华泰柏瑞质量成长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及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。

华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金于 2021 年 2 月 19 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2021 年 2 月 19 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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8

§4 管理人报告 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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遵规守信情况声明 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 16

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16

6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 18
6.3 净资产（基金净值）变动表 19
6.4 报表附注 21

§7 投资组合报告 51

7.1 期末基金资产组合情况 51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 51
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 52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 59

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

§8 基金份额持有人信息 60

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 61
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 61

§9 开放式基金份额变动 61

§10 重大事件揭示 61

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 62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 62
10.4 基金投资策略的改变 62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
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 67

§11 影响投资者决策的其他重要信息 68

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 68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 68

§12 备查文件目录 68

12.1 备查文件目录 68
12.2 存放地点 68
12.3 查阅方式 68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞质量成长混合	
基金主代码	008528	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 18 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	438,508,803.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞质量成长混合 A	华泰柏瑞质量成长混合 C
下属分级基金的交易代码	008528	011452
报告期末下属分级基金的份额总额	433,827,955.85 份	4,680,847.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入的公司基本面研究，精选具有可持续高质量成长且估值具有吸引力的公司进行价值投资，在严格控制组合风险和回撤的前提下，实现投资业绩的可复制性和可持续性，从而实现基金资产的长期和稳定增值。
投资策略	1、资产配置 本基金将通过研究国内国际宏观经济趋势、货币政策、财政政策、企业盈利周期、估值水平等可能影响证券市场的重要因素，对各大类资产的风险收益特征进行深入分析，在严格控制组合风险的基础上，调整或确定各大类资产的配置比例，实现基金资产的长期、稳定和持续增值。 2、股票投资策略 本基金以深入的基本面研究为核心，专注投资于具有可持续的高质量成长且估值具有吸引力的公司，结合对宏观经济形势和宏观政策的分析，精选盈利能够可持续增长的行业，定性分析和定量分析相结合，严格控制组合风险和回撤，自下而上精选个股构建投资组合，实现组合业绩的可复制性和可持续性。 3、债券组合投资策略 本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对各类债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将重点关注非信用类固定收益类证券（国债、

	中央银行票据等），具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。 4、资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。 5、股指期货投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金可运用股指期货对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。 6、融资业务的投资策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	王小飞
	联系电话	021-38601777	021-60637103
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	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	中国证券报

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)	
	华泰柏瑞质量成长混合 A	华泰柏瑞质量成长混合 C
本期已实现收益	1,125,741.59	-12,784.87
本期利润	-4,850,332.82	117,659.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0110	0.0416
本期加权平均净值利润率	-1.05%	4.00%
本期基金份额净值增长率	-1.08%	-1.29%
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	18,940,281.68	159,282.56
期末可供分配基金份额利润	0.0437	0.0340
期末基金资产净值	452,768,237.53	4,840,130.13
期末基金份额净值	1.0437	1.0340
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	4.37%	-43.55%

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。

4、C 类指标的计算期间为 2021 年 2 月 19 日至 2023 年 6 月 30 日。

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

华泰柏瑞质量成长混合 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	-2.14%	2.74%	1.64%	0.75%	-3.78%	1.99%
过去三个月	2.20%	3.03%	-3.28%	0.67%	5.48%	2.36%
过去六个月	-1.08%	2.32%	0.34%	0.68%	-1.42%	1.64%
过去一年	-20.46%	2.03%	-7.93%	0.83%	-12.53%	1.20%
过去三年	-18.38%	1.88%	-4.53%	0.92%	-13.85%	0.96%
自基金合同生效起至今	4.37%	1.83%	3.98%	0.92%	0.39%	0.91%

华泰柏瑞质量成长混合 C

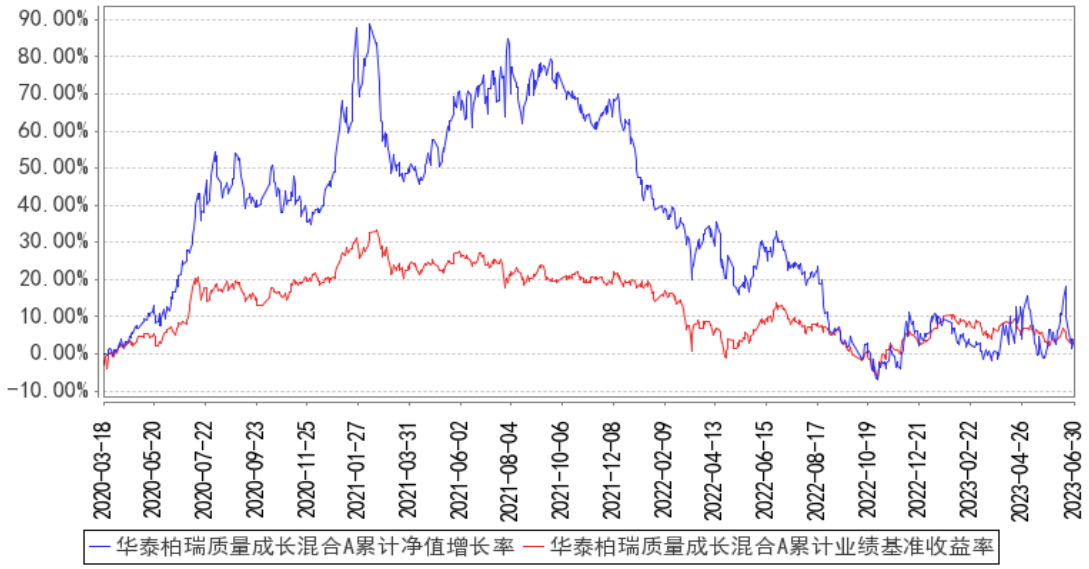
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-2.19%	2.74%	1.64%	0.75%	-3.83%	1.99%
过去三个月	2.09%	3.02%	-3.28%	0.67%	5.37%	2.35%
过去六个月	-1.29%	2.32%	0.34%	0.68%	-1.63%	1.64%
过去一年	-20.78%	2.03%	-7.93%	0.83%	-12.85%	1.20%
自基金合同生效起	-43.55%	1.90%	-21.80%	0.91%	-21.75	0.99%

至今					%	

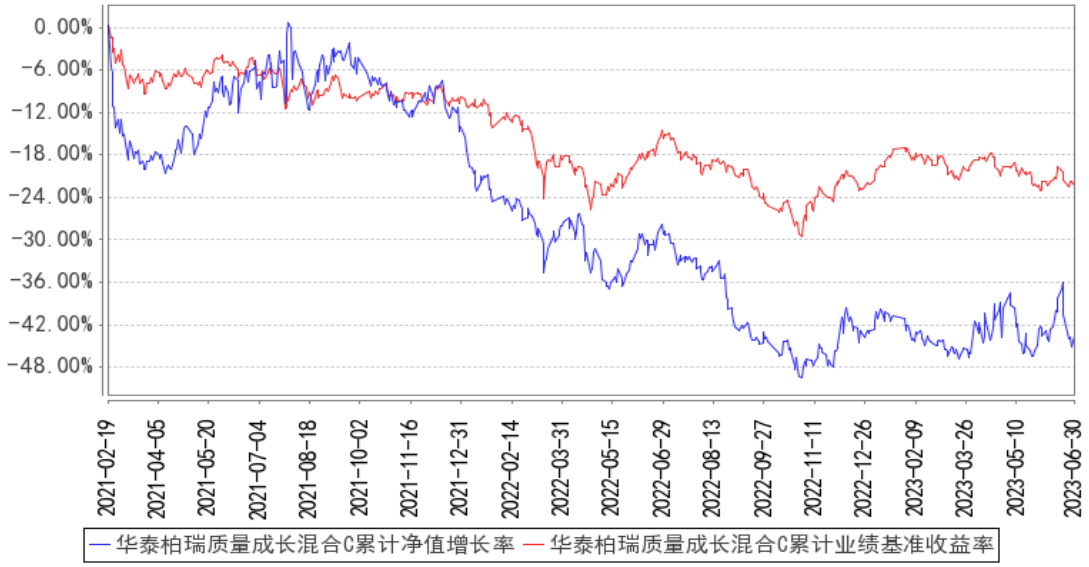
注：本基金于 2021 年 2 月 19 日新增 C 类份额。C 类指标的计算期间为 2021 年 2 月 19 日至 2023 年 6 月 30 日。

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

华泰柏瑞质量成长混合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



华泰柏瑞质量成长混合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 2020 年 3 月 18 日至 2023 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2021 年 2 月 19 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		
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。
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。

李晓西	副总经理、本基金的基金经理	2020 年 3 月 18 日	-	24 年	副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018 年 8 月起任公司副总经理。2020 年 2 月至 2022 年 7 月任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 9 月任华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞质量精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。陈文凯 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 A 股市场总体有所分化，主流宽基大盘蓝筹指数例如上证 50 和沪深 300 等表现较弱，而中小市值宽基指数表现较好。在此期间，国内继续推进稳经济和稳增长，美国在 6 月份暂缓加息后于 7 月份再次加息。上半年国内市场部分热门行业波动加大。通信、传媒、计算机、电子、石油石化等行业在此期间表现较好，大幅跑赢主流宽基指数，超额收益明显；食品饮料、农林牧渔、房地产、商贸零售、美容护理等行业同期表现相对落后，跑输主流宽基指数。投资风格方面，本期大盘价值大幅跑赢大盘成长。中小市值股票指数在上半年跑赢大市值指数。港股恒生指数和恒生科技指数波动较大，同期有所回调。本期华泰柏瑞质量成长基金 A 基金份额净值下跌约-1.08%，华泰柏瑞质量成长基金 C 基金份额净值下跌约-1.29%。

2023 年上半年影响市场的因素是多方面的。宏观层面我国继续保持经济稳增长的态势，经济体现了较好的韧性，总体处于复苏的趋势，预计经济将或持续改善，2023 年经济增速有望高于 2022 年。去年我国房地产行业波动较大，个别高负债的民营房企的债务风险问题还在化解之中。今年以来我国房地产开发投资和销售数据还有待进一步改善，房地产行业暂时还处于调整之中。但我国陆续在房地产供给侧和需求侧出台了一些政策同时采取了一些措施来化解地产风险，今年已经取得了一定成效。最近我国进一步加大了稳定房地产的政策力度，相信我国地产风险是能够得到有效化解的，并且我国地产行业集中度可能会得到提升，相信地产行业的发展未来会更为健康。6 月份我国物价数据显示需求仍有待提高，CPI 同比增速在能源和核心 CPI 的影响下走低；PPI 受生产资料价格影响同比延续回落。在我国稳增长和稳经济政策的推动下，不管财政还是货币政策都还在持续发力，相信今年我国经济增长能够继续保持较好的韧性。

从海外市场来看，美国通胀虽然有所回落，但还处于较高位置。今年以来个别美国和欧洲金融机构的风险事情可能会延缓美联储加息速度，并且可能导致美国加息周期提前结束，同时市场对美国经济衰退担忧加大。目前美国加息的边际影响已经大幅缩小，对全球流动性的负面影响减弱。美国的就业市场仍然比较好，预计美国经济后续软着陆的可能性可能较大，从而减少对全球

经济的拖累。

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质量成长混合 A 的基金份额净值为 1.0437 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%，截至本报告期末华泰柏瑞质量成长混合 C 的基金份额净值为 1.0340 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.29%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对今年下半年国内 A 股和港股市场保持相对谨慎乐观，虽然今年市场可能还会有一定波动。首先，我国经济正处于稳步复苏和增长的阶段，决策层可能在政策层面进一步发力，经济增速有望加快，企业盈利和居民收入可能有实质性提升，有利于提高就业和促进消费。其次，随着地产风险的化解，在供给侧和需求侧政策的共同作用下，今年我国地产行业对经济增长可能发挥一定的正贡献。再次，美国加息周期接近高点，在 7 月份加息后，加息幅度和速度都可能放缓，资金回流美国放缓，对美国以外资金的虹吸效应或减弱；同时，资金可能重新回流包括我国在内的新兴市场，汇率有望逐渐趋于稳定，为我国的货币政策提供了更大的操作空间。此外，最近我国对外经济合作交往频繁，相信会有一个更好的外部环境，从而提高 A 股对外资的吸引力。前期调整较多且处于业绩回升周期的高质量成长标的等有望重新获得投资者的青睐，或具有较好的配置价值。

本基金将关注在本轮经济复苏以及经济转型过程中有望受益的高质量成长企业，包括 TMT、消费、高端制造及医药行业的企业。一些传统行业由于估值较低，在我国经济复苏的大背景下，今年业绩增速可能加快，也值得关注。近期全球人工智能、机器学习、大语言模型等发展迅速并加速迭代，我国相关产业链也发展迅速，部分科技巨头加大投入并且取得一定进展，一些公司已经推出了相关领域的应用产品包括在教育出版、营销、金融、传媒、医疗等，值得持续关注。人工智能对我国乃至全球的发展具有重要意义，对我们的生活、工作和学习等都将产生影响，也可能将带来很多产业的变革与创新，预计对社会生产效率和生产力或都将有正面和深远的影响。我们将对人工智能相关领域的投资机会保持开放和学习的态度。此外，近期我国在稳地产、稳就业、稳经济等方面进一步加大了政策力度，相信我们会较快看到效果，并可能体现到上市公司业绩增速，有望带来一些行业盈利景气度的提升。同时，目前 A 股主流宽基指数估值水平基本都处于过去 10 年的中位数之下，较为便宜，具有一定的吸引力。最后，我们将继续坚持高质量成长投资理念，深入了解产业趋势，努力挑选各行各业中长期可以胜出的投资标的，力争实现投资业绩的可复制性和可持续性。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，可进行收益分配。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：华泰柏瑞质量成长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	82,422,787.16	41,463,566.47
结算备付金		1,900,085.41	1,574,623.30
存出保证金		394,611.81	394,762.43
交易性金融资产	6.4.7.2	392,791,401.64	428,082,788.43
其中：股票投资		392,791,401.64	428,082,788.43
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		-	11,413,387.85
应收股利		-	-
应收申购款		307,896.53	152,660.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		477,816,782.55	483,081,789.40
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		17,016,395.59	3,420,656.90
应付赎回款		368,345.47	230,275.33
应付管理人报酬		582,605.17	607,583.33
应付托管费		97,100.85	101,263.88
应付销售服务费		1,274.43	1,320.39
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	2,142,693.38	2,410,051.25
负债合计		20,208,414.89	6,771,151.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	438,508,803.42	451,470,368.80
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,099,564.24	24,840,269.52
净资产合计		457,608,367.66	476,310,638.32
负债和净资产总计		477,816,782.55	483,081,789.40

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 438,508,803.42 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0437 元，基金份额总额 433,827,955.85 份；下属 C 类基金份额净值 1.0340 元，基金份额总额 4,680,847.57 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞质量成长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		-554,059.35	-124,981,440.67
1.利息收入		138,297.40	154,223.49
其中：存款利息收入	6.4.7.13	138,297.40	154,223.49
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）		5,100,485.78	-175,083,120.14
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,035,193.31	-179,136,030.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	4,686.08
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	3,065,292.47	4,048,224.72
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	-5,845,629.90	49,866,435.90
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	52,787.37	81,020.08
减：二、营业总支出		4,178,613.83	5,642,890.90
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,481,347.17	4,718,815.09
2．托管费	6.4.10.2.2	580,224.48	786,469.19
3．销售服务费	6.4.10.2.3	5,783.99	3,743.99
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	111,258.19	133,862.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,732,673.18	-130,624,331.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,732,673.18	-130,624,331.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,732,673.18	-130,624,331.57

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞质量成长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）	451,470,368.80	-	24,840,269.52	476,310,638.32
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）	451,470,368.80	-	24,840,269.52	476,310,638.32

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,961,565.38	-	-5,740,705.28	-18,702,270.66
（一）、综合收益总额	-	-	-4,732,673.18	-4,732,673.18
（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）	-12,961,565.38	-	-1,008,032.10	-13,969,597.48
其中：1.基金申购款	26,130,067.44	-	1,252,842.15	27,382,909.59
2.基金赎回款	-39,091,632.82	-	-2,260,874.25	-41,352,507.07
（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）	438,508,803.42	-	19,099,564.24	457,608,367.66

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）	494,057,922.90	-	284,692,448.01	778,750,370.91
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）	494,057,922.90	-	284,692,448.01	778,750,370.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-30,781,403.46	-	-140,070,625.82	-170,852,029.28
（一）、综合收益总额	-	-	-130,624,331.57	-130,624,331.57

（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）	-30,781,403.46	-	-9,446,294.25	-40,227,697.71
其中：1.基金申购款	29,639,242.49	-	9,867,253.90	39,506,496.39
2.基金赎回款	-60,420,645.95	-	-19,313,548.15	-79,734,194.10
（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）	463,276,519.44	-	144,621,822.19	607,898,341.63

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

华泰柏瑞质量成长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[2019]2591 号《关于准予华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞质量成长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 1,495,574,957.83 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(2020)第 0176 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,496,246,091.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 671,134.07 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。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2021 年 2 月 19 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞质量成长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》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，本基金自 2021 年 2 月 19 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞质量成长混合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计提销售服务费的基金份额，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基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。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，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞质量成长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)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+上证国债指数收益率×20%。

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》、《华泰柏瑞质量成长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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	82,422,787.16
等于：本金	82,416,725.16
加：应计利息	6,062.00

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	82,422,787.16

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		359,492,199.89	-	392,791,401.64	33,299,201.75
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		359,492,199.89	-	392,791,401.64	33,299,201.75

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	43.51
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,053,389.72
其中：交易所市场	2,053,389.72
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	2,142,693.38

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞质量成长混合 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	448,649,060.31	448,649,060.31
本期申购	18,550,535.48	18,550,535.48
本期赎回（以“-”号填列）	-33,371,639.94	-33,371,639.94
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	433,827,955.85	433,827,955.85

华泰柏瑞质量成长混合 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	2,821,308.49	2,821,308.49
本期申购	7,579,531.96	7,579,531.96
本期赎回（以“-”号填列）	-5,719,992.88	-5,719,992.88
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	4,680,847.57	4,680,847.57

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

华泰柏瑞质量成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,859,571.07	-16,153,231.89	24,706,339.18
本期利润	1,125,741.59	-5,976,074.41	-4,850,332.82
本期基金份额交易产生的变动数	-1,354,790.94	439,066.26	-915,724.68
其中：基金申购款	1,643,040.74	-707,397.64	935,643.10
基金赎回款	-2,997,831.68	1,146,463.90	-1,851,367.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,630,521.72	-21,690,240.04	18,940,281.68

华泰柏瑞质量成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,227,429.60	-1,093,499.26	133,930.34
本期利润	-12,784.87	130,444.51	117,659.64
本期基金份额交易产生的变动数	823,648.37	-915,955.79	-92,307.42
其中：基金申购款	3,305,735.89	-2,988,536.84	317,199.05
基金赎回款	-2,482,087.52	2,072,581.05	-409,506.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,038,293.10	-1,879,010.54	159,282.56

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	92,525.43
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	42,432.88
其他	3,339.09
合计	138,297.40

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	2,035,193.31
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	2,035,193.31

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	1,985,070,402.60
减：卖出股票成本总额	1,976,874,865.38
减：交易费用	6,160,343.91
买卖股票差价收入	2,035,193.31

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——买卖权证差价收入。

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	3,065,292.47
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	3,065,292.47

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	-5,845,629.90
股票投资	-5,845,629.90
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	-5,845,629.90

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	51,411.09
基金转换费收入	1,376.28
合计	52,787.37

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

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

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
证券组合费	1,655.86
银行间账户服务费	18,000.00
其他费用	600.00
银行划款手续费	1,742.18
合计	111,258.19

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(“中国建设	基金托管人、基金销售机构

银行”）	
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	-	-	491,507,861.78	11.98

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（%）
-	-	-	-	-
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	457,080.29	12.17	-	-

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	3,481,347.17	4,718,815.09
其中：支付销售机构的客户维护费	1,405,850.88	1,774,152.39

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.50% / 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	580,224.48	786,469.19

注：支付基金托管人中国建设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 X 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		
	华泰柏瑞质量成长混合 A	华泰柏瑞质量成长混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	37.12	37.12
合计	0.00	37.12	37.12
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		
	华泰柏瑞质量成长混合 A	华泰柏瑞质量成长混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	31.92	31.92
合计	0.00	31.92	31.92

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

H = E × 0.4% ÷ 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，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
中国建设银行	82,422,787.16	92,525.43	57,405,863.15	89,752.70

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	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	16,694	185,303.40
华泰联合	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合	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	301207	华兰疫苗	网下申购	4,181	237,815.28
华泰联合	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40

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	2023	6 个月	新股	11.88	21.02	152	1,805.76	3,195.04	-

	电港	年 3 月 30 日		锁定期内						
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	2023	6 个月	新股	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-

	勃股份	年 6 月 8 日		锁定期内						
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	577	17,436.94	14,713.50	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	38.13	31.03	581	22,153.53	18,028.43	-
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	168	4,242.00	3,307.92	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	32.34	31.86	458	14,811.72	14,591.88	-
301317	鑫	2023	6 个月	新股	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

	磊股份	年 1 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	43	561.58	886.66	-
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	246	18,892.80	26,555.70	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	14.81	13.73	896	13,269.76	12,302.08	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	32.60	30.37	87	2,836.20	2,642.19	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	73.45	46.64	34	2,497.30	1,585.76	-
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	573	13,620.21	24,575.97	-
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	-
301382	蜂	2023	6 个月	新股	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-

	助手	年 5 月 9 日		锁定期内						
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	306	16,300.62	12,301.20	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	43.99	51.57	93	4,091.07	4,796.01	-
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	201	5,296.35	6,150.60	-
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	159	3,178.41	2,687.10	-
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	876	50,510.16	50,510.16	-
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	2023	1 个月	新股	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-

	恩汽电	年 6 月 26 日	内（含）	未上市						
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	6.58	7.58	1,262	8,303.96	9,565.96	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	10.36	11.84	467	4,838.12	5,529.28	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	11.66	12.26	398	4,640.68	4,879.48	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	25.98	24.53	133	3,455.34	3,262.49	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	17.80	17.89	419	7,458.20	7,495.91	-
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	398	14,387.70	15,175.74	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	18.06	2,592	51,477.12	46,811.52	-
688307	中润光学	2023 年 2 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-
688334	西	2023	6 个月	新股	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-

	高院	年 6 月 9 日		锁定期内						
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	12.10	12.07	1,260	15,246.00	15,208.20	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	23.60	64.67	419	9,888.40	27,096.73	-
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	-
688435	英方软件	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	75.00	90.76	51	3,825.00	4,628.76	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	11.10	17.04	1,670	18,537.00	28,456.80	-
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	305	10,366.95	8,994.45	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	39.99	36.71	412	16,475.88	15,124.52	-
688507	索	2023	6 个月	新股	245.56	122.11	108	17,925.88	13,187.88	-

	辰科技	年 4 月 10 日		锁定期内						
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	145	22,095.10	19,715.65	-
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	308	13,450.36	16,339.40	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	21.17	23.50	581	12,299.77	13,653.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	12.68	22.31	29	367.72	646.99	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	125.80	118.03	114	14,341.20	13,455.42	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	26.74	40.68	484	12,942.16	19,689.12	-
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	2023	1 个月	新股	55.00	55.00	695	38,225.00	38,225.00	-

	承科技	年 6 月 30 日	内（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	20	2,517.60	1,735.80	-
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	-

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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
资产							
银行存款	82,422,787.16	-	-	-	-	-	82,422,787.16
结算备付金	1,900,085.41	-	-	-	-	-	1,900,085.41
存出保证金	394,611.81	-	-	-	-	-	394,611.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	392,791,401.64	392,791,401.64
应收申购款	-	-	-	-	-	307,896.53	307,896.53
资产总计	84,717,484.38	-	-	-	-	393,099,298.17	477,816,782.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	368,345.47	368,345.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	582,605.17	582,605.17
应付托管费	-	-	-	-	-	97,100.85	97,100.85

应付清算款	-	-	-	-	-	17,016,395.59	17,016,395.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,274.43	1,274.43
其他负债	-	-	-	-	-	2,142,693.38	2,142,693.38
负债总计	-	-	-	-	-	20,208,414.89	20,208,414.89
利率敏感度缺口	84,717,484.38	-	-	-	-	372,890,883.28	457,608,367.66
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	41,463,566.47	-	-	-	-	-	41,463,566.47
结算备付金	1,574,623.30	-	-	-	-	-	1,574,623.30
存出保证金	394,762.43	-	-	-	-	-	394,762.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-	428,082,788.43	428,082,788.43
应收申购款	-	-	-	-	-	152,660.92	152,660.92
应收清算款	-	-	-	-	-	11,413,387.85	11,413,387.85
资产总计	43,432,952.20	-	-	-	-	439,648,837.20	483,081,789.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	230,275.33	230,275.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	607,583.33	607,583.33
应付托管费	-	-	-	-	-	101,263.88	101,263.88
应付清算款	-	-	-	-	-	3,420,656.90	3,420,656.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,320.39	1,320.39
其他负债	-	-	-	-	-	2,410,051.25	2,410,051.25
负债总计	-	-	-	-	-	6,771,151.08	6,771,151.08
利率敏感度缺口	43,432,952.20	-	-	-	-	432,877,686.12	476,310,638.32

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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有不以记账本位币计价的资产，因此外汇汇率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	167,046,860.89	-	167,046,860.89
资产合计	-	167,046,860.89	-	167,046,860.89
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	167,046,860.89	-	167,046,860.89

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 ）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	8,352,343.04
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-8,352,343.04

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	392,791,401.64	85.84	428,082,788.43	89.87
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	392,791,401.64	85.84	428,082,788.43	89.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2023 年 6 月 30 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	25,569,061.91	46,678,525.25
	业绩比较基准下降 5%	-25,569,061.91	-46,678,525.25

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	391,212,697.19	416,367,008.05
第二层次	461,113.86	-
第三层次	1,117,590.59	11,715,780.38
合计	392,791,401.64	428,082,788.43

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	392,791,401.64	82.21
	其中：股票	392,791,401.64	82.21
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	84,322,872.57	17.65
8	其他各项资产	702,508.34	0.15
9	合计	477,816,782.55	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	196,063,434.67	42.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	62,276,873.19	13.61
F	批发和零售业	27,660.05	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	82,037,945.04	17.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,667,072.30	2.55
M	科学研究和技术服务业	211,097.89	0.05

N	水利、环境和公共设施管理业	3,307.92	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	44,201.11	0.01
R	文化、体育和娱乐业	40,424,362.00	8.83
S	综合	-	-
	合计	392,791,401.64	85.84

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	300502	新易盛	646,390	43,935,128.30	9.60
2	300308	中际旭创	189,000	27,868,050.00	6.09
3	000063	中兴通讯	486,700	22,164,318.00	4.84
4	603019	中科曙光	420,700	21,413,630.00	4.68
5	301162	国能日新	259,780	20,491,446.40	4.48
6	600276	恒瑞医药	409,440	19,612,176.00	4.29
7	603027	千禾味业	924,426	19,523,877.12	4.27
8	300533	冰川网络	371,041	18,537,208.36	4.05
9	600373	中文传媒	1,388,600	18,496,152.00	4.04
10	601390	中国中铁	2,245,000	17,017,100.00	3.72
11	601186	中国铁建	1,704,712	16,791,413.20	3.67
12	601800	中国交建	1,458,800	15,915,508.00	3.48
13	601618	中国中冶	3,160,100	12,545,597.00	2.74
14	300624	万兴科技	104,580	12,251,547.00	2.68
15	000977	浪潮信息	241,689	11,721,916.50	2.56
16	300688	创业黑马	336,130	11,667,072.30	2.55
17	002599	盛通股份	1,212,900	10,976,745.00	2.40
18	002605	姚记科技	212,900	9,884,947.00	2.16
19	002517	恺英网络	619,300	9,747,782.00	2.13
20	601928	凤凰传媒	826,100	9,417,540.00	2.06
21	000719	中原传媒	721,500	8,441,550.00	1.84
22	002624	完美世界	345,700	5,838,873.00	1.28
23	000768	中航西飞	216,200	5,783,350.00	1.26
24	600760	中航沈飞	125,120	5,630,400.00	1.23
25	000503	国新健康	399,800	4,793,602.00	1.05
26	300291	百纳千成	578,000	4,069,120.00	0.89
27	002179	中航光电	49,874	2,261,785.90	0.49
28	600862	中航高科	89,000	2,252,590.00	0.49
29	600519	贵州茅台	400	676,400.00	0.15

30	688582	芯动联科	4,840	223,767.72	0.05
31	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.04
32	301291	明阳电气	5,806	188,363.43	0.04
33	688543	国科军工	3,071	171,481.85	0.04
34	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.04
35	301262	海看股份	5,764	158,652.75	0.03
36	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.03
37	688522	纳睿雷达	2,645	141,560.40	0.03
38	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.03
39	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
40	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
41	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
42	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.02
43	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
44	301269	华大九天	498	61,174.32	0.01
45	301486	致尚科技	876	50,510.16	0.01
46	688249	晶合集成	2,592	46,811.52	0.01
47	688603	天承科技	695	38,225.00	0.01
48	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
49	688472	阿特斯	1,670	28,456.80	0.01
50	688361	中科飞测	419	27,096.73	0.01
51	301301	川宁生物	2,994	26,826.24	0.01
52	301325	曼恩斯特	246	26,555.70	0.01
53	301358	湖南裕能	573	24,575.97	0.01
54	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
55	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
56	301267	华厦眼科	335	20,418.25	0.00
57	301367	怡和嘉业	135	20,025.90	0.00
58	688531	日联科技	145	19,715.65	0.00
59	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
60	688623	双元科技	197	17,996.79	0.00
61	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
62	301230	泓博医药	376	16,882.40	0.00
63	301396	宏景科技	475	15,508.75	0.00
64	688352	颀中科技	1,260	15,208.20	0.00
65	688146	中船特气	398	15,175.74	0.00
66	688484	南芯科技	412	15,124.52	0.00
67	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
68	301307	美利信	458	14,591.88	0.00
69	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
70	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
71	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
72	688552	航天南湖	581	13,653.50	0.00

73	688581	安杰思	114	13,455.42	0.00
74	300012	华测检测	690	13,455.00	0.00
75	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
76	688507	索辰科技	108	13,187.88	0.00
77	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
78	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
79	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
80	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
81	301332	德尔玛	896	12,302.08	0.00
82	301397	溯联股份	306	12,301.20	0.00
83	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
84	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
85	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
86	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
87	601061	中信金属	1,262	9,565.96	0.00
88	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
89	688479	友车科技	305	8,994.45	0.00
90	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
91	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
92	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
93	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
94	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
95	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
96	301265	华新环保	720	8,366.40	0.00
97	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
98	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
99	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
100	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
101	688562	航天软件	290	7,811.44	0.00
102	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
103	603135	中重科技	419	7,495.91	0.00
104	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
105	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
106	301428	世纪恒通	201	6,150.60	0.00
107	600845	宝信软件	114	5,792.34	0.00
108	601065	江盐集团	467	5,529.28	0.00
109	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
110	601133	柏诚股份	398	4,879.48	0.00
111	301399	英特科技	93	4,796.01	0.00
112	688458	美芯晟	51	4,628.76	0.00
113	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
114	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
115	301305	朗坤环境	168	3,307.92	0.00

116	603125	常青科技	133	3,262.49	0.00
117	001287	中电港	152	3,195.04	0.00
118	301439	泓淋电力	159	2,687.10	0.00
119	301337	亚华电子	87	2,642.19	0.00
120	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
121	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
122	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
123	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
124	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
125	301345	涛涛车业	34	1,585.76	0.00
126	301320	豪江智能	43	886.66	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	300291	百纳千成	64,265,963.00	13.49
2	300502	新易盛	58,430,958.31	12.27
3	601618	中国中冶	57,960,555.73	12.17
4	688041	海光信息	47,885,589.69	10.05
5	300394	天孚通信	46,838,108.31	9.83
6	600373	中文传媒	45,405,260.86	9.53
7	300624	万兴科技	43,918,404.00	9.22
8	601186	中国铁建	41,800,092.33	8.78
9	600011	华能国际	41,488,612.67	8.71
10	601390	中国中铁	39,784,152.00	8.35
11	300533	冰川网络	37,642,346.00	7.90
12	03690	美团-W	36,942,269.26	7.76
13	603589	口子窖	35,685,684.31	7.49
14	600050	中国联通	32,825,870.67	6.89
15	603019	中科曙光	32,035,473.78	6.73
16	601800	中国交建	31,386,872.41	6.59
17	002624	完美世界	31,108,993.50	6.53
18	603027	千禾味业	30,985,000.07	6.51
19	000977	浪潮信息	30,962,171.58	6.50
20	300688	创业黑马	30,429,343.40	6.39
21	601360	三六零	29,859,772.67	6.27
22	300251	光线传媒	29,706,959.06	6.24
23	03738	阜博集团	29,582,547.76	6.21
24	301110	青木股份	27,932,027.74	5.86
25	002292	奥飞娱乐	26,286,872.83	5.52
26	300459	汤姆猫	25,822,029.00	5.42
27	300570	太辰光	25,495,360.48	5.35

28	601991	大唐发电	24,173,309.00	5.08
29	300299	富春股份	24,049,846.86	5.05
30	600556	天下秀	23,166,484.64	4.86
31	000063	中兴通讯	22,772,194.81	4.78
32	600958	东方证券	22,626,085.79	4.75
33	688515	裕太微	21,988,730.15	4.62
34	600027	华电国际	21,943,698.00	4.61
35	300308	中际旭创	21,606,355.00	4.54
36	000719	中原传媒	21,233,447.13	4.46
37	002602	世纪华通	21,067,383.25	4.42
38	601728	中国电信	20,758,299.00	4.36
39	601928	凤凰传媒	20,527,765.04	4.31
40	600941	中国移动	20,319,659.17	4.27
41	002919	名臣健康	20,299,450.00	4.26
42	601088	中国神华	19,658,406.31	4.13
43	600276	恒瑞医药	19,399,581.24	4.07
44	300015	爱尔眼科	19,234,839.50	4.04
45	301162	国能日新	19,187,409.60	4.03
46	002517	恺英网络	19,056,087.16	4.00
47	300058	蓝色光标	18,439,706.00	3.87
48	300474	景嘉微	17,379,944.50	3.65
49	300347	泰格医药	17,211,299.58	3.61
50	688012	中微公司	16,722,272.93	3.51
51	00268	金蝶国际	16,424,775.63	3.45
52	06060	众安在线	16,288,395.18	3.42
53	000768	中航西飞	15,609,372.10	3.28
54	600109	国金证券	15,249,367.62	3.20
55	300059	东方财富	14,656,039.00	3.08
56	688095	福昕软件	14,550,113.12	3.05
57	300383	光环新网	14,236,816.00	2.99
58	300759	康龙化成	14,207,715.05	2.98
59	601857	中国石油	13,175,045.08	2.77
60	601328	交通银行	13,025,590.00	2.73
61	688588	凌志软件	12,676,124.34	2.66
62	688158	优刻得	12,485,471.64	2.62
63	601668	中国建筑	12,386,381.00	2.60
64	01548	金斯瑞生物科技	11,756,638.40	2.47
65	002179	中航光电	11,337,185.14	2.38
66	002599	盛通股份	11,151,416.00	2.34
67	002131	利欧股份	10,998,045.00	2.31
68	300725	药石科技	10,869,073.70	2.28
69	300002	神州泰岳	10,815,322.00	2.27
70	002605	姚记科技	10,624,939.00	2.23

71	688107	安路科技	10,532,502.23	2.21
72	600271	航天信息	10,438,825.12	2.19
73	601658	邮储银行	9,566,688.00	2.01

注：不考虑相关交易费用。

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	688041	海光信息	56,859,803.78	11.94
2	300291	百纳千成	56,426,868.59	11.85
3	300394	天孚通信	49,488,783.70	10.39
4	300624	万兴科技	44,243,651.68	9.29
5	601618	中国中冶	42,310,598.96	8.88
6	300347	泰格医药	40,435,524.07	8.49
7	300759	康龙化成	40,410,113.78	8.48
8	600011	华能国际	40,215,120.00	8.44
9	300502	新易盛	39,956,980.72	8.39
10	01024	快手-W	38,975,090.74	8.18
11	00700	腾讯控股	38,101,463.78	8.00
12	603589	口子窖	37,659,141.33	7.91
13	02013	微盟集团	36,926,331.91	7.75
14	03690	美团-W	35,282,224.33	7.41
15	000568	泸州老窖	34,903,268.66	7.33
16	603198	迎驾贡酒	34,860,344.62	7.32
17	06098	碧桂园服务	31,580,508.38	6.63
18	600050	中国联通	31,014,809.00	6.51
19	002304	洋河股份	30,433,764.95	6.39
20	603027	千禾味业	29,938,442.70	6.29
21	002292	奥飞娱乐	27,928,661.94	5.86
22	601360	三六零	27,036,799.36	5.68
23	600519	贵州茅台	27,010,455.00	5.67
24	300251	光线传媒	26,638,497.00	5.59
25	300533	冰川网络	25,797,113.05	5.42
26	03738	阜博集团	25,716,917.22	5.40
27	300459	汤姆猫	25,036,105.08	5.26
28	600373	中文传媒	24,394,996.22	5.12
29	601991	大唐发电	23,791,519.00	4.99
30	600556	天下秀	22,976,719.00	4.82
31	300299	富春股份	22,851,669.20	4.80
32	301110	青木股份	22,764,798.56	4.78
33	002624	完美世界	22,591,059.70	4.74
34	300570	太辰光	22,289,411.00	4.68
35	601186	中国铁建	22,051,128.00	4.63

36	000977	浪潮信息	21,481,756.10	4.51
37	600027	华电国际	21,018,605.00	4.41
38	601728	中国电信	20,937,884.00	4.40
39	002602	世纪华通	20,768,740.53	4.36
40	02269	药明生物	20,706,718.33	4.35
41	600958	东方证券	20,309,387.88	4.26
42	688515	裕太微	20,172,248.49	4.24
43	002791	坚朗五金	19,756,649.00	4.15
44	600941	中国移动	19,593,807.02	4.11
45	601390	中国中铁	19,302,097.00	4.05
46	00268	金蝶国际	18,537,515.65	3.89
47	601088	中国神华	18,319,289.99	3.85
48	002919	名臣健康	17,902,167.00	3.76
49	002517	恺英网络	17,763,342.00	3.73
50	300015	爱尔眼科	17,734,880.90	3.72
51	300474	景嘉微	16,465,206.00	3.46
52	300688	创业黑马	16,054,188.80	3.37
53	300058	蓝色光标	15,947,908.63	3.35
54	300737	科顺股份	15,804,082.60	3.32
55	600872	中炬高新	15,694,194.00	3.29
56	688012	中微公司	15,417,949.28	3.24
57	600109	国金证券	14,647,776.00	3.08
58	06060	众安在线	13,860,077.22	2.91
59	688095	福昕软件	13,705,568.70	2.88
60	300059	东方财富	13,180,175.00	2.77
61	300725	药石科技	13,081,861.25	2.75
62	601328	交通银行	13,061,196.00	2.74
63	300383	光环新网	12,773,024.00	2.68
64	601857	中国石油	12,732,630.00	2.67
65	688588	凌志软件	12,022,424.10	2.52
66	601800	中国交建	11,891,484.00	2.50
67	601668	中国建筑	11,867,138.00	2.49
68	300308	中际旭创	11,846,569.18	2.49
69	688158	优刻得	11,404,186.18	2.39
70	603019	中科曙光	11,052,345.00	2.32
71	300382	斯莱克	10,438,975.11	2.19
72	002131	利欧股份	10,423,886.00	2.19
73	000719	中原传媒	10,299,211.30	2.16
74	01548	金斯瑞生物科技	10,022,313.60	2.10
75	300002	神州泰岳	9,919,152.00	2.08
76	600271	航天信息	9,734,326.16	2.04
77	688107	安路科技	9,636,064.24	2.02
78	000768	中航西飞	9,557,865.00	2.01

注：不考虑相关交易费用。

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	1,947,429,108.49
卖出股票收入（成交）总额	1,985,070,402.60

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

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	394,611.81
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	307,896.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	702,508.34

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（%）
华泰柏瑞质量成长混合 A	23,807	18,222.71	265,315.97	0.06	433,562,639.88	99.94
华泰柏瑞质量成长混合 C	696	6,725.36	0.00	0.00	4,680,847.57	100.00
合计	24,392	17,977.57	265,315.97	0.06	438,243,487.45	99.94

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	华泰柏瑞质量成长混合 A	6,047,242.06	1.3939
	华泰柏瑞质量成长混合 C	0.00	0.0000
	合计	6,047,242.06	1.3790

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	华泰柏瑞质量成长混合 A	>100
	华泰柏瑞质量成长混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞质量成长混合 A	0
	华泰柏瑞质量成长混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞质量成长混合 A	华泰柏瑞质量成长混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 18 日）基金份额总额	1,496,246,091.90	-
本报告期期初基金份额总额	448,649,060.31	2,821,308.49
本报告期基金总申购份额	18,550,535.48	7,579,531.96
减：本报告期基金总赎回份额	33,371,639.94	5,719,992.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	433,827,955.85	4,680,847.57

§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。

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

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	774,081,809.28	19.73	713,163.82	19.86	-
招商证券	4	503,929,808.96	12.84	482,311.41	13.43	-
中泰证券	2	376,410,861.81	9.59	350,522.06	9.76	-
中信建投	3	346,781,486.16	8.84	298,035.94	8.30	-
东北证券	2	308,122,570.97	7.85	286,958.66	7.99	-
华宝证券	1	230,719,198.97	5.88	214,868.54	5.98	-
东方财富	2	222,675,826.	5.68	207,378.02	5.78	-

证券		94				
南京证券	1	191,059,561.69	4.87	177,935.22	4.96	-
民生证券	4	188,912,106.00	4.82	175,891.32	4.90	-
天风证券	2	167,593,601.91	4.27	159,431.01	4.44	-
德邦证券	2	154,844,535.67	3.95	112,147.70	3.12	-
东海证券	2	124,893,427.12	3.18	116,311.13	3.24	-
长江证券	2	124,695,701.49	3.18	116,127.61	3.23	-
银泰证券	1	60,274,548.91	1.54	56,133.08	1.56	-
金元证券	2	59,835,049.80	1.53	55,126.09	1.54	-
国盛证券	2	52,734,186.61	1.34	38,036.78	1.06	-
世纪证券	2	18,714,314.80	0.48	17,428.69	0.49	-
信达证券	2	17,026,814.38	0.43	12,451.43	0.35	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	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	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-

山西证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	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、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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增财通证券、东莞证券、东海证券、金元证券、山西证券、世纪证券、银泰证券。

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(%)
粤开证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
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 16 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 6 月 3 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 5 月 9 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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日