

华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞恒利混合	
基金主代码	012953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 14 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	515,728,475.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
下属分级基金的交易代码	012953	012954
报告期末下属分级基金的份额总额	365,358,397.01 份	150,370,078.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活合理配置，追求超越业绩比较基准的投资回报力争金产持续稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资益。2、债券组合投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资业务的投资策略。
业绩比较基准	上证国债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 姓名	刘万方	龚小武

负责人	联系电话	021-38601777	021-52629999-212056
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200135	200120
法定代表人		贾波	吕家进

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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
本期已实现收益	15,156,928.61	4,812,145.22
本期利润	23,098,758.12	5,949,582.64
加权平均基金份额本期利润	0.0505	0.0401
本期加权平均净值利润率	4.51%	3.58%
本期基金份额净值增长率	4.35%	4.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	46,988,051.54	18,374,044.11

润		
期末可供分配基金份额利润	0.1286	0.1222
期末基金资产净值	417,353,610.62	170,796,611.28
期末基金份额净值	1.1423	1.1358
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.23%	13.58%

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

华泰柏瑞恒利混合 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	-1.07%	0.21%	-0.05%	0.10%	-1.02%	0.11%
过去三个月	0.51%	0.26%	1.64%	0.15%	-1.13%	0.11%
过去六个月	4.35%	0.26%	3.70%	0.18%	0.65%	0.08%
过去一年	5.03%	0.21%	2.71%	0.17%	2.32%	0.04%
自基金合同生效起至今	14.23%	0.23%	3.63%	0.21%	10.60%	0.02%

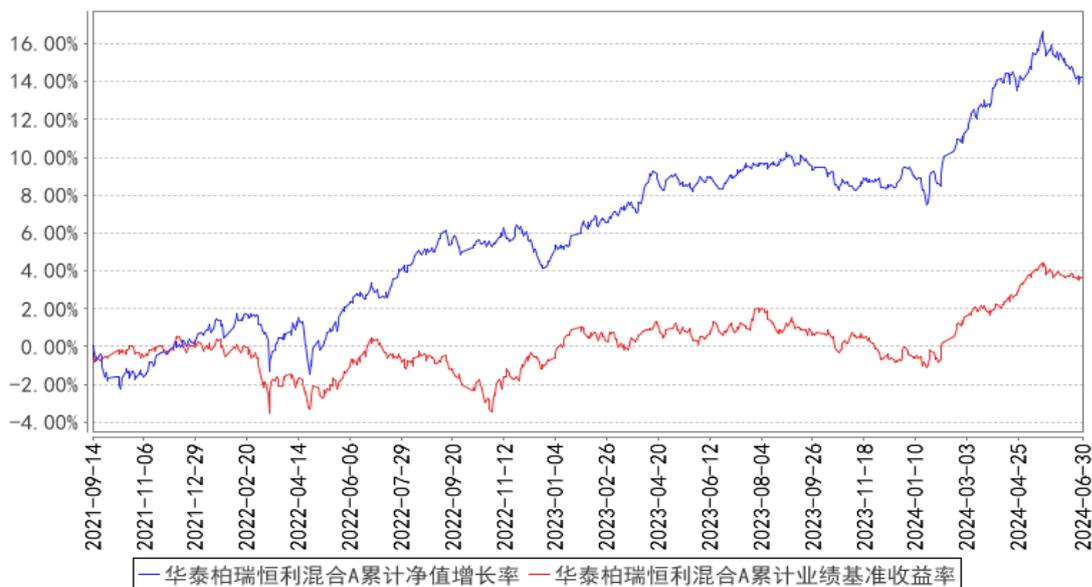
华泰柏瑞恒利混合 C

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	-1.09%	0.21%	-0.05%	0.10%	-1.04%	0.11%
过去三个月	0.46%	0.26%	1.64%	0.15%	-1.18%	0.11%

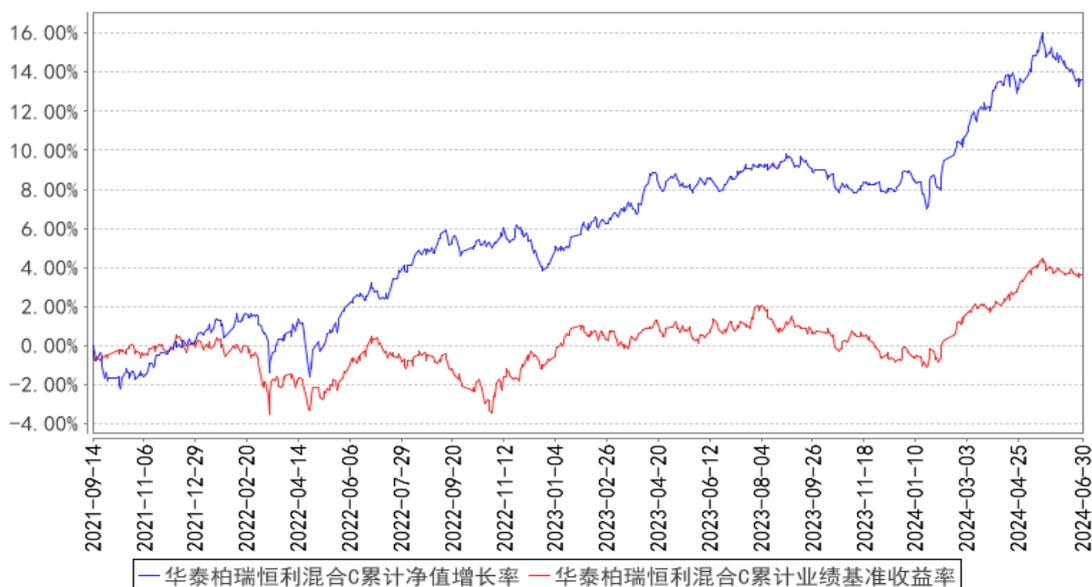
过去六个月	4.24%	0.26%	3.70%	0.18%	0.54%	0.08%
过去一年	4.82%	0.21%	2.71%	0.17%	2.11%	0.04%
自基金合同生效起 至今	13.58%	0.23%	3.63%	0.21%	9.95%	0.02%

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

华泰柏瑞恒利混合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



华泰柏瑞恒利混合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2021年9月14日至2024年6月30日。C类图示日期为2021年9月14日至2024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%。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下管理 156 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋人杰	本基金的基金经理助理	2023 年 1 月 3 日	-	9 年	纽约大学经济学硕士。曾任职于中信证券股份有限公司。2022 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金经理助理。
刘腾飞	本基金的基金经理助理	2024 年 3 月 5 日	-	6 年	上海交通大学企业管理专业硕士。曾任华泰保兴基金管理有限公司研究员。2022 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金经理助理。
何子建	固定收益部 副总监、本基金的基金经理	2021 年 9 月 14 日	-	10 年	工商管理硕士，经济学学士。2014 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员、基金经理助理。2019 年 3 月起任华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起任华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月起任华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 1 月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月至 2024 年 6 月任华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起任华泰柏瑞益享债券型证券投资基金的基

					金经理。
董辰	总经理助理、投资二部总监、本基金的基金经理	2021年9月14日	-	11年	上海理工大学金融学硕士，曾任长江证券首席分析师，2016年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任总经理助理、投资二部总监、基金经理。2020年7月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年8月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年12月起任华泰柏瑞多策略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的基金经理。2021年6月至2022年10月任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2021年9月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022年4月至2023年6月任华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金的基金经理。2022年6月至2023年7月任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。2023年2月起任华泰柏瑞招享6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023年5月起任华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金的基金经理。2023年6月起任华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

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。蒋人杰 2024 年 7 月 26 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 3 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益方面，2024 上半年 A 股市场走出“V”型走势。春节前在一些结构化产品的流动性冲击下 A 股快速下行，随后回归理性并在政策利好带动下持续反弹后整理。

上半年宏观经济整体稳健，1 季度较好，2 季度有所回落，在新旧动能转换的背景下取得 5% 的 GDP 增长实属不易。宏观政策更显积极，相继推出了大规模设备更新、汽车家电以旧换新以及房地产、利率等方面的政策，对宏观经济产生一定支撑，但落实到显效需要一个过程。我们对经济接下来的复苏势头仍然充满期待，对结构转型带来的国家竞争力长期提升抱有信心。

海外经济整体不佳，欧美衰退带动通胀回落对于我们的外需环境并不友好，但中国自身竞争力仍在持续提升，出口结构仍在持续升级，与“一带一路”国家的贸易势头良好，当前人民币汇率走势有利于出口企业的毛利率提升。美联储仍然维持高利率水平，但随着经济下行带动通胀回落，降息时点越来越近，这将有利于进一步打开国内的利率政策调节空间。

债券方面，2024 年上半年，债市收益率曲线震荡下行，呈现牛市特征。银行间体系流动性维持宽松。1 月下旬，降准落地，债市打开下行空间。春节假期前后，经济数据陆续公布，季节性较强的方面均表现不错。从投资和进出口等方面看，经济逐步企稳抬升。进入 3 月，市场聚焦两会，政府工作报告提出新一年经济增长目标与赤字率目标基本符合市场预期，在考虑了经济增长

潜力的同时，也考虑了促进就业增收和防范化解风险等因素。4 月中下旬，政府债供给低于去年同期，债市需求强于供给，长端利率债收益率持续下行，但随后债市转为阶段性调整行情。5 月，资金偏松，外需仍较强，地产相关的耐用品、消费电子类产品在海外补库周期的支撑下，出口表现较好。社融首次负增，特别国债落地，地产政策密集出台，具体措施包括放松限购、存量房收储、降低首付和房贷利率下限等，市场整体呈现震荡格局。进入 6 月，债市延续震荡走强态势。经济数据透露出经济平稳运行，但结构上有一定分化。受益于设备更新等政策，制造业投资增速边际加快；但基建投资回落，与专项债发行滞后有关。

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恒利混合 A 的基金份额净值为 1.1423 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.35%，同期业绩比较基准收益率为 3.70%，截至本报告期末华泰柏瑞恒利混合 C 的基金份额净值为 1.1358 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.24%，同期业绩比较基准收益率为 3.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，随着宏观政策进一步深化，政策效果逐渐显现，加之利率环境整体趋好，A 股有望重拾回升势头。本基金当前权益持仓主要在贵金属、房地产、制造业等方向，我们将继续在公司质量、景气度和成长空间三个维度精选个股，尽力控制回撤，力争获取超额收益。

展望下半年，经济企稳回升的趋势仍然需要进一步验证，重点关注各类市场对三中全会后将推出的财税体制改革和金融体制改革的实际落地政策效果。目前全市场风险偏好较低，如何提升风险偏好或将成为影响下半年市场走势至关重要的因素。利率曲线目前下行至较低位置，如何引导市场形成与经济增速预期相匹配的收益率曲线或也将是下半年债券市场交易的核心问题。

策略上，维持适当的久期与适中的杠杆水平，努力规避信用风险，同时把握时机博取资本利得，要更加灵活的进行配置与交易。

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

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红

利按照除权除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内未做利润分配。

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

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	5,382,642.14	6,264,810.01
结算备付金		453,218.52	5,986,950.60
存出保证金		42,961.58	51,147.49
交易性金融资产	6.4.7.2	760,383,312.57	1,099,841,313.29
其中：股票投资		114,068,152.73	166,561,282.95
基金投资		-	-
债券投资		646,315,159.84	933,280,030.34
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		-	317,688.45
应收股利		-	-
应收申购款		356,587.51	143,756.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		766,618,722.32	1,112,605,666.61
负债和净资产			
	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		177,116,386.30	262,140,634.70
应付清算款		226,009.48	-
应付赎回款		577,463.62	74,466.65
应付管理人报酬		293,337.52	470,466.01
应付托管费		48,889.58	78,410.99
应付销售服务费		29,138.04	32,255.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,118.75	4,842.75
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	174,157.13	271,051.16
负债合计		178,468,500.42	263,072,127.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	515,728,475.53	776,783,749.50
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	72,421,746.37	72,749,789.82
净资产合计		588,150,221.90	849,533,539.32
负债和净资产总计		766,618,722.32	1,112,605,666.61

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额为 515,728,475.53 份，其中华泰柏瑞恒利 A 类基金份额净值 1.1423 元，基金份额总额 365,358,397.01 份；华泰柏瑞恒利 C 类基金份额净值 1.1358 元，基金份额总额 150,370,078.52 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		33,355,304.15	44,156,654.12
1. 利息收入		28,538.71	51,754.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,538.71	37,160.39
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		-	14,593.90
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,218,001.25	31,244,211.22
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,513,456.59	20,514,891.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	14,623,318.20	8,854,161.64
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-750.45
股利收益	6.4.7.19	1,081,226.46	1,875,908.35
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	9,079,266.93	12,849,587.43
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	29,497.26	11,101.18
减：二、营业总支出		4,306,963.39	6,056,847.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,032,682.74	3,090,067.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	338,780.44	515,011.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	164,740.90	374,335.02
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,616,844.54	1,937,805.08
其中：卖出回购金融资产支出		1,616,844.54	1,937,805.08
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,927.20	5,332.34
8. 其他费用	6.4.7.23	150,987.57	134,296.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,048,340.76	38,099,806.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,048,340.76	38,099,806.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,048,340.76	38,099,806.34

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	776,783,749.50	-	72,749,789.82	849,533,539.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	776,783,749.50	-	72,749,789.82	849,533,539.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-261,055,273.97	-	-328,043.45	-261,383,317.42
(一)、综合收益总额	-	-	29,048,340.76	29,048,340.76
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-261,055,273.97	-	-29,376,384.21	-290,431,658.18
其中：1. 基金申购款	153,459,143.69	-	18,945,626.32	172,404,770.01
2. 基金赎回款	-414,514,417.66	-	-48,322,010.53	-462,836,428.19
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	515,728,475.53	-	72,421,746.37	588,150,221.90
项目	上年度可比期间			
	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	1,061,907,553.28	-	48,514,245.60	1,110,421,798.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,061,907,553.28	-	48,514,245.60	1,110,421,798.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-52,440,366.28	-	38,701,322.06	-13,739,044.22

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	38,099,806.34	38,099,806.34
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-52,440,366.28	-	601,515.72	-51,838,850.56
其中：1. 基金申购款	480,205,223.46	-	36,361,479.48	516,566,702.94
2. 基金赎回款	-532,645,589.74	-	-35,759,963.76	-568,405,553.50
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,009,467,187.00	-	87,215,567.66	1,096,682,754.66

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

华泰柏瑞恒利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[2021]2247 号《关于准予华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金注册的批复》注册,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞恒利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 240,004,598.81 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(2021)第 0910 号验资报告予以验证。经向中国证监会备

案,《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 240,023,948.90 份基金份额,其中认购资金利息折合 19,350.09 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,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《华泰柏瑞恒利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,包括国内依法发行或上市的股票(包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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”)、存托凭证、债券(包含国债、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)、可交换债券、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、同业存单、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)。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0%-30%;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%。本基金投资同业存单的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为上证国债指数收益率 \times 80%+沪深 300 指数收益率 \times 15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 \times 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 2024 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》、《华泰柏瑞恒利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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,382,642.14
等于：本金	5,382,026.46
加：应计利息	615.68
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	5,382,642.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	114,921,457.57	-	114,068,152.73	-853,304.84	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	629,757,303.97	7,580,159.84	646,315,159.84	8,977,696.03
	合计	629,757,303.97	7,580,159.84	646,315,159.84	8,977,696.03
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	744,678,761.54	7,580,159.84	760,383,312.57	8,124,391.19	

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	285.34

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	64,473.41
其中：交易所市场	47,095.27
银行间市场	17,378.14
应付利息	-
预提费用	109,398.38
合计	174,157.13

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞恒利混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	612,826,842.12	612,826,842.12
本期申购	91,888,962.97	91,888,962.97
本期赎回（以“-”号填列）	-339,357,408.08	-339,357,408.08
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	365,358,397.01	365,358,397.01

华泰柏瑞恒利混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,956,907.38	163,956,907.38
本期申购	61,570,180.72	61,570,180.72
本期赎回（以“-”号填列）	-75,157,009.58	-75,157,009.58
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	150,370,078.52	150,370,078.52

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：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞恒利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	57,736,699.11	317,484.94	58,054,184.05

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	57,736,699.11	317,484.94	58,054,184.05
本期利润	15,156,928.61	7,941,829.51	23,098,758.12
本期基金份额交易产生的变动数	-25,905,576.18	-3,252,152.38	-29,157,728.56
其中：基金申购款	9,696,595.70	1,371,793.80	11,068,389.50
基金赎回款	-35,602,171.88	-4,623,946.18	-40,226,118.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,988,051.54	5,007,162.07	51,995,213.61

华泰柏瑞恒利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,610,059.80	85,545.97	14,695,605.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,610,059.80	85,545.97	14,695,605.77
本期利润	4,812,145.22	1,137,437.42	5,949,582.64
本期基金份额交易产生的变动数	-1,048,160.91	829,505.26	-218,655.65
其中：基金申购款	6,522,553.18	1,354,683.64	7,877,236.82
基金赎回款	-7,570,714.09	-525,178.38	-8,095,892.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,374,044.11	2,052,488.65	20,426,532.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	12,819.04
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	15,406.45
其他	313.22
合计	28,538.71

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,513,456.59

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	8,513,456.59

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	153,409,338.18
减：卖出股票成本总额	144,681,727.35
减：交易费用	214,154.24
买卖股票差价收入	8,513,456.59

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,704,264.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,919,053.37
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	14,623,318.20

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	661,689,762.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	648,419,390.30
减：应计利息总额	7,345,093.66
减：交易费用	6,225.00
买卖债券差价收入	5,919,053.37

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 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	1,081,226.46
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	1,081,226.46

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	9,079,266.93
股票投资	6,753,686.76
债券投资	2,325,580.17
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	9,079,266.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	24,653.55
基金转换费收入	4,843.71
合计	29,497.26

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 50% 归入基金资产。C 类基金份额的赎回费全额归入基金资产。

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 50% 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	49,726.04

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	18,600.00
银行划款手续费	22,989.19
合计	150,987.57

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	97,121,168.89	40.98	215,108,516.94	49.87

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	177,339.06	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	90,628.00	74.15	37,319.68	79.24
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华泰证券	198,183.72	81.27	93,751.25	79.64

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（截至2024年6月30日）。

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,032,682.74	3,090,067.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	239,770.33	245,960.46
应支付基金管理人的净管理费	1,792,912.41	2,844,106.80

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	338,780.44	515,011.21

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	32,381.49	32,381.49
华泰证券股份有限公司	0.00	28.09	28.09
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	63,429.20	63,429.20
合计	0.00	95,838.78	95,838.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	98,023.02	98,023.02
华泰证券股份有限公司	0.00	40.56	40.56

华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	188,025.75	188,025.75
合计	0.00	286,089.33	286,089.33

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 0.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	-	-	-	260,000.00	29,345.64
					0.00	
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	79,948,985.21	-	-	-	1,387,000.00	324,221.38

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：本报告期及上年度可比期间，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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
兴业银行	5,382,642.14	12,819.04	4,674,986.28	19,099.33

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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 2024年1月1日至2024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	603312.SH	西典新能	网下申购	1,296	37609.92
华泰联合证券	688709.SH	成都华微	网下申购	10,448	163929.12
华泰联合证券	603341.SH	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合证券	301587.SZ	中瑞股份	网下申购	3,056	66406.88
上年度可比期间 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	106,601	606,559.69
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	42,152	467,887.20
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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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（2024 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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定期内	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期内	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定期内	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期内	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	55.82	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定期内	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	新股锁定期内	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-

301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定期内	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定期内	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定期内	16.20	15.96	1,161	18,808.20	18,529.56	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定期内	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定期内	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定期内	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定期内	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定期内	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-

603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定期内	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定期内	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定期内	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期内	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期内	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期内	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转

让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，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款余额 177,116,386.30 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220322	22 进出 22	2024 年 7 月 1 日	102.05	364,000	37,144,678.36
230413	23 农发 13	2024 年 7 月 1 日	102.90	900,000	92,613,049.18
240210	24 国开 10	2024 年 7 月 1 日	100.86	600,000	60,516,328.77
合计				1,864,000	190,274,056.31

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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兴业银行，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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 37.26% (2023 年 12 月 31 日：48.07%)。

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 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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 2024 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 2024 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							
货币资金	5,382,642.14	-	-	-	-	-	5,382,642.14
结算备付金	453,218.52	-	-	-	-	-	453,218.52
存出	42,961.58	-	-	-	-	-	42,961.58

保证金							
交易性金融资产	-	40,818,327.87	41,144,367.21	503,836,135.99	60,516,328.77	114,068,152.73	760,383,312.57
应收申购款	-	-	-	-	-	356,587.51	356,587.51
资产总计	5,878,822.24	40,818,327.87	41,144,367.21	503,836,135.99	60,516,328.77	114,424,740.24	766,618,722.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	577,463.62	577,463.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	293,337.52	293,337.52
应付托管费	-	-	-	-	-	48,889.58	48,889.58
应付清算款	-	-	-	-	-	226,009.48	226,009.48
卖出	177,116,386.30	-	-	-	-	-	177,116,386.30

回购金融资产款							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29,138.04	29,138.04
应交税费	-	-	-	-	-	3,118.75	3,118.75
其他负债	-	-	-	-	-	174,157.13	174,157.13
负债总计	177,116,386.30	-	-	-	-	1,352,114.12	178,468,500.42
利率敏感度缺口	-171,237,564.06	40,818,327.87	41,144,367.21	503,836,135.99	60,516,328.77	113,072,626.12	588,150,221.90
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资							

产							
货币资金	6,264,810.01	-	-	-	-	-	6,264,810.01
结算备付金	5,986,950.60	-	-	-	-	-	5,986,950.60
存出保证金	51,147.49	-	-	-	-	-	51,147.49
交易性金融资产	20,692,000.00	-	101,088,769.95	781,237,309.57	30,261,950.82	166,561,282.95	1,099,841,313.29
应收清算款	-	-	-	-	-	317,688.45	317,688.45
应收申购款	-	-	-	-	-	143,756.77	143,756.77
资产总计	32,994,908.10	-	101,088,769.95	781,237,309.57	30,261,950.82	167,022,728.17	1,112,605,666.61
负债							
卖出回购金融资产	262,140,634.70	-	-	-	-	-	262,140,634.70

产款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	74,466.65	74,466.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	470,466.01	470,466.01
应付托管费	-	-	-	-	-	78,410.99	78,410.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	32,255.03	32,255.03
应交税费	-	-	-	-	-	4,842.75	4,842.75
其他负债	-	-	-	-	-	271,051.16	271,051.16
负债总计	262,140,634.70	-	-	-	-	931,492.59	263,072,127.29
利率敏感度缺口	-229,145,726.60	101,088,769.95	781,237,309.57	30,261,950.82	166,091,235.58	849,533,539.32	

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

假设	除市场利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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	4,418,502.15	6,196,933.00
	市场利率上升 25 个基点	-4,358,877.20	-6,129,760.49

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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	114,068,152.73	19.39	166,561,282.95	19.61

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	114,068,152.73	19.39	166,561,282.95	19.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.39%(2023 年 12 月 31 日：19.61%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	113,561,169.09	165,374,534.39
第二层次	646,360,770.95	933,280,030.34
第三层次	461,372.53	1,186,748.56
合计	760,383,312.57	1,099,841,313.29

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的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 2024 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(2023 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	114,068,152.73	14.88
	其中:股票	114,068,152.73	14.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	646,315,159.84	84.31
	其中:债券	646,315,159.84	84.31
	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	5,835,860.66	0.76
8	其他各项资产	399,549.09	0.05
9	合计	766,618,722.32	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	618,302.00	0.11
B	采矿业	35,559,223.04	6.05
C	制造业	43,944,522.39	7.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,809,898.00	0.31
E	建筑业	1,402,128.00	0.24
F	批发和零售业	626,316.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	11,438,904.12	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	724,779.02	0.12
J	金融业	394,060.00	0.07
K	房地产业	16,692,908.95	2.84
L	租赁和商务服务业	184,926.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	223,560.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	448,625.21	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	114,068,152.73	19.39

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	600489	中金黄金	768,695	11,376,686.00	1.93
2	000975	山金国际	688,676	11,218,532.04	1.91
3	001979	招商蛇口	766,705	6,739,336.95	1.15
4	600048	保利发展	752,300	6,590,148.00	1.12
5	601899	紫金矿业	359,800	6,321,686.00	1.07
6	601600	中国铝业	583,900	4,455,157.00	0.76
7	600547	山东黄金	154,800	4,238,424.00	0.72
8	601872	招商轮船	429,610	3,630,204.50	0.62
9	000708	中信特钢	250,000	3,392,500.00	0.58
10	600026	中远海能	147,742	2,306,252.62	0.39
11	000932	华菱钢铁	469,340	2,079,176.20	0.35
12	600325	华发股份	285,800	1,857,700.00	0.32
13	000657	中钨高新	201,930	1,845,640.20	0.31
14	000598	兴蓉环境	236,000	1,774,720.00	0.30

15	300699	光威复材	66,320	1,646,725.60	0.28
16	000922	佳电股份	135,900	1,621,287.00	0.28
17	002318	久立特材	69,100	1,612,103.00	0.27
18	002244	滨江集团	207,400	1,505,724.00	0.26
19	002352	顺丰控股	41,200	1,470,428.00	0.25
20	600150	中国船舶	35,100	1,428,921.00	0.24
21	600970	中材国际	113,700	1,371,222.00	0.23
22	300750	宁德时代	7,000	1,260,210.00	0.21
23	000887	中鼎股份	100,300	1,227,672.00	0.21
24	002601	龙佰集团	62,200	1,155,054.00	0.20
25	601111	中国国航	143,000	1,055,340.00	0.18
26	601021	春秋航空	18,500	1,042,105.00	0.18
27	600961	株冶集团	109,100	1,029,904.00	0.18
28	002237	恒邦股份	87,400	1,005,974.00	0.17
29	002675	东诚药业	80,400	985,704.00	0.17
30	600612	老凤祥	16,700	971,773.00	0.17
31	002371	北方华创	3,000	959,670.00	0.16
32	601069	西部黄金	80,100	931,563.00	0.16
33	600029	南方航空	157,800	929,442.00	0.16
34	601038	一拖股份	50,200	793,662.00	0.13
35	603619	中曼石油	32,500	761,150.00	0.13
36	688628	优利德	21,959	719,596.43	0.12
37	600282	南钢股份	128,700	640,926.00	0.11
38	605599	莱百股份	49,200	626,316.00	0.11
39	300893	松原股份	21,800	622,826.00	0.11
40	601882	海天精工	26,800	613,988.00	0.10
41	000404	长虹华意	113,700	606,021.00	0.10
42	688305	科德数控	9,398	605,795.08	0.10
43	300661	圣邦股份	7,200	596,016.00	0.10
44	002299	圣农发展	42,600	581,064.00	0.10
45	000333	美的集团	6,900	445,050.00	0.08
46	688378	奥来德	18,765	440,226.90	0.07
47	002353	杰瑞股份	12,200	427,976.00	0.07
48	688188	柏楚电子	2,260	417,083.00	0.07
49	002738	中矿资源	15,400	412,720.00	0.07
50	300033	同花顺	3,800	394,060.00	0.07
51	001282	三联锻造	14,200	393,482.00	0.07
52	002345	潮宏基	83,100	392,232.00	0.07
53	601989	中国重工	79,500	391,935.00	0.07
54	300760	迈瑞医疗	1,300	378,183.00	0.06
55	002276	万马股份	52,700	377,859.00	0.06
56	688389	普门科技	23,205	377,313.30	0.06
57	603885	吉祥航空	34,000	373,660.00	0.06

58	605183	确成股份	23,700	366,402.00	0.06
59	601857	中国石油	35,100	362,232.00	0.06
60	600938	中国海油	10,300	339,900.00	0.06
61	000521	长虹美菱	44,800	339,584.00	0.06
62	600428	中远海特	54,900	335,988.00	0.06
63	300926	博俊科技	16,495	330,229.90	0.06
64	600801	华新水泥	22,200	305,250.00	0.05
65	300037	新宙邦	10,100	288,456.00	0.05
66	603197	保隆科技	9,100	286,650.00	0.05
67	688112	鼎阳科技	10,416	281,127.84	0.05
68	002025	航天电器	6,000	278,280.00	0.05
69	688111	金山办公	1,146	260,715.00	0.04
70	688543	国科军工	5,994	246,173.58	0.04
71	300769	德方纳米	8,700	245,340.00	0.04
72	688127	蓝特光学	12,905	237,322.95	0.04
73	600580	卧龙电驱	19,300	234,495.00	0.04
74	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.04
75	603162	海通发展	25,100	233,430.00	0.04
76	605111	新洁能	7,620	233,095.80	0.04
77	000738	航发控制	11,500	230,805.00	0.04
78	688377	迪威尔	17,444	228,516.40	0.04
79	000157	中联重科	29,400	225,792.00	0.04
80	300347	泰格医药	4,600	223,560.00	0.04
81	002415	海康威视	7,000	216,370.00	0.04
82	601827	三峰环境	24,500	208,005.00	0.04
83	600549	厦门钨业	11,800	203,550.00	0.03
84	600031	三一重工	12,000	198,000.00	0.03
85	600984	建设机械	77,700	184,926.00	0.03
86	688012	中微公司	1,256	177,422.56	0.03
87	002823	凯中精密	14,500	176,900.00	0.03
88	605123	派克新材	2,500	140,450.00	0.02
89	000519	中兵红箭	8,600	126,162.00	0.02
90	300122	智飞生物	4,300	120,529.00	0.02
91	300408	三环集团	4,100	119,679.00	0.02
92	002595	豪迈科技	3,100	118,327.00	0.02
93	002937	兴瑞科技	5,000	116,550.00	0.02
94	300034	钢研高纳	7,300	115,997.00	0.02
95	603136	天目湖	10,205	111,540.65	0.02
96	300021	大禹节水	33,500	110,550.00	0.02
97	603786	科博达	1,700	109,055.00	0.02
98	600276	恒瑞医药	2,700	103,842.00	0.02
99	600585	海螺水泥	4,300	101,437.00	0.02
100	002859	洁美科技	4,800	96,384.00	0.02

101	002903	宇环数控	5,500	96,085.00	0.02
102	000960	锡业股份	6,000	92,940.00	0.02
103	688398	赛特新材	5,045	88,691.10	0.02
104	300316	晶盛机电	2,900	83,317.00	0.01
105	300161	华中数控	3,600	80,964.00	0.01
106	603112	华翔股份	7,500	78,825.00	0.01
107	002179	中航光电	1,890	71,914.50	0.01
108	603757	大元泵业	3,600	68,760.00	0.01
109	688337	普源精电	2,705	68,220.10	0.01
110	688080	映翰通	2,208	66,968.64	0.01
111	603035	常熟汽饰	5,100	64,668.00	0.01
112	603565	中谷物流	7,100	62,054.00	0.01
113	301018	申菱环境	2,700	52,488.00	0.01
114	002130	沃尔核材	2,800	39,536.00	0.01
115	002458	益生股份	4,300	37,238.00	0.01
116	601985	中国核电	3,300	35,178.00	0.01
117	002081	金螳螂	10,200	30,906.00	0.01
118	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
119	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
120	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
121	002265	建设工业	2,300	19,849.00	0.00
122	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
123	601033	永兴股份	1,161	18,529.56	0.00
124	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
125	300092	科新机电	1,400	15,064.00	0.00
126	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
127	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
128	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
129	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
130	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
131	002155	湖南黄金	500	9,050.00	0.00
132	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
133	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
134	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
135	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
136	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
137	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
138	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
139	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
140	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
141	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
142	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
143	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00

144	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
145	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
146	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
147	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
148	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
149	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

注：自 2024 年 7 月 25 日起，证券代码为 000975 的证券简称由“银泰黄金”变更为“山金国际”。

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	000708	中信特钢	4,701,510.00	0.55
2	601899	紫金矿业	4,281,927.84	0.50
3	600489	中金黄金	4,168,063.00	0.49
4	000975	山金国际	4,147,846.44	0.49
5	600026	中远海能	3,368,273.38	0.40
6	001979	招商蛇口	2,917,160.60	0.34
7	000657	中钨高新	2,697,380.60	0.32
8	601872	招商轮船	2,614,613.00	0.31
9	002352	顺丰控股	2,518,656.00	0.30
10	601600	中国铝业	2,517,823.00	0.30
11	600029	南方航空	2,024,366.00	0.24
12	601111	中国国航	1,854,276.00	0.22
13	601021	春秋航空	1,783,415.00	0.21
14	600048	保利发展	1,647,642.00	0.19
15	000922	佳电股份	1,612,563.00	0.19
16	000932	华菱钢铁	1,508,276.00	0.18
17	002345	潮宏基	1,428,613.00	0.17
18	600961	株冶集团	1,341,193.98	0.16
19	002601	龙佰集团	1,317,391.00	0.16
20	600325	华发股份	1,202,961.00	0.14

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	600489	中金黄金	16,041,254.20	1.89
2	000975	山金国际	13,196,583.00	1.55
3	600547	山东黄金	7,428,062.40	0.87
4	000932	华菱钢铁	6,824,011.00	0.80

5	001979	招商蛇口	5,846,978.00	0.69
6	600938	中国海油	5,700,755.00	0.67
7	601985	中国核电	5,609,555.00	0.66
8	601899	紫金矿业	5,489,052.72	0.65
9	600048	保利发展	4,402,570.86	0.52
10	601872	招商轮船	4,326,025.52	0.51
11	601600	中国铝业	4,141,497.00	0.49
12	600282	南钢股份	4,090,588.00	0.48
13	002318	久立特材	3,353,255.47	0.39
14	600026	中远海能	3,010,559.00	0.35
15	601857	中国石油	2,992,285.00	0.35
16	000598	兴蓉环境	2,635,461.00	0.31
17	601038	一拖股份	2,291,021.00	0.27
18	002237	恒邦股份	2,012,750.00	0.24
19	300021	大禹节水	1,948,864.00	0.23
20	600325	华发股份	1,804,780.00	0.21

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	85,434,910.37
卖出股票收入（成交）总额	153,409,338.18

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	605,170,792.63	102.89
	其中：政策性金融债	427,153,800.02	72.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,144,367.21	7.00
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	646,315,159.84	109.89

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	09240202	24 国开清发 02	1,300,000	130,803,863.01	22.24
2	230413	23 农发 13	900,000	92,613,049.18	15.75
3	092303001	23 进出清发 01	800,000	81,776,307.69	13.90
4	240210	24 国开 10	600,000	60,516,328.77	10.29
5	2128036	21 平安银行二级	500,000	52,944,639.34	9.00

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	42,961.58
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	356,587.51

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	399,549.09

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 (%)
华泰柏瑞恒利混合 A	1,199	304,719.26	339,223,525.69	92.85	26,134,871.32	7.15
华泰柏瑞恒利混合 C	2,929	51,338.37	118,085,272.77	78.53	32,284,805.75	21.47
合计	4,045	127,497.77	457,308,798.46	88.67	58,419,677.07	11.33

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	华泰柏瑞恒利混合 A	1,096,330.27	0.3001
	华泰柏瑞恒利混合 C	0.00	0.0000
	合计	1,096,330.27	0.2126

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	华泰柏瑞恒利混合 A	0
	华泰柏瑞恒利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	华泰柏瑞恒利混合 A	>100
	华泰柏瑞恒利混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
基金合同生效日 (2021 年 9 月 14 日) 基金份额总额	170,011,448.81	70,012,500.09
本报告期期初基金份 额总额	612,826,842.12	163,956,907.38
本报告期基金总申购 份额	91,888,962.97	61,570,180.72
减：本报告期基金总 赎回份额	339,357,408.08	75,157,009.58
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	365,358,397.01	150,370,078.52

§ 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

基金管理人重大人事变动：

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 (%)	
国投证券	1	139,902,252.51	59.02	31,592.51	25.85	-
华泰证券	2	97,121,168.89	40.98	90,628.00	74.15	-

注：本报告期内：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

并能为基金提供全面的信息服务。

5) 具备研究实力, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专题研究报告。

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

3、本报告期内, 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 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 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	2024 年 02 月 24 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 21 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日

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	2024 年 02 月 01 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 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	20240101-20240312;	188,151,477.98	0.00	188,151,477.98	0.00	0.00
	2	20240313-20240313;	92,086,155.16	44,448,395.41	46,602,665.67	89,931,884.90	17.44

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

2024 年 8 月 31 日