28	688249	晶合集成	745,149	14,054,963.58	1.06
29	002384	东山精密	538,397	13,944,482.30	1.06
30	300567	精测电子	144,500	13,749,175.00	1.04
31	300232	洲明科技	1,497,300	13,685,322.00	1.04
32	605588	冠石科技	284,200	13,408,556.00	1.01
33	301391	卡莱特	91,194	10,685,200.98	0.81
34	601619	嘉泽新能	1,933,145	8,795,809.75	0.67
35	605377	华旺科技	368,900	6,658,645.00	0.50
36	603283	赛腾股份	136,000	6,052,000.00	0.46
37	002675	东诚药业	258,500	3,802,535.00	0.29
38	300687	赛意信息	110,200	3,061,356.00	0.23
39	601398	工商银行	318,100	1,533,242.00	0.12
40	601288	农业银行	431,400	1,522,842.00	0.12
41	601318	中国平安	32,400	1,503,360.00	0.11
42	300896	爱美客	3,180	1,414,941.00	0.11
43	601939	建设银行	225,200	1,409,752.00	0.11
44	688085	三友医疗	50,442	1,324,606.92	0.10
45	603186	华正新材	38,000	1,307,200.00	0.10
46	688256	寒武纪	6,628	1,246,064.00	0.09
47	000651	格力电器	29,600	1,080,696.00	0.08
48	001979	招商蛇口	79,827	1,040,145.81	0.08

49	601138	工业富联	40,784	1,027,756.80	0.08
50	603986	兆易创新	9,200	977,500.00	0.07
51	300494	盛天网络	29,155	722,752.45	0.05
52	003816	中国广核	221,900	690,109.00	0.05
53	000516	国际医学	74,323	625,056.43	0.05
54	000858	五粮液	3,696	604,554.72	0.05
55	601998	中信银行	99,000	592,020.00	0.04
56	300015	爱尔眼科	29,722	551,343.10	0.04
57	000776	广发证券	31,504	463,423.84	0.04
58	601377	兴业证券	75,481	461,943.72	0.03
59	601601	中国太保	16,100	418,278.00	0.03
60	688223	晶科能源	28,436	399,810.16	0.03
61	600958	东方证券	39,868	386,719.60	0.03
62	300274	阳光电源	3,100	361,553.00	0.03
63	300059	东方财富	25,242	358,436.40	0.03
64	600536	中国软件	7,623	357,366.24	0.03
65	300894	火星人	13,300	339,682.00	0.03
66	300592	华凯易佰	12,400	337,528.00	0.03
67	300498	温氏股份	17,842	327,400.70	0.02
68	300395	菲利华	6,567	323,096.40	0.02
69	603345	安井食品	2,195	322,226.00	0.02
70	300593	新雷能	13,944	319,457.04	0.02
71	688037	芯源微	1,828	312,496.60	0.02
72	600150	中国船舶	9,191	302,475.81	0.02
73	000568	泸州老窖	1,359	284,805.63	0.02
74	002179	中航光电	6,156	279,174.60	0.02
75	300353	东土科技	21,392	278,309.92	0.02
76	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
77	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.02
78	000928	中钢国际	26,800	258,620.00	0.02
79	601598	中国外运	55,200	257,232.00	0.02
80	600109	国金证券	29,500	255,765.00	0.02
81	601689	拓普集团	2,991	241,373.70	0.02
82	603232	格尔软件	16,582	241,102.28	0.02
83	603027	千禾味业	11,272	238,064.64	0.02
84	600970	中材国际	17,800	226,950.00	0.02
85	002154	报喜鸟	40,600	224,112.00	0.02
86	600519	贵州茅台	130	219,830.00	0.02
87	600325	华发股份	22,100	217,685.00	0.02
88	002153	石基信息	15,336	214,704.00	0.02
89	601899	紫金矿业	18,877	214,631.49	0.02
90	688618	三旺通信	3,123	211,489.56	0.02
91	002180	纳思达	6,100	208,925.00	0.02

92	000021	深科技	10,400	207,896.00	0.02
93	600993	马应龙	7,363	204,765.03	0.02
94	603305	旭升集团	7,306	203,618.22	0.02
95	003029	吉大正元	6,193	200,962.85	0.02
96	300124	汇川技术	3,100	199,051.00	0.02
97	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.02
98	600612	老凤祥	2,800	195,664.00	0.01
99	300181	佐力药业	15,800	192,918.00	0.01
100	000333	美的集团	2,988	176,052.96	0.01
101	300033	同花顺	1,000	175,280.00	0.01
102	002049	紫光国微	1,805	168,316.25	0.01
103	002415	海康威视	4,800	158,928.00	0.01
104	300144	宋城演艺	12,700	157,480.00	0.01
105	688475	萤石网络	3,652	156,524.72	0.01
106	002487	大金重工	4,900	151,116.00	0.01
107	600976	健民集团	1,907	147,010.63	0.01
108	600572	康恩贝	21,000	143,850.00	0.01
109	002027	分众传媒	20,564	140,040.84	0.01
110	688301	奕瑞科技	492	138,955.56	0.01
111	600754	锦江酒店	3,130	132,524.20	0.01
112	300496	中科创达	1,300	125,255.00	0.01
113	603733	仙鹤股份	5,800	120,930.00	0.01
114	300693	盛弘股份	3,251	120,026.92	0.01
115	688390	固德威	711	118,637.46	0.01
116	002507	涪陵榨菜	6,410	117,367.10	0.01
117	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
118	000932	华菱钢铁	23,927	114,131.79	0.01
119	300244	迪安诊断	4,400	112,772.00	0.01
120	002368	太极股份	2,665	109,718.05	0.01
121	600258	首旅酒店	5,500	104,225.00	0.01
122	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
123	600111	北方稀土	4,300	103,114.00	0.01
124	600570	恒生电子	2,328	103,107.12	0.01
125	300347	泰格医药	1,588	102,489.52	0.01
126	300629	新劲刚	4,865	100,364.95	0.01
127	600011	华能国际	10,040	92,970.40	0.01
128	601799	星宇股份	734	90,722.40	0.01
129	000786	北新建材	3,688	90,392.88	0.01
130	688072	拓荆科技	211	89,879.67	0.01
131	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.01
132	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
133	603833	欧派家居	900	86,220.00	0.01
134	002648	卫星化学	5,749	86,005.04	0.01

135	002791	坚朗五金	1,317	85,223.07	0.01
136	002051	中工国际	7,100	84,703.00	0.01
137	000799	酒鬼酒	930	83,839.50	0.01
138	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
139	603170	宝立食品	3,677	78,173.02	0.01
140	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
141	601225	陕西煤业	4,200	76,398.00	0.01
142	603737	三棵树	1,160	75,887.20	0.01
143	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
144	600782	新钢股份	19,700	73,087.00	0.01
145	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
146	002372	伟星新材	3,500	71,890.00	0.01
147	002271	东方雨虹	2,611	71,175.86	0.01
148	000975	银泰黄金	6,059	70,890.30	0.01
149	603501	韦尔股份	690	67,647.60	0.01
150	002304	洋河股份	469	61,603.15	0.00
151	002142	宁波银行	2,431	61,504.30	0.00
152	601669	中国电建	9,911	56,889.14	0.00
153	601166	兴业银行	3,477	54,415.05	0.00
154	600048	保利发展	4,148	54,048.44	0.00
155	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
156	688472	阿特斯	3,131	53,352.24	0.00
157	002078	太阳纸业	4,931	52,712.39	0.00
158	002371	北方华创	162	51,459.30	0.00
159	601088	中国神华	1,635	50,276.25	0.00
160	605117	德业股份	332	49,650.60	0.00
161	300012	华测检测	2,427	47,326.50	0.00
162	603198	迎驾贡酒	739	47,148.20	0.00
163	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
164	301153	中科江南	616	46,175.36	0.00
165	002518	科士达	1,138	45,531.38	0.00
166	002508	老板电器	1,800	45,522.00	0.00
167	601636	旗滨集团	5,099	43,953.38	0.00
168	600085	同仁堂	758	43,630.48	0.00
169	603369	今世缘	826	43,612.80	0.00
170	605007	五洲特纸	2,795	42,372.20	0.00
171	600900	长江电力	1,913	42,200.78	0.00
172	601100	恒立液压	626	40,270.58	0.00
173	601717	郑煤机	3,200	39,840.00	0.00
174	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
175	300146	汤臣倍健	1,610	38,607.80	0.00
176	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
177	600808	马钢股份	14,870	38,215.90	0.00

178	601872	招商轮船	6,596	38,190.84	0.00
179	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
180	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
181	002352	顺丰控股	800	36,072.00	0.00
182	000959	首钢股份	10,300	36,050.00	0.00
183	002466	天齐锂业	508	35,514.28	0.00
184	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
185	600031	三一重工	2,099	34,906.37	0.00
186	603605	珀莱雅	307	34,506.80	0.00
187	301337	亚华电子	1,018	34,084.24	0.00
188	600585	海螺水泥	1,431	33,971.94	0.00
189	002446	盛路通信	3,521	33,273.45	0.00
190	600690	海尔智家	1,389	32,613.72	0.00
191	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
192	600309	万华化学	359	31,534.56	0.00
193	688599	天合光能	739	31,488.79	0.00
194	600809	山西汾酒	165	30,536.55	0.00
195	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
196	002594	比亚迪	117	30,217.59	0.00
197	600009	上海机场	662	30,068.04	0.00
198	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
199	603939	益丰药房	779	28,823.00	0.00
200	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
201	601888	中国中免	253	27,964.09	0.00
202	600845	宝信软件	538	27,335.78	0.00
203	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
204	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
205	600600	青岛啤酒	250	25,907.50	0.00
206	600036	招商银行	768	25,159.68	0.00
207	000963	华东医药	580	25,154.60	0.00
208	600702	舍得酒业	200	24,790.00	0.00
209	688311	盟升电子	354	24,758.76	0.00
210	000596	古井贡酒	100	24,738.00	0.00
211	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
212	001322	箭牌家居	1,395	23,352.30	0.00
213	002335	科华数据	634	22,792.30	0.00
214	600132	重庆啤酒	247	22,763.52	0.00
215	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
216	603259	药明康德	357	22,244.67	0.00
217	002318	久立特材	1,300	22,139.00	0.00
218	603496	恒为科技	1,167	21,916.26	0.00
219	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
220	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00

221	300620	光库科技	350	21,448.00	0.00
222	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
223	301281	科源制药	748	19,299.60	0.00
224	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
225	300413	芒果超媒	550	18,815.50	0.00
226	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
227	000001	平安银行	1,600	17,968.00	0.00
228	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
229	000792	盐湖股份	900	17,253.00	0.00
230	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
231	603137	恒尚节能	882	16,797.14	0.00
232	688385	复旦微电	333	16,683.30	0.00
233	603288	海天味业	346	16,210.10	0.00
234	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
235	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
236	603297	永新光学	200	15,980.00	0.00
237	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
238	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
239	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
240	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
241	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
242	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
243	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
244	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
245	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
246	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
247	600563	法拉电子	100	13,730.00	0.00
248	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
249	002714	牧原股份	316	13,319.40	0.00
250	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
251	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
252	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
253	300763	锦浪科技	124	12,908.40	0.00
254	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
255	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
256	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
257	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
258	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
259	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
260	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
261	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
262	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
263	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00

264	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
265	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
266	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
267	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
268	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
269	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
270	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
271	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
272	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
273	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
274	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
275	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
276	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
277	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
278	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
279	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
280	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
281	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
282	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
283	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
284	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
285	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
286	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
287	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
288	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
289	002155	湖南黄金	144	1,756.80	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	600570	恒生电子	138,902,395.58	7.38
2	300015	爱尔眼科	132,303,811.83	7.03
3	603456	九洲药业	102,134,318.89	5.43
4	688111	金山办公	99,011,078.05	5.26
5	300059	东方财富	95,836,785.15	5.09
6	601377	兴业证券	88,297,343.93	4.69
7	000516	国际医学	86,961,489.80	4.62
8	603859	能科科技	85,040,750.49	4.52
9	603986	兆易创新	83,020,756.12	4.41
10	001979	招商蛇口	82,336,470.48	4.37
11	002912	中新赛克	77,432,846.22	4.11
12	300033	同花顺	71,424,504.06	3.79

13	002153	石基信息	71,110,573.78	3.78
14	300353	东土科技	70,475,944.63	3.74
15	003029	吉大正元	67,627,733.84	3.59
16	002929	润建股份	64,625,796.36	3.43
17	000938	紫光股份	61,410,124.44	3.26
18	300634	彩讯股份	59,746,369.00	3.17
19	300494	盛天网络	59,609,092.79	3.17
20	601512	中新集团	59,502,463.33	3.16
21	301268	铭利达	58,490,596.49	3.11
22	002463	沪电股份	58,434,151.08	3.10
23	603233	大参林	57,492,899.90	3.05
24	601619	嘉泽新能	55,783,889.85	2.96
25	300925	法本信息	54,977,743.02	2.92
26	605337	李子园	54,082,176.92	2.87
27	603232	格尔软件	52,051,449.20	2.77
28	002304	洋河股份	51,599,800.00	2.74
29	601318	中国平安	50,991,081.73	2.71
30	300896	爱美客	49,314,491.90	2.62
31	002155	湖南黄金	48,281,706.45	2.57
32	601328	交通银行	47,956,901.00	2.55
33	002965	祥鑫科技	47,387,953.64	2.52
34	301239	普瑞眼科	46,132,662.30	2.45
35	600958	东方证券	45,266,032.68	2.40
36	000776	广发证券	45,253,987.00	2.40
37	600109	国金证券	44,588,569.32	2.37
38	301267	华夏眼科	44,548,698.30	2.37
39	000989	九芝堂	43,595,657.00	2.32
40	600566	济川药业	43,266,265.55	2.30
41	300408	三环集团	43,127,301.80	2.29
42	600436	片仔癀	43,034,986.00	2.29
43	600489	中金黄金	42,534,510.82	2.26
44	002555	三七互娱	42,440,821.78	2.25
45	000636	风华高科	42,370,105.72	2.25
46	600048	保利发展	41,841,751.00	2.22
47	000739	普洛药业	41,758,863.47	2.22
48	601939	建设银行	41,389,334.00	2.20
49	600976	健民集团	40,727,311.40	2.16
50	605266	健之佳	40,697,664.49	2.16
51	002803	吉宏股份	40,621,538.15	2.16
52	600519	贵州茅台	40,555,984.00	2.15
53	000858	五粮液	40,191,092.28	2.14
54	601398	工商银行	40,112,608.00	2.13
55	688201	信安世纪	39,790,581.63	2.11

56	600547	山东黄金	39,443,010.88	2.10
57	601288	农业银行	38,839,440.00	2.06
58	002315	焦点科技	38,587,135.60	2.05
59	603136	天目湖	37,737,504.41	2.00
60	605377	华旺科技	37,735,382.78	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	600570	恒生电子	134,873,781.80	7.17
2	300634	彩讯股份	128,408,986.41	6.82
3	688111	金山办公	119,684,416.60	6.36
4	300015	爱尔眼科	119,111,443.01	6.33
5	003029	吉大正元	110,140,717.70	5.85
6	688390	固德威	110,065,996.34	5.85
7	300059	东方财富	97,599,279.60	5.19
8	603859	能科科技	94,259,225.12	5.01
9	002180	纳思达	93,568,460.00	4.97
10	002912	中新赛克	92,559,654.82	4.92
11	300353	东土科技	84,594,683.91	4.49
12	603986	兆易创新	84,445,127.44	4.49
13	601377	兴业证券	82,989,965.47	4.41
14	300033	同花顺	80,535,675.89	4.28
15	300896	爱美客	80,376,794.20	4.27
16	001979	招商蛇口	79,564,091.14	4.23
17	000516	国际医学	77,476,226.00	4.12
18	300494	盛天网络	75,447,173.34	4.01
19	002304	洋河股份	69,688,459.00	3.70
20	000938	紫光股份	64,574,521.73	3.43
21	002446	盛路通信	63,218,827.00	3.36
22	002153	石基信息	59,370,071.98	3.15
23	301239	普瑞眼科	57,763,247.64	3.07
24	002179	中航光电	57,456,614.60	3.05
25	600875	东方电气	56,792,165.72	3.02
26	603826	坤彩科技	56,634,138.36	3.01
27	002155	湖南黄金	56,475,091.88	3.00
28	603369	今世缘	55,706,971.00	2.96
29	605337	李子园	55,373,828.14	2.94
30	300925	法本信息	54,295,869.31	2.88
31	600489	中金黄金	53,563,326.52	2.85
32	002463	沪电股份	53,537,697.53	2.84
33	603496	恒为科技	51,407,970.49	2.73

34	300629	新劲刚	51,209,916.00	2.72
35	301302	华如科技	50,232,378.67	2.67
36	300593	新雷能	49,956,826.84	2.65
37	601328	交通银行	49,159,331.00	2.61
38	600547	山东黄金	48,561,035.18	2.58
39	002965	祥鑫科技	48,090,925.60	2.55
40	603232	格尔软件	47,863,315.26	2.54
41	601619	嘉泽新能	47,471,055.00	2.52
42	600976	健民集团	46,675,271.52	2.48
43	688201	信安世纪	46,334,100.30	2.46
44	301268	铭利达	45,861,873.88	2.44
45	002555	三七互娱	45,803,281.21	2.43
46	601318	中国平安	45,168,901.10	2.40
47	000568	泸州老窖	45,036,425.00	2.39
48	002865	钧达股份	43,804,267.72	2.33
49	688301	奕瑞科技	43,437,669.61	2.31
50	601007	金陵饭店	43,073,411.60	2.29
51	603899	晨光股份	42,092,956.08	2.24
52	600958	东方证券	41,578,093.28	2.21
53	603198	迎驾贡酒	41,118,262.08	2.18
54	600109	国金证券	40,690,346.62	2.16
55	000636	风华高科	40,284,068.59	2.14
56	000776	广发证券	40,184,171.52	2.13
57	600519	贵州茅台	39,790,143.00	2.11
58	600048	保利发展	39,725,469.00	2.11
59	601939	建设银行	39,215,713.00	2.08
60	300395	菲利华	39,144,551.50	2.08
61	601398	工商银行	39,099,276.68	2.08
62	601288	农业银行	39,077,160.00	2.08
63	000858	五粮液	38,467,319.65	2.04
64	002803	吉宏股份	38,306,270.75	2.04
65	301099	雅创电子	37,705,776.55	2.00

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	5,608,580,461.78
卖出股票收入（成交）总额	6,267,402,936.50

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	87,750,802.19	6.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	87,750,802.19	6.64

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019679	22 国债 14	485,000	49,371,976.85	3.74
2	019638	20 国债 09	375,000	38,378,825.34	2.90

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情形。

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	557,326.41
2	应收清算款	9,639,657.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	162,058.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,359,042.26

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 (%)
华泰柏瑞创新升级混合 A	243,342	1,911.09	246,415,027.80	52.99	218,634,144.28	47.01
华泰柏瑞创新升级混合 C	46,511	322.75	2,934,680.91	19.55	12,076,739.98	80.45

合计	288,844	1,662.01	249,349,708.71	51.94	230,710,884.26	48.06
----	---------	----------	----------------	-------	----------------	-------

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	华泰柏瑞创新升级混合 A	2,346,239.51	0.5045
	华泰柏瑞创新升级混合 C	128,126.52	0.8535
	合计	2,474,366.03	0.5154

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	华泰柏瑞创新升级混合 A	>100
	华泰柏瑞创新升级混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞创新升级混合 A	0
	华泰柏瑞创新升级混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞创新升级混合 A	华泰柏瑞创新升级混合 C
基金合同生效日 （2014年5月6日）基金份额总额	267,739,518.28	-
本报告期期初基金份额总额	644,489,115.02	21,458,958.03
本报告期基金总申购份额	84,733,376.53	13,767,143.08
减：本报告期基金总赎回份额	264,173,319.47	20,214,680.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	465,049,172.08	15,011,420.89

§ 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。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

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 (%)	
广发证券	3	1,568,949,880.35	13.23	1,451,227.01	13.40	-

申港证券	2	1,437,963,701.11	12.13	1,338,578.98	12.36	-
东方财富证券	2	1,088,910,145.93	9.18	1,007,807.75	9.30	-
中金公司	2	1,072,726,842.66	9.05	991,127.55	9.15	-
中信证券	5	787,184,172.86	6.64	619,721.97	5.72	-
中金财富证券	1	778,685,650.53	6.57	717,406.86	6.62	-
银河证券	5	777,511,121.98	6.56	724,097.50	6.68	-
国金证券	1	763,425,929.86	6.44	710,964.59	6.56	-
长江证券	4	576,361,113.21	4.86	531,001.57	4.90	-
国信证券	1	434,639,883.32	3.67	404,778.12	3.74	-
东兴证券	2	419,704,006.93	3.54	386,674.78	3.57	-
华泰证券	4	393,119,510.21	3.32	362,181.21	3.34	-
光大证券	2	382,904,350.06	3.23	356,593.23	3.29	-
华创证券	1	350,681,074.59	2.96	323,083.52	2.98	-
兴业证券	3	299,850,374.29	2.53	276,253.69	2.55	-
民生证券	1	249,349,223.62	2.10	229,725.29	2.12	-
东北证券	3	209,254,849.16	1.76	153,030.10	1.41	-
东方证券	3	192,182,565.30	1.62	177,058.86	1.63	-
国海证券	1	46,569,798.90	0.39	43,368.68	0.40	-
东吴证券	2	28,792,811.25	0.24	27,392.18	0.25	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

国都证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

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，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，并能为基金提供全面的信息服。

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，本基金新增租用财通证券交易单元。

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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
北京高 华	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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 16 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 10 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 6 月 3 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	2023 年 5 月 9 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 29 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 19 日

	级管理人员变更的公告		
9	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
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 4 月 11 日
11	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
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 3 月 22 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	2023 年 3 月 21 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 23 日
15	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 层及托管人住所

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日