

# 华泰柏瑞量化先行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 08 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。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>55</b>
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	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69

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 .....	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
7.12 投资组合报告附注 .....	69
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>70</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
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 .....	71
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>71</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	71
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 .....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
10.4 基金投资策略的改变 .....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
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 .....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
10.8 其他重大事件 .....	75
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
12.1 备查文件目录 .....	77
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	华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化先行混合	
基金主代码	460009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 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	270,907,045.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞量化先行混合 A	华泰柏瑞量化先行混合 C
下属分级基金的交 易代码	460009	010246
报告期末下属分级 基金的份额总额	182,651,389.14 份	88,255,656.20 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以定量估值分析为主，结合基本面定性研究，力求发现价值被市场低估且具潜在发展机遇的企业，在风险可控的前提下，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	1) 股票投资策略：以定量估值识别为主，并结合行业和公司基本面趋势分析，以识别非完全有效市场中蕴含的各种投资机会，先行发现和介入那些企业价值被低估却具有某些隐藏价值可以提升未来股价的公司。2) 债券投资策略：采用主动性投资策略，确定和构造能够提供稳定收益且流动性较高的债券组合，在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得。3) 权证投资策略：权证投资为本基金的辅助性投资工具。4) 大类资产配置策略：通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。基于以往的投资经验，过于频繁的大类资产调整不利于本基金的管理。
业绩比较基准	95%*中证 500 指数+5%*银行活期存款利率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，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 姓名	刘万方	许俊

负责人	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	上海证券报
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)	
	华泰柏瑞量化先行混合 A	华泰柏瑞量化先行混合 C
本期已实现收益	7,219,680.40	2,249,655.60
本期利润	26,444,092.59	-1,772,222.20
加权平均基金份额本期利润	0.1319	-0.0242
本期加权平均净值利润率	6.65%	-1.25%
本期基金份额净值增长率	4.99%	4.60%
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	138,110,463.03	80,453,398.72
期末可供分配基金份额利润	0.7561	0.9116
期末基金资产净值	357,307,941.77	168,709,054.92
期末基金份额净值	1.956	1.912
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	168.32%	6.05%

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

华泰柏瑞量化先行混合 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	1.77%	0.82%	-0.77%	0.89%	2.54%	-0.07%
过去三个月	-2.98%	0.77%	-5.10%	0.78%	2.12%	-0.01%
过去六个月	4.99%	0.78%	2.20%	0.75%	2.79%	0.03%
过去一年	-6.63%	0.92%	-6.65%	0.91%	0.02%	0.01%
过去三年	18.83%	1.13%	2.48%	1.13%	16.35%	0.00%
自基金合同生效起至今	168.32%	1.41%	46.52%	1.23%	121.80%	0.18%

华泰柏瑞量化先行混合 C

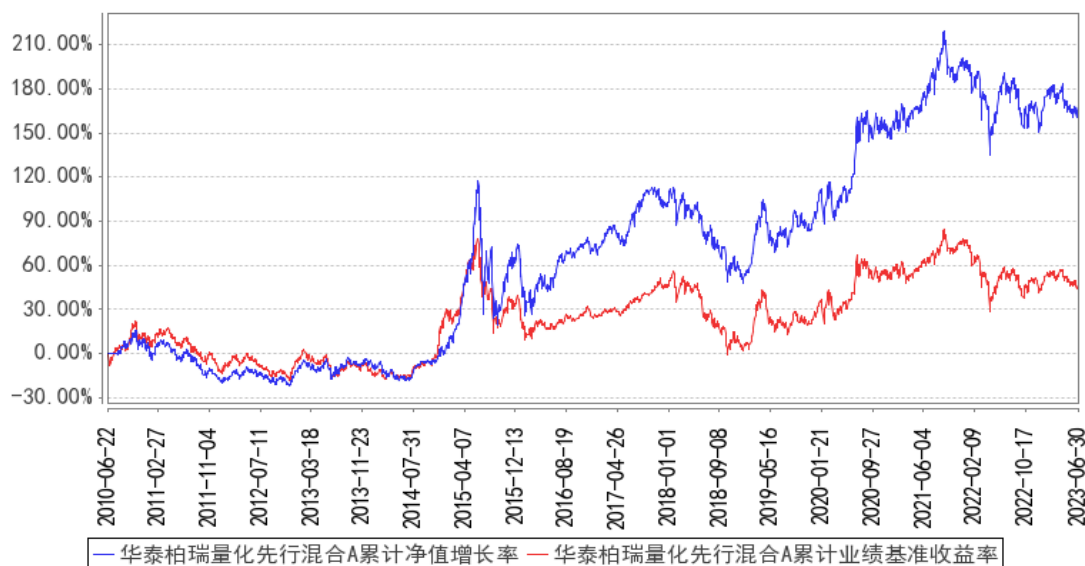
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	1.76%	0.83%	-0.77%	0.89%	2.53%	-0.06%
过去三个月	-3.14%	0.77%	-5.10%	0.78%	1.96%	-0.01%
过去六个月	4.60%	0.78%	2.20%	0.75%	2.40%	0.03%
过去一年	-7.32%	0.92%	-6.65%	0.91%	-0.67%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.05%	1.07%	-3.39%	1.07%	9.44%	0.00%

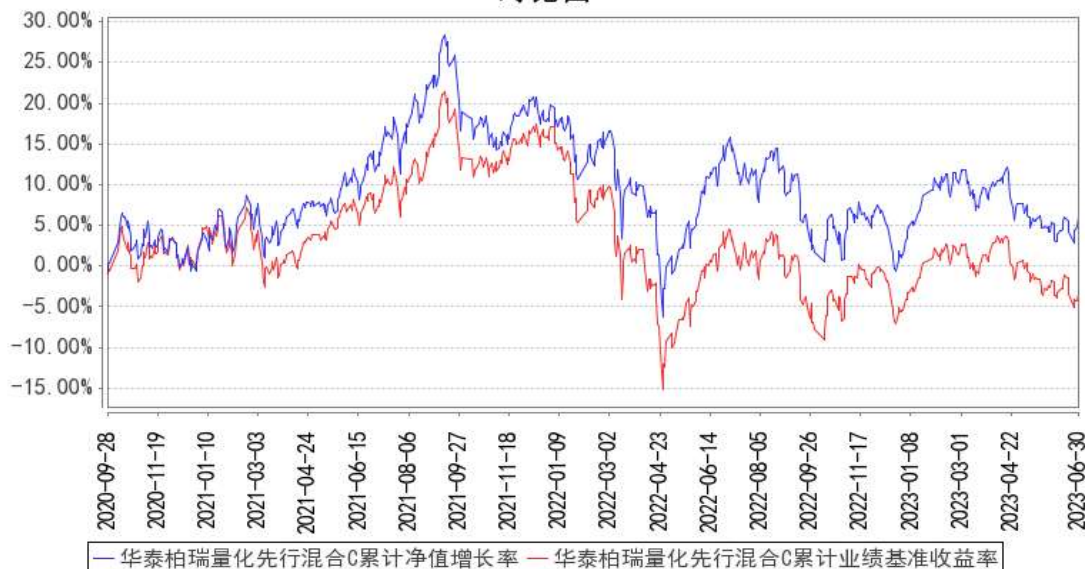
注：C 类份额业绩计算期间为 2020 年 9 月 28 日至 2023 年 6 月 30 日。

### 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

华泰柏瑞量化先行混合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



华泰柏瑞量化先行混合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 2010 年 6 月 22 日至 2023 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2020 年 9 月 28 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、华泰柏瑞亨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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2015 年 3 月 18 日	-	21 年	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司 (BGI ) 担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合

					<p>型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2021 年 11 月任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任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的基金经理。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。</p>
盛豪	量化与海外投资部总监、本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	-	15 年	<p>英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。现任量化与海外投资部总监。2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至</p>

					<p>2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月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。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 11 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金和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的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
盛豪	公募基金	8	2,360,798,212.05	2015 年 10 月 13 日
	私募资产管理计划	1	11,919,305.16	2022 年 12 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	2,372,717,517.21	-

## 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，A 股市场整体表现较弱，各主要股票指数在经历年初的上涨后，呈现了震荡下跌的走势。市场热点从疫后消费复苏到 AI、中特估等主题板块的轮动，再转向超跌板块的修复和可能的政策博弈。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别下跌 5.43% 和 0.75%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别下跌 5.61%、上涨 4.71%；中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别上涨 2.29% 和 5.10%。横向比较来看，中小市值与主题板块相对较强，大市值与顺周期行业下跌较多。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的

投资策略。

#### 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量化先行混合 A 的基金份额净值为 1.956 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.99%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%，截至本报告期末华泰柏瑞量化先行混合 C 的基金份额净值为 1.912 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.60%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2023 年上半年，在经历了一季度经济快速修复之后，随着二季度，尤其是 5 月份国内经济数据开始走弱，市场逐渐从对经济复苏的强一致预期状态切换到对国内经济复苏进度、外部经济衰退风险、产业政策发展方向等问题的分歧状态。行情结构先是延续去年年底疫后消费修复，到主题驱动的结构性情短期见顶，再调整转向政策博弈。A 股市场当前的整体估值水平已经很有吸引力，市场已经基本反映了对经济的悲观预期，投资人情绪可能已经处在恢复过程中，在这种情况下，估值修复本身也可以推动市场的上行。在不出现极端情况的前提下，我们对 2023 年的股票市场持乐观态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格会更加有利于华泰柏瑞量化模型获取超额收益。从因子表现来看，华泰柏瑞量化模型的估值因子表现依然较好，且趋势向上，同时我们的成长因子预期会继续表现良好；政策面和消息面或许会带来短期扰动，市场主线仍会回归到股票的基本面上；未来大小市值、各行业股票的表现将更加均衡；量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。尽管市场在这些方面的回归可能还会有一定的反复，但大方向上是比较确定的。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理偏低，或是很不错的买入风格均衡的量化基金的机会。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用量化选股策略，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

#### 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、金融工程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，基金收益分配每年至多 4 次；每次分配比例不低于基金期末可分配利润的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞量化先行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：华泰柏瑞量化先行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	36,683,796.02	28,227,923.44



结算备付金		1,232,427.56	1,198,925.24
存出保证金		51,053.92	200,111.31
交易性金融资产	6.4.7.2	493,965,590.22	483,713,846.50
其中：股票投资		493,965,590.22	483,713,846.50
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		53,798.41	266,386.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		531,986,666.13	513,607,192.89
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,422,854.40	2,372.97
应付赎回款		210,188.84	54,613.13
应付管理人报酬		640,037.57	662,009.66
应付托管费		106,672.94	110,334.96
应付销售服务费		109,363.35	53,086.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	480,552.34	690,621.50
负债合计		5,969,669.44	1,573,039.33
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	270,907,045.34	275,642,973.44
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	255,109,951.35	236,391,180.12
净资产合计		526,016,996.69	512,034,153.56
负债和净资产总计		531,986,666.13	513,607,192.89

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 270,907,045.34 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.956 元，基金份额总额 182,651,389.14 份；下属 C 类基金份额净值 1.912 元，基金份额总额 88,255,656.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化先行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
<b>一、营业总收入</b>		30,021,873.33	-18,176,749.83
1. 利息收入		76,440.25	155,992.38
其中：存款利息收入	6.4.7.13	76,440.25	146,671.83
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		-	9,320.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,667,686.54	-26,395,981.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,364,050.54	-38,902,179.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	6,956.44	227,012.22
资产支持证券投资	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	7,296,679.56	12,279,184.84
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	15,202,534.39	7,706,274.04

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	75,212.15	356,965.69
<b>减：二、营业总支出</b>		5,350,002.94	7,425,828.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,009,404.28	6,133,033.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	668,234.03	1,022,172.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	554,115.65	142,259.96
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		0.07	0.18
8. 其他费用	6.4.7.23	118,248.91	128,363.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		24,671,870.39	-25,602,578.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		24,671,870.39	-25,602,578.75
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		24,671,870.39	-25,602,578.75

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化先行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)	275,642,973.44	-	236,391,180.12	512,034,153.56
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)	275,642,973.44	-	236,391,180.12	512,034,153.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,735,928.10	-	18,718,771.23	13,982,843.13

(一)、综合收益总额	-	-	24,671,870.39	24,671,870.39
(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)	-4,735,928.10	-	-5,953,099.16	-10,689,027.26
其中：1. 基金申购款	62,561,736.94	-	63,117,204.03	125,678,940.97
2. 基金赎回款	-67,297,665.04	-	-69,070,303.19	-136,367,968.23
(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)	270,907,045.34	-	255,109,951.35	526,016,996.69
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)	418,188,716.29	-	495,203,060.49	913,391,776.78
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)	418,188,716.29	-	495,203,060.49	913,391,776.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-61,578,916.50	-	105,263,511.17	-166,842,427.67
(一)、综合收益总额	-	-	-25,602,578.75	-25,602,578.75
(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)	-61,578,916.50	-	-79,660,932.42	-141,239,848.92

其中：1. 基金申购款	107,486,279.28	-	98,275,816.50	205,762,095.78
2. 基金赎回款	- 169,065,195.78	-	- 177,936,748.92	-347,001,944.70
(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）	356,609,799.79	-	389,939,549.32	746,549,349.11

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

华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]184号《关于核准华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集732,618,286.68元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第158号验资报告验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金基金合同》于2010年6月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为732,677,425.51份基金份额,其中认购资金利息折合59,138.83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2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金于2015年8月6日公告后更名为华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金

金。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2020 年 9 月 23 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化先行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 2020 年 9 月 28 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化先行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，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化先行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国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准自 2018 年 1 月 31 日起由“沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%”变更为“中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%”。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 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》、《华泰柏瑞量化先行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	36,683,796.02
等于：本金	36,680,313.34
加：应计利息	3,482.68
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	36,683,796.02

##### 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	506,318,892.64	-	493,965,590.22	-12,353,302.42
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	506,318,892.64	-	493,965,590.22	-12,353,302.42

#### 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	137.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	383,715.43
其中：交易所市场	383,715.43
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,699.25
合计	480,552.34

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化先行混合 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	233,439,860.95	233,439,860.95
本期申购	8,049,122.12	8,049,122.12
本期赎回（以“-”号填列）	-58,837,593.93	-58,837,593.93
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	182,651,389.14	182,651,389.14

华泰柏瑞量化先行混合 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	42,203,112.49	42,203,112.49
本期申购	54,512,614.82	54,512,614.82
本期赎回（以“-”号填列）	-8,460,071.11	-8,460,071.11
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	88,255,656.20	88,255,656.20

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

华泰柏瑞量化先行混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	167,886,023.34	33,574,780.76	201,460,804.10
本期利润	7,219,680.40	19,224,412.19	26,444,092.59
本期基金份额交易产生的变动数	-36,995,240.71	-16,253,103.35	-53,248,344.06
其中：基金申购款	5,905,999.77	2,011,377.08	7,917,376.85
基金赎回款	-42,901,240.48	-18,264,480.43	-61,165,720.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	138,110,463.03	36,546,089.60	174,656,552.63

华泰柏瑞量化先行混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,731,527.24	-3,801,151.22	34,930,376.02
本期利润	2,249,655.60	-4,021,877.80	-1,772,222.20
本期基金份额交易产生的变动数	42,535,317.22	4,759,927.68	47,295,244.90
其中：基金申购款	50,387,485.30	4,812,341.88	55,199,827.18
基金赎回款	-7,852,168.08	-52,414.20	-7,904,582.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,516,500.06	-3,063,101.34	80,453,398.72

#### 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	69,656.29
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	6,095.14
其他	688.82
合计	76,440.25

注：本基金“存款利息收入”的“其他”为本期申购款利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,364,050.54
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	7,364,050.54

##### 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	518,627,834.45
减：卖出股票成本总额	509,881,343.15
减：交易费用	1,382,440.76
买卖股票差价收入	7,364,050.54

##### 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	9.69
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券	6,946.75

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	6,956.44

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	37,958.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,000.00
减：应计利息总额	10.19
减：交易费用	1.52
买卖债券差价收入	6,946.75

#### 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	7,296,679.56
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	7,296,679.56

#### 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	15,202,534.39
股票投资	15,202,534.39
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	15,202,534.39

#### 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	75,018.03
基金转换费收入	194.12
合计	75,212.15

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，持有期不少于 7 日的赎回费用不低于 25% 的部分归入基金财产。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. 本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中对持有期少于 7 日的转出基金赎回费用全额计入基金财产，持有期不少于 7 日的转出基金赎回费用不低于 25% 的部分归入基金财产。

#### 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	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	9,600.00
银行划款手续费	2,949.66
银行间费用	9,000.00
合计	118,248.91

#### 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	-	-	45,112,430.27	2.22

#### 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	42,015.36	2.33	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结



算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,009,404.28	6,133,033.00
其中：支付销售机构的客户维护费	714,486.30	724,268.30

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 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	668,234.03	1,022,172.24

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

##### 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		
	华泰柏瑞量化先行混合 A	华泰柏瑞量化先行混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	80.76	80.76
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	450,984.68	450,984.68
合计	0.00	451,065.44	451,065.44

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		
	华泰柏瑞量化先行混合 A	华泰柏瑞量化先行混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	121,172.71	121,172.71
合计	0.00	121,172.71	121,172.71

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.8% 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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	华泰柏瑞量化先行混合 A	华泰柏瑞量化先行混合 C
基金合同生效日（2010年6月22日）持有的基金份额	10,000,600.00	0.00
报告期初持有的基金份额	146,376.81	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	146,376.81	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0540%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
	华泰柏瑞量化先行混合 A	华泰柏瑞量化先行混合 C
基金合同生效日（2010年6月22日）持有的基金份额	10,000,600.00	0.00
报告期初持有的基金份额	146,376.81	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	146,376.81	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0410%	0.0000%

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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	36,683,796.02	69,656.29	134,733,625.84	98,882.27
------------	---------------	-----------	----------------	-----------

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	60,717	345,479.73
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	19,406	215,406.60
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
华泰联合证券	601916.SH	浙商银行	网上配股	373,620	754,712.40
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	4,934	280,645.92
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	新股锁定期内	11.88	21.02	691	8,209.08	14,524.82	-
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	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-

				期 内						
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	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-

	勃股份	年6月8日		股锁定期内						
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	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	38.13	31.03	686	26,157.18	21,286.58	-
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	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

				内						
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	554	17,916.36	17,650.44	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定期内	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
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	2023	6个月	新	76.80	107.95	305	23,424.00	32,924.75	-



	恩斯特	年 5 月 4 日		股 锁 定 期 内						
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	236	17,334.20	11,007.04	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
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	680	16,163.60	29,165.20	-
301360	荣旗科	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	-

	技	日		定						
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	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-

				内						
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	709	14,172.91	11,982.10	-
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	3,681	212,246.46	212,246.46	-
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	2023年3月30日	6个月	新股锁	6.58	7.58	1,513	9,955.54	11,468.54	-

	属	日		定期内						
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	10.36	11.84	591	6,122.76	6,997.44	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	11.66	12.26	516	6,016.56	6,326.16	-
601916	浙商银行	2023年6月27日	1个月内(含)	配股流通受限	2.02	2.64	373,620	754,712.40	986,356.80	-
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	504	8,971.20	9,016.56	-
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	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

				内						
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定期内	36.15	38.13	490	17,713.50	18,683.70	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定期内	19.86	18.06	3,073	61,029.78	55,498.38	-
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	1,445	17,484.50	17,441.15	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	23.60	64.67	452	10,667.20	29,230.84	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定期内	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定期内	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智	2023	6个月	新	37.88	29.49	1,023	38,751.24	30,168.27	-

	翔金泰	年6月13日		股锁定期内						
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	6,072	34,549.68	32,849.52	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定期内	11.10	17.04	1,941	21,545.10	33,074.64	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定期内	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	39.99	36.71	490	19,595.10	17,987.90	-
688507	索辰科	2023年4月10日	6个月	新股锁定期内	245.56	122.11	129	21,363.72	15,752.19	-

	技	日		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	197	30,018.86	26,786.09	-
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	348	15,197.16	18,461.40	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定期内	21.17	23.50	656	13,887.52	15,416.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

				内						
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	125.80	118.03	128	16,102.40	15,107.84	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	26.74	40.68	525	14,038.50	21,357.00	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定期内	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定期内	125.88	86.79	147	18,504.36	12,758.13	-
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	2023年6月	6个月	新股	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-



	信息	月 19 日		锁定期内						
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、债券投资和股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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	36,683,796.02	-	-	-	-	-	36,683,796.02
结算备付金	1,232,427.56	-	-	-	-	-	1,232,427.56
存出保证金	51,053.92	-	-	-	-	-	51,053.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	493,965,590.22	493,965,590.22
应收申购款	-	-	-	-	-	53,798.41	53,798.41
资产总计	37,967,277.50	-	-	-	-	494,019,388.63	531,986,666.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	210,188.84	210,188.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	640,037.57	640,037.57
应付托管费	-	-	-	-	-	106,672.94	106,672.94
应付清算款	-	-	-	-	-	4,422,854.40	4,422,854.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	109,363.35	109,363.35

其他负债	-	-	-	-	-	480,552.34	480,552.34
负债总计	-	-	-	-	-	5,969,669.44	5,969,669.44
利率敏感度缺口	37,967,277.50	-	-	-	-	-488,049,719.19	526,016,996.69
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	28,227,923.44	-	-	-	-	-	28,227,923.44
结算备付金	1,198,925.24	-	-	-	-	-	1,198,925.24
存出保证金	200,111.31	-	-	-	-	-	200,111.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-483,713,846.50	483,713,846.50
应收申购款	-	-	-	-	-	266,386.40	266,386.40
资产总计	29,626,959.99	-	-	-	-	-483,980,232.90	513,607,192.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	54,613.13	54,613.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	662,009.66	662,009.66
应付托管费	-	-	-	-	-	110,334.96	110,334.96
应付清算款	-	-	-	-	-	2,372.97	2,372.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-	53,086.61	53,086.61
应交税费	-	-	-	-	-	0.50	0.50
其他负债	-	-	-	-	-	690,621.50	690,621.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,573,039.33	1,573,039.33
利率敏感度缺口	29,626,959.99	-	-	-	-	-482,407,193.57	512,034,153.56

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降

低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	493,965,590.22	93.91	483,713,846.50	94.47
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	493,965,590.22	93.91	483,713,846.50	94.47

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	20,855,775.76	22,911,846.83
沪深 300 指数下降 5%	-20,855,775.76	-22,911,846.83	

#### 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	491,188,385.81	480,920,739.17
第二层次	1,637,064.60	1,334,114.04
第三层次	1,140,139.81	1,458,993.29
合计	493,965,590.22	483,713,846.50

**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	493,965,590.22	92.85
	其中：股票	493,965,590.22	92.85
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	37,916,223.58	7.13
8	其他各项资产	104,852.33	0.02
9	合计	531,986,666.13	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	3,650,010.80	0.69
B	采矿业	35,775,196.77	6.80
C	制造业	295,609,601.36	56.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,078,512.87	2.87
E	建筑业	13,677,621.47	2.60
F	批发和零售业	22,254,831.05	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	10,843,324.00	2.06
H	住宿和餐饮业	178,130.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,680,954.24	5.45
J	金融业	45,934,326.85	8.73
K	房地产业	5,854,253.00	1.11
L	租赁和商务服务业	5,145,611.90	0.98
M	科学研究和技术服务业	3,085,155.28	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	2,134,322.77	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	870,910.00	0.17
Q	卫生和社会工作	908,059.86	0.17
R	文化、体育和娱乐业	4,284,768.00	0.81
S	综合	-	-



	合计	493,965,590.22	93.91
--	----	----------------	-------

### 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	300532	今天国际	237,300	4,878,888.00	0.93
2	000552	甘肃能化	1,425,700	4,747,581.00	0.90
3	600566	济川药业	158,200	4,594,128.00	0.87
4	601717	郑煤机	366,703	4,565,452.35	0.87
5	603856	东宏股份	321,100	4,235,309.00	0.81
6	688390	固德威	24,926	4,159,152.36	0.79
7	000923	河钢资源	304,027	4,104,364.50	0.78
8	600026	中远海能	323,400	4,087,776.00	0.78
9	601137	博威合金	257,000	3,998,920.00	0.76
10	002782	可立克	256,500	3,921,885.00	0.75
11	002223	鱼跃医疗	108,350	3,899,516.50	0.74
12	600919	江苏银行	529,687	3,893,199.45	0.74
13	601699	潞安环能	216,600	3,534,912.00	0.67
14	300861	美畅股份	80,700	3,499,959.00	0.67
15	002600	领益智造	502,600	3,472,966.00	0.66
16	601318	中国平安	74,500	3,456,800.00	0.66
17	688020	方邦股份	68,400	3,417,948.00	0.65
18	603368	柳药集团	138,300	3,417,393.00	0.65
19	601916	浙商银行	1,293,220	3,414,100.80	0.65
20	000776	广发证券	231,600	3,406,836.00	0.65
21	601336	新华保险	92,500	3,401,225.00	0.65
22	600039	四川路桥	345,480	3,389,158.80	0.64
23	600050	中国联通	700,790	3,363,792.00	0.64
24	601211	国泰君安	239,500	3,350,605.00	0.64
25	603609	禾丰股份	361,520	3,289,832.00	0.63
26	300866	安克创新	37,400	3,272,500.00	0.62
27	000933	神火股份	248,900	3,235,700.00	0.62
28	300839	博汇股份	241,840	3,214,053.60	0.61
29	601231	环旭电子	207,800	3,108,688.00	0.59
30	600428	中远海特	486,200	3,063,060.00	0.58
31	000528	柳工	387,200	3,058,880.00	0.58
32	600489	中金黄金	294,100	3,038,053.00	0.58
33	600483	福能股份	261,200	3,016,860.00	0.57
34	002955	鸿合科技	127,600	3,004,980.00	0.57
35	600901	江苏金租	713,820	2,948,076.60	0.56

36	688665	四方光电	31,593	2,941,940.16	0.56
37	300354	东华测试	64,600	2,887,620.00	0.55
38	601668	中国建筑	502,500	2,884,350.00	0.55
39	002965	祥鑫科技	51,100	2,845,248.00	0.54
40	603129	春风动力	17,500	2,833,250.00	0.54
41	000728	国元证券	427,200	2,785,344.00	0.53
42	300622	博士眼镜	117,400	2,770,640.00	0.53
43	600985	淮北矿业	237,600	2,737,152.00	0.52
44	002244	滨江集团	301,400	2,658,348.00	0.51
45	300433	蓝思科技	225,400	2,650,704.00	0.50
46	688630	芯碁微装	31,283	2,628,397.66	0.50
47	000768	中航西飞	97,000	2,594,750.00	0.49
48	300421	力星股份	214,440	2,560,413.60	0.49
49	300628	亿联网络	72,880	2,555,901.60	0.49
50	600380	健康元	199,601	2,536,928.71	0.48
51	300349	金卡智能	182,200	2,528,936.00	0.48
52	002727	一心堂	94,800	2,502,720.00	0.48
53	002736	国信证券	286,400	2,500,272.00	0.48
54	300791	仙乐健康	86,000	2,497,440.00	0.47
55	300775	三角防务	73,100	2,469,318.00	0.47
56	600057	厦门象屿	279,992	2,435,930.40	0.46
57	002829	星网宇达	54,700	2,402,971.00	0.46
58	300860	锋尚文化	43,200	2,395,008.00	0.46
59	688318	财富趋势	23,800	2,379,286.00	0.45
60	600038	中直股份	59,600	2,373,272.00	0.45
61	300724	捷佳伟创	21,100	2,370,585.00	0.45
62	002993	奥海科技	68,600	2,326,912.00	0.44
63	002155	湖南黄金	189,400	2,310,680.00	0.44
64	600438	通威股份	66,448	2,279,830.88	0.43
65	601601	中国太保	87,600	2,275,848.00	0.43
66	605123	派克新材	20,900	2,270,785.00	0.43
67	600256	广汇能源	330,900	2,269,974.00	0.43
68	601958	金钼股份	203,100	2,264,565.00	0.43
69	600481	双良节能	161,700	2,260,566.00	0.43
70	000915	华特达因	63,900	2,255,031.00	0.43
71	000898	鞍钢股份	804,500	2,236,510.00	0.43
72	000858	五粮液	13,600	2,224,552.00	0.42
73	000739	普洛药业	125,300	2,222,822.00	0.42
74	601377	兴业证券	359,200	2,198,304.00	0.42
75	605009	豪悦护理	45,588	2,188,224.00	0.42
76	603605	珀莱雅	18,960	2,131,104.00	0.41
77	000726	鲁泰 A	311,300	2,129,292.00	0.40
78	600998	九州通	204,264	2,120,260.32	0.40

79	002978	安宁股份	65,600	2,106,416.00	0.40
80	002938	鹏鼎控股	86,500	2,101,085.00	0.40
81	002925	盈趣科技	108,300	2,101,020.00	0.40
82	301039	中集车辆	157,100	2,078,433.00	0.40
83	002466	天齐锂业	29,500	2,062,345.00	0.39
84	688408	中信博	24,400	2,057,652.00	0.39
85	688501	青达环保	91,909	2,044,975.25	0.39
86	601899	紫金矿业	179,800	2,044,326.00	0.39
87	603185	弘元绿能	26,880	2,003,904.00	0.38
88	600089	特变电工	89,900	2,003,871.00	0.38
89	000951	中国重汽	117,760	1,984,256.00	0.38
90	601186	中国铁建	201,400	1,983,790.00	0.38
91	601619	嘉泽新能	430,800	1,960,140.00	0.37
92	600765	中航重机	72,600	1,924,626.00	0.37
93	600096	云天化	112,100	1,913,547.00	0.36
94	603233	大参林	68,160	1,909,161.60	0.36
95	300595	欧普康视	62,800	1,895,932.00	0.36
96	300144	宋城演艺	152,400	1,889,760.00	0.36
97	600863	内蒙华电	446,100	1,851,315.00	0.35
98	603883	老百姓	62,000	1,850,700.00	0.35
99	301179	泽宇智能	53,871	1,815,452.70	0.35
100	600582	天地科技	307,400	1,792,142.00	0.34
101	300457	赢合科技	100,663	1,777,708.58	0.34
102	002583	海能达	305,000	1,772,050.00	0.34
103	002139	拓邦股份	134,200	1,751,310.00	0.33
104	688516	奥特维	9,200	1,733,280.00	0.33
105	601168	西部矿业	164,214	1,725,889.14	0.33
106	002384	东山精密	66,600	1,724,940.00	0.33
107	300750	宁德时代	7,440	1,702,197.60	0.32
108	002410	广联达	52,360	1,701,176.40	0.32
109	000932	华菱钢铁	351,900	1,678,563.00	0.32
110	000591	太阳能	246,300	1,669,914.00	0.32
111	000967	盈峰环境	330,100	1,667,005.00	0.32
112	601872	招商轮船	285,800	1,654,782.00	0.31
113	002937	兴瑞科技	67,100	1,650,660.00	0.31
114	688599	天合光能	38,600	1,644,746.00	0.31
115	688556	高测股份	30,920	1,643,088.80	0.31
116	600021	上海电力	152,100	1,638,117.00	0.31
117	002422	科伦药业	55,000	1,632,400.00	0.31
118	000878	云南铜业	147,500	1,629,875.00	0.31
119	688063	派能科技	8,200	1,625,650.00	0.31
120	002444	巨星科技	73,700	1,612,556.00	0.31
121	603939	益丰药房	43,400	1,605,800.00	0.31

122	000425	徐工机械	236,200	1,599,074.00	0.30
123	002458	益生股份	128,200	1,583,270.00	0.30
124	000513	丽珠集团	40,500	1,575,855.00	0.30
125	600362	江西铜业	82,800	1,571,544.00	0.30
126	002299	圣农发展	81,400	1,558,810.00	0.30
127	603279	景津装备	49,600	1,555,456.00	0.30
128	688188	柏楚电子	8,227	1,551,283.12	0.29
129	600821	金开新能	225,100	1,550,939.00	0.29
130	600297	广汇汽车	745,000	1,549,600.00	0.29
131	601003	柳钢股份	382,300	1,544,492.00	0.29
132	002997	瑞鹄模具	51,600	1,534,068.00	0.29
133	002409	雅克科技	20,900	1,523,192.00	0.29
134	603688	石英股份	13,200	1,502,688.00	0.29
135	300122	智飞生物	33,900	1,498,380.00	0.28
136	603225	新凤鸣	134,600	1,487,330.00	0.28
137	300795	米奥会展	35,450	1,478,619.50	0.28
138	002283	天润工业	227,200	1,458,624.00	0.28
139	600999	招商证券	107,400	1,457,418.00	0.28
140	601390	中国中铁	189,700	1,437,926.00	0.27
141	601577	长沙银行	185,100	1,436,376.00	0.27
142	000975	银泰黄金	122,700	1,435,590.00	0.27
143	000498	山东路桥	221,100	1,419,462.00	0.27
144	600160	巨化股份	103,000	1,419,340.00	0.27
145	300856	科思股份	17,900	1,409,983.00	0.27
146	002539	云图控股	153,100	1,374,838.00	0.26
147	600153	建发股份	124,500	1,358,295.00	0.26
148	601869	长飞光纤	36,500	1,350,865.00	0.26
149	688578	艾力斯	49,800	1,342,110.00	0.26
150	002821	凯莱英	11,100	1,308,246.00	0.25
151	300121	阳谷华泰	135,600	1,294,980.00	0.25
152	300827	上能电气	35,903	1,294,303.15	0.25
153	605266	健之佳	15,400	1,290,982.00	0.25
154	000001	平安银行	114,900	1,290,327.00	0.25
155	600502	安徽建工	243,200	1,284,096.00	0.24
156	601975	招商南油	448,700	1,283,282.00	0.24
157	603392	万泰生物	19,200	1,281,984.00	0.24
158	300910	瑞丰新材	25,460	1,280,638.00	0.24
159	603444	吉比特	2,600	1,276,886.00	0.24
160	600383	金地集团	175,800	1,267,518.00	0.24
161	002025	航天电器	19,800	1,263,240.00	0.24
162	601567	三星医疗	99,900	1,261,737.00	0.24
163	688078	龙软科技	24,400	1,257,820.00	0.24
164	002459	晶澳科技	30,160	1,257,672.00	0.24

165	002929	润建股份	28,700	1,245,867.00	0.24
166	600285	羚锐制药	76,500	1,228,590.00	0.23
167	000568	泸州老窖	5,800	1,215,506.00	0.23
168	300726	宏达电子	27,000	1,207,440.00	0.23
169	601155	新城控股	83,700	1,206,117.00	0.23
170	600585	海螺水泥	49,600	1,177,504.00	0.22
171	002572	索菲亚	67,400	1,174,108.00	0.22
172	000488	晨鸣纸业	241,400	1,170,790.00	0.22
173	002446	盛路通信	121,800	1,151,010.00	0.22
174	002027	分众传媒	168,800	1,149,528.00	0.22
175	605117	德业股份	7,660	1,145,553.00	0.22
176	002475	立讯精密	35,200	1,142,240.00	0.22
177	002484	江海股份	53,400	1,136,886.00	0.22
178	000100	TCL 科技	280,730	1,106,076.20	0.21
179	601618	中国中冶	278,000	1,103,660.00	0.21
180	000913	钱江摩托	60,300	1,099,269.00	0.21
181	601169	北京银行	234,700	1,086,661.00	0.21
182	300088	长信科技	178,500	1,076,355.00	0.20
183	688261	东微半导	7,680	1,074,201.60	0.20
184	603678	火炬电子	31,100	1,071,706.00	0.20
185	688002	睿创微纳	23,600	1,057,280.00	0.20
186	002179	中航光电	22,800	1,033,980.00	0.20
187	603456	九洲药业	37,600	1,029,488.00	0.20
188	601615	明阳智能	60,500	1,021,240.00	0.19
189	002518	科士达	25,500	1,020,255.00	0.19
190	300296	利亚德	154,700	1,010,191.00	0.19
191	603383	顶点软件	18,200	1,008,644.00	0.19
192	600030	中信证券	50,900	1,006,802.00	0.19
193	601222	林洋能源	122,100	999,999.00	0.19
194	000155	川能动力	69,400	999,360.00	0.19
195	601311	骆驼股份	107,000	992,960.00	0.19
196	688006	杭可科技	32,480	989,665.60	0.19
197	002389	航天彩虹	44,500	988,345.00	0.19
198	002625	光启技术	64,400	982,744.00	0.19
199	300115	长盈精密	82,200	979,002.00	0.19
200	688123	聚辰股份	18,200	977,704.00	0.19
201	601766	中国中车	147,000	955,500.00	0.18
202	600060	海信视像	38,066	942,133.50	0.18
203	603639	海利尔	52,300	937,216.00	0.18
204	300896	爱美客	2,100	934,395.00	0.18
205	603529	爱玛科技	28,950	932,769.00	0.18
206	002563	森马服饰	148,600	924,292.00	0.18
207	688617	惠泰医疗	2,439	911,576.25	0.17

208	600875	东方电气	48,400	902,660.00	0.17
209	000672	上峰水泥	98,600	900,218.00	0.17
210	603127	昭衍新药	22,000	899,800.00	0.17
211	000596	古井贡酒	3,600	890,568.00	0.17
212	600398	海澜之家	128,100	881,328.00	0.17
213	601997	贵阳银行	169,900	876,684.00	0.17
214	002607	中公教育	185,300	870,910.00	0.17
215	002990	盛视科技	23,600	868,480.00	0.17
216	688239	航宇科技	12,390	866,680.50	0.16
217	002056	横店东磁	47,300	861,333.00	0.16
218	603218	日月股份	45,200	858,348.00	0.16
219	002192	融捷股份	12,800	855,424.00	0.16
220	688208	道通科技	28,200	854,742.00	0.16
221	002100	天康生物	102,700	847,275.00	0.16
222	688625	呈和科技	21,413	839,175.47	0.16
223	300384	三联虹普	47,800	812,122.00	0.15
224	601016	节能风电	219,820	806,739.40	0.15
225	000567	海德股份	62,640	803,044.80	0.15
226	300450	先导智能	22,200	802,974.00	0.15
227	688517	金冠电气	35,653	782,939.88	0.15
228	300693	盛弘股份	21,105	779,196.60	0.15
229	600563	法拉电子	5,600	768,880.00	0.15
230	600183	生益科技	54,100	768,220.00	0.15
231	003000	劲仔食品	60,900	766,731.00	0.15
232	601838	成都银行	62,700	765,567.00	0.15
233	300389	艾比森	37,000	753,690.00	0.14
234	301030	仕净科技	10,900	753,190.00	0.14
235	603267	鸿远电子	11,500	750,950.00	0.14
236	600546	山煤国际	51,800	749,546.00	0.14
237	000733	振华科技	7,800	747,630.00	0.14
238	603317	天味食品	51,140	747,155.40	0.14
239	600131	国网信通	37,000	747,030.00	0.14
240	000408	藏格矿业	32,200	726,754.00	0.14
241	603799	华友钴业	15,758	723,449.78	0.14
242	600066	宇通客车	46,700	688,358.00	0.13
243	603032	德新科技	19,900	687,346.00	0.13
244	600918	中泰证券	99,000	684,090.00	0.13
245	600535	天士力	46,800	679,068.00	0.13
246	688676	金盘科技	22,393	678,283.97	0.13
247	600019	宝钢股份	120,500	677,210.00	0.13
248	002212	天融信	69,100	670,270.00	0.13
249	603979	金诚信	21,500	668,650.00	0.13
250	601012	隆基绿能	23,000	659,410.00	0.13

251	600837	海通证券	70,800	652,776.00	0.12
252	603369	今世缘	12,200	644,160.00	0.12
253	000034	神州数码	24,059	639,728.81	0.12
254	601969	海南矿业	96,300	633,654.00	0.12
255	603337	杰克股份	33,100	630,224.00	0.12
256	300332	天壕环境	54,600	626,262.00	0.12
257	605507	国邦医药	29,400	625,338.00	0.12
258	688618	三旺通信	8,880	601,353.60	0.11
259	002273	水晶光电	50,000	597,000.00	0.11
260	300454	深信服	5,200	588,900.00	0.11
261	002353	杰瑞股份	22,700	570,451.00	0.11
262	301103	何氏眼科	13,500	566,460.00	0.11
263	002567	唐人神	84,300	560,595.00	0.11
264	688100	威胜信息	18,800	560,428.00	0.11
265	688009	中国通号	95,400	553,320.00	0.11
266	002609	捷顺科技	46,800	545,688.00	0.10
267	601319	中国人保	92,800	541,952.00	0.10
268	002258	利尔化学	41,900	540,929.00	0.10
269	600801	华新水泥	43,546	537,793.10	0.10
270	603993	洛阳钼业	100,200	534,066.00	0.10
271	301257	普蕊斯	9,500	533,900.00	0.10
272	002202	金风科技	50,200	533,124.00	0.10
273	688621	阳光诺和	8,940	525,850.80	0.10
274	601555	东吴证券	75,400	523,276.00	0.10
275	000893	亚钾国际	22,400	513,856.00	0.10
276	002532	天山铝业	84,900	508,551.00	0.10
277	300761	立华股份	27,560	507,930.80	0.10
278	688559	海目星	10,800	507,708.00	0.10
279	300119	瑞普生物	28,500	507,300.00	0.10
280	603676	卫信康	36,300	501,666.00	0.10
281	300796	贝斯美	40,860	491,545.80	0.09
282	000703	恒逸石化	71,800	486,804.00	0.09
283	600958	东方证券	48,796	473,321.20	0.09
284	000997	新大陆	24,800	468,720.00	0.09
285	003006	百亚股份	26,700	461,376.00	0.09
286	600409	三友化工	82,900	451,805.00	0.09
287	002624	完美世界	26,600	449,274.00	0.09
288	603136	天目湖	17,400	448,920.00	0.09
289	000002	万科 A	32,000	448,640.00	0.09
290	605339	南侨食品	22,400	445,984.00	0.08
291	002371	北方华创	1,400	444,710.00	0.08
292	002756	永兴材料	6,880	430,756.80	0.08
293	688258	卓易信息	6,400	427,072.00	0.08

294	603808	歌力思	31,700	416,221.00	0.08
295	600348	华阳股份	51,450	406,969.50	0.08
296	002123	梦网科技	30,200	401,358.00	0.08
297	600642	申能股份	54,800	383,052.00	0.07
298	300616	尚品宅配	18,800	381,264.00	0.07
299	000807	云铝股份	29,500	375,535.00	0.07
300	603871	嘉友国际	23,800	373,898.00	0.07
301	300888	稳健医疗	8,960	373,363.20	0.07
302	603878	武进不锈	41,000	346,450.00	0.07
303	000683	远兴能源	47,200	339,368.00	0.06
304	600519	贵州茅台	200	338,200.00	0.06
305	600873	梅花生物	37,800	337,554.00	0.06
306	600219	南山铝业	111,400	336,428.00	0.06
307	002402	和而泰	19,800	336,204.00	0.06
308	688518	联赢激光	11,800	328,748.00	0.06
309	601636	旗滨集团	38,100	328,422.00	0.06
310	002768	国恩股份	13,200	319,308.00	0.06
311	600989	宝丰能源	25,300	319,033.00	0.06
312	002044	美年健康	44,700	317,817.00	0.06
313	600808	马钢股份	123,500	317,395.00	0.06
314	002603	以岭药业	12,200	313,418.00	0.06
315	688601	力芯微	6,641	312,791.10	0.06
316	002635	安洁科技	22,400	309,120.00	0.06
317	003012	东鹏控股	37,900	306,611.00	0.06
318	603587	地素时尚	20,900	305,976.00	0.06
319	605020	永和股份	11,620	299,912.20	0.06
320	300638	广和通	13,200	299,376.00	0.06
321	603259	药明康德	4,800	299,088.00	0.06
322	300390	天华新能	8,320	297,856.00	0.06
323	600109	国金证券	33,800	293,046.00	0.06
324	002976	瑞玛精密	10,300	288,091.00	0.05
325	002468	申通快递	26,500	286,730.00	0.05
326	300232	洲明科技	31,200	285,168.00	0.05
327	688112	鼎阳科技	5,398	284,906.44	0.05
328	002304	洋河股份	2,100	275,835.00	0.05
329	001979	招商蛇口	21,000	273,630.00	0.05
330	002416	爱施德	36,300	267,894.00	0.05
331	688800	瑞可达	4,292	266,747.80	0.05
332	000876	新希望	22,000	256,960.00	0.05
333	600547	山东黄金	10,496	246,446.08	0.05
334	688582	芯动联科	5,249	242,676.40	0.05
335	600909	华安证券	51,800	241,906.00	0.05
336	600236	桂冠电力	42,600	237,282.00	0.05



337	600031	三一重工	14,100	234,483.00	0.04
338	000738	航发控制	9,500	231,800.00	0.04
339	002560	通达股份	23,600	224,672.00	0.04
340	601138	工业富联	8,500	214,200.00	0.04
341	301486	致尚科技	3,681	212,246.46	0.04
342	002545	东方铁塔	29,700	209,682.00	0.04
343	603212	赛伍技术	9,800	203,938.00	0.04
344	002483	润邦股份	35,000	203,000.00	0.04
345	600809	山西汾酒	1,000	185,070.00	0.04
346	000630	铜陵有色	63,500	183,515.00	0.03
347	600196	复星医药	5,900	182,310.00	0.03
348	600258	首旅酒店	9,400	178,130.00	0.03
349	600995	南网储能	15,500	170,655.00	0.03
350	002839	张家港行	40,300	170,469.00	0.03
351	600820	隧道股份	27,700	166,477.00	0.03
352	601728	中国电信	29,400	165,522.00	0.03
353	688083	中望软件	1,121	162,421.69	0.03
354	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.03
355	603338	浙江鼎力	2,800	156,828.00	0.03
356	603313	梦百合	14,700	147,441.00	0.03
357	002876	三利谱	4,300	142,631.00	0.03
358	603556	海兴电力	5,600	141,344.00	0.03
359	000792	盐湖股份	7,100	136,107.00	0.03
360	000935	四川双马	8,000	134,720.00	0.03
361	600167	联美控股	19,000	132,430.00	0.03
362	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
363	600859	王府井	5,700	112,803.00	0.02
364	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
365	600012	皖通高速	8,950	93,796.00	0.02
366	000762	西藏矿业	2,900	85,927.00	0.02
367	000785	居然之家	21,400	81,534.00	0.02
368	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
369	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
370	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
371	002555	三七互娱	2,000	69,760.00	0.01
372	601607	上海医药	2,631	58,960.71	0.01
373	600346	恒力石化	4,100	58,753.00	0.01
374	688249	晶合集成	3,073	55,498.38	0.01
375	603599	广信股份	1,600	43,328.00	0.01
376	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
377	688472	阿特斯	1,941	33,074.64	0.01
378	301325	曼恩斯特	305	32,924.75	0.01
379	688469	中芯集成	6,072	32,849.52	0.01

380	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
381	002648	卫星化学	2,100	31,416.00	0.01
382	688443	智翔金泰	1,023	30,168.27	0.01
383	688361	中科飞测	452	29,230.84	0.01
384	301358	湖南裕能	680	29,165.20	0.01
385	688531	日联科技	197	26,786.09	0.01
386	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.00
387	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
388	301291	明阳电气	686	21,286.58	0.00
389	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
390	688146	中船特气	490	18,683.70	0.00
391	688543	国科军工	348	18,461.40	0.00
392	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
393	688484	南芯科技	490	17,987.90	0.00
394	301307	美利信	554	17,650.44	0.00
395	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
396	688352	颀中科技	1,445	17,441.15	0.00
397	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
398	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
399	688507	索辰科技	129	15,752.19	0.00
400	688552	航天南湖	656	15,416.00	0.00
401	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
402	688581	安杰思	128	15,107.84	0.00
403	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
404	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
405	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
406	001287	中电港	691	14,524.82	0.00
407	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
408	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
409	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
410	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
411	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
412	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
413	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
414	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
415	688623	二元科技	147	12,758.13	0.00
416	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
417	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
418	301439	泓淋电力	709	11,982.10	0.00
419	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
420	601061	中信金属	1,513	11,468.54	0.00
421	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
422	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00

423	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
424	301345	涛涛车业	236	11,007.04	0.00
425	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
426	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
427	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
428	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
429	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
430	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
431	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
432	603135	中重科技	504	9,016.56	0.00
433	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
434	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
435	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
436	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
437	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
438	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
439	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
440	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
441	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
442	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
443	603527	众源新材	600	7,332.00	0.00
444	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
445	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
446	601065	江盐集团	591	6,997.44	0.00
447	601133	柏诚股份	516	6,326.16	0.00
448	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
449	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
450	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
451	300815	玉禾田	240	3,571.20	0.00
452	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
453	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
454	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
455	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
456	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
457	688032	禾迈股份	6	2,130.90	0.00
458	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600732	爱旭股份	5,295,575.00	1.03
2	002463	沪电股份	5,259,210.00	1.03

3	000552	甘肃能化	4,937,312.00	0.96
4	601336	新华保险	4,836,504.00	0.94
5	601916	浙商银行	4,754,763.40	0.93
6	600026	中远海能	4,554,136.00	0.89
7	688390	固德威	4,485,314.10	0.88
8	000923	河钢资源	4,223,002.23	0.82
9	603688	石英股份	4,126,389.00	0.81
10	300839	博汇股份	4,040,144.65	0.79
11	603856	东宏股份	3,976,060.00	0.78
12	600021	上海电力	3,945,840.00	0.77
13	000776	广发证券	3,940,931.00	0.77
14	002782	可立克	3,759,732.00	0.73
15	601318	中国平安	3,593,872.00	0.70
16	002223	鱼跃医疗	3,569,747.00	0.70
17	688020	方邦股份	3,548,231.61	0.69
18	600050	中国联通	3,500,115.80	0.68
19	600919	江苏银行	3,419,905.00	0.67
20	000975	银泰黄金	3,410,781.00	0.67

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	002463	沪电股份	7,717,230.10	1.51
2	600060	海信视像	7,111,945.00	1.39
3	600732	爱旭股份	5,524,434.40	1.08
4	603612	索通发展	5,262,849.99	1.03
5	300916	朗特智能	5,189,622.49	1.01
6	300570	太辰光	4,652,030.00	0.91
7	000028	国药一致	4,573,801.56	0.89
8	000921	海信家电	4,302,000.64	0.84
9	600873	梅花生物	4,192,141.00	0.82
10	600061	国投资本	4,008,471.48	0.78
11	603871	嘉友国际	3,829,143.00	0.75
12	300308	中际旭创	3,764,479.00	0.74
13	600390	五矿资本	3,653,334.00	0.71
14	300842	帝科股份	3,615,794.72	0.71
15	300616	尚品宅配	3,470,734.00	0.68
16	300390	天华新能	3,455,311.80	0.67
17	600967	内蒙一机	3,391,320.00	0.66
18	002597	金禾实业	3,235,380.00	0.63
19	002649	博彦科技	3,225,520.00	0.63
20	603920	世运电路	3,192,572.00	0.62

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	504,930,552.48
卖出股票收入（成交）总额	518,627,834.45

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	51,053.92
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	53,798.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,852.33

### 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 (%)
华泰柏瑞量化先行混合 A	19,058	9,583.97	78,919,570.23	43.21	103,731,818.91	56.79
华泰柏瑞量化先行混合 C	11,152	7,913.89	87,348,561.96	98.97	907,094.24	1.03
合计	30,152	8,984.71	166,268,132.19	61.37	104,638,913.15	38.63

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	华泰柏瑞量化先行混合 A	4,495,615.41	2.4613
	华泰柏瑞量化先行混合 C	1.03	0.0000
	合计	4,495,616.44	1.6595

### 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	华泰柏瑞量化先行混合 A	>100
	华泰柏瑞量化先行混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化先行混合 A	0
	华泰柏瑞量化先行混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化先行混合 A	华泰柏瑞量化先行混合 C
基金合同生效日（2010年6月22日）基金份额总额	732,677,425.51	-
本报告期期初基金份额总额	233,439,860.95	42,203,112.49
本报告期基金总申购份额	8,049,122.12	54,512,614.82
减：本报告期基金总赎回份额	58,837,593.93	8,460,071.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	182,651,389.14	88,255,656.20

## § 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

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 (%)	
浙商证券	3	415,261,913.61	41.10	299,533.50	38.41	-
海通证券	3	366,873,700.40	36.31	268,289.02	34.41	-
东方证券	1	165,130,226.11	16.35	153,783.61	19.72	-
招商证券	1	48,766,827.91	4.83	44,928.51	5.76	-
广发证券	1	14,231,836.	1.41	13,254.71	1.70	-



		57					
长城证券	1	-	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需  
要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供  
宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的  
特定要求，提供专题研究报告。

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

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

### 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 (%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	37,958.46	100.00	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需  
要，并能为基金提供全面的信息服

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。

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基金参与浙商银行股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 28 日
2	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
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 21 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 16 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 29 日

	下基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
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调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 10 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 2 月 23 日
14	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
15	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 1 月 17 日
16	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 1 月 13 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	20230101- 20230630;	64,830,61 6.97	49,603, 174.60	44,000,00 0.00	70,433,791.57	26.00
	2	20230101- 20230630;	57,472,14 1.15	0.00	0.00	57,472,141.15	21.21

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20% 的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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 层及基金托管人住所

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