

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资
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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国工商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，投资者在做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。

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 6 月 19 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 6 月 19 日开始计算。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	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	12
§ 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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56

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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合	
基金主代码	001244	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	212,194,756.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
下属分级基金的交易代码	001244	006104
报告期末下属分级基金的份额总额	157,568,675.91 份	54,626,080.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金投资策略如下：</p> <p>1、股票投资策略 本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>2、固定收益资产投资策略 本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>4、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>5、其他金融衍生工具投资策略</p>

	在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
业绩比较基准	95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
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 55 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 55 号
邮政编码		200135	100140
法定代表人		贾波	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
本期已实现收益	-10,377,230.37	-3,061,740.53

本期利润	-2,284,978.10	2,341,899.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0142	0.0492
本期加权平均净值利润率	-1.06%	3.51%
本期基金份额净值增长率	-1.54%	-1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	51,233,843.43	20,775,233.10
期末可供分配基金份额利润	0.3252	0.3803
期末基金资产净值	208,802,519.34	75,401,313.59
期末基金份额净值	1.3252	1.3803
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	54.33%	46.39%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金于 2018 年 6 月 19 日新增 C 类份额。

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

华泰柏瑞量化智慧混合 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	-3.69%	0.88%	-6.55%	0.91%	2.86%	-0.03%
过去三个月	-1.52%	0.97%	-6.16%	1.09%	4.64%	-0.12%
过去六个月	-1.54%	1.31%	-8.46%	1.53%	6.92%	-0.22%
过去一年	-9.25%	1.07%	-16.71%	1.21%	7.46%	-0.14%
过去三年	-10.57%	1.08%	-26.00%	1.14%	15.43%	-0.06%
自基金合同生效起 至今	54.33%	1.38%	-52.05%	1.50%	106.38%	-0.12%

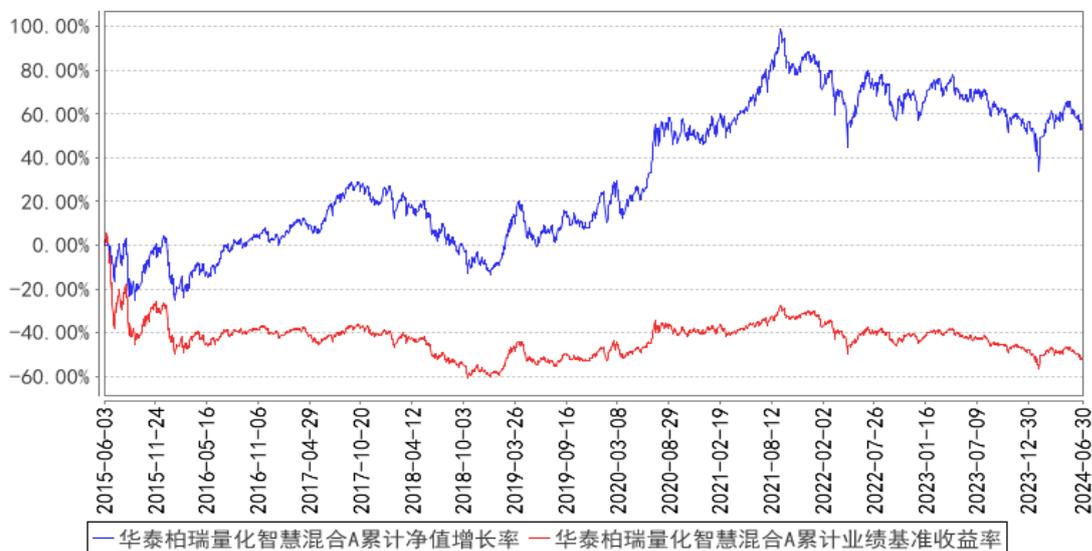
华泰柏瑞量化智慧混合 C

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	-3.72%	0.88%	-6.55%	0.91%	2.83%	-0.03%
过去三个月	-1.59%	0.97%	-6.16%	1.09%	4.57%	-0.12%
过去六个月	-1.66%	1.31%	-8.46%	1.53%	6.80%	-0.22%
过去一年	-9.48%	1.07%	-16.71%	1.21%	7.23%	-0.14%
过去三年	-11.24%	1.08%	-26.00%	1.14%	14.76%	-0.06%
自基金合同生效起 至今	46.39%	1.23%	-8.71%	1.29%	55.10%	-0.06%

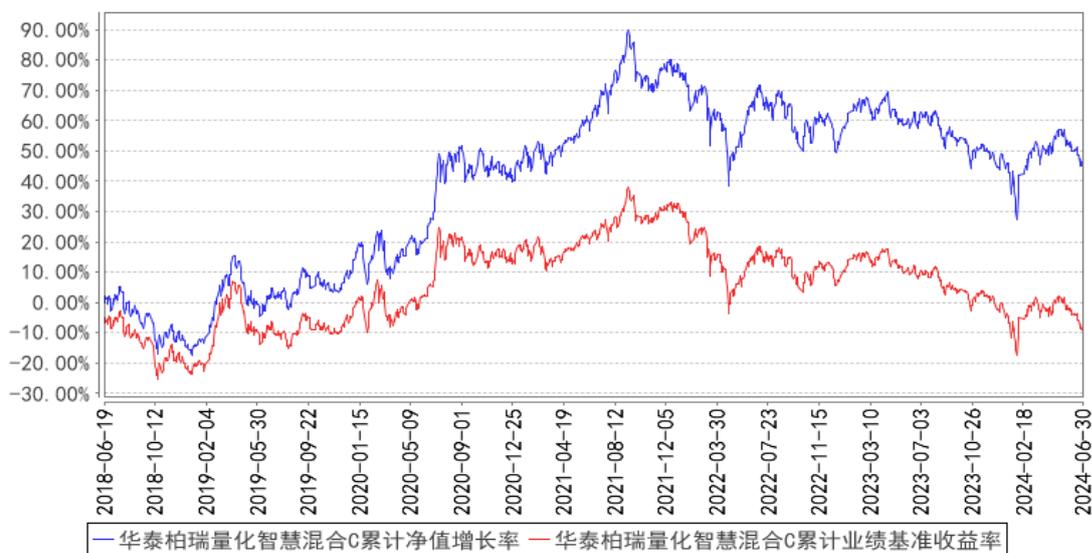
注：C 类份额业绩计算期间为 2018 年 6 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日。

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

华泰柏瑞量化智慧混合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



华泰柏瑞量化智慧混合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2015年6月3日至2024年6月30日。C类图示日期为2018年6月19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		
笪篁	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	-	10 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020 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。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。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和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。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 1000 指数增强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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2024 年上半年，A 股整体呈震荡走势，风格上分化较大。春节过后，市场从前期由短期资金流造成的剧烈波动中恢复，转而更加关注公司基本面。一方面，随着美国 OpenAI 公司和苹果公司在 AI 软件和硬件上的推陈出新，AI 算力的成长性打开向上空间。同时，伴随着海外产能和基础设施建设，供应链转移等因素，上游大宗商品和设备出口迎来涨价和业绩兑现。而另一方面，大部分中下游和内需相关产业链经历了业绩预期下修的过程。上半年，A 股市场中银行、能源、公用事业等高股息相关行业表现较强，同时以人工智能创新链、消费电子复苏链为代表的“科特估”主题先后成为市场热点。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别上涨 2.95% 和 0.89%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数上涨 11.03%；代表小市值公司的中证 1000 和中证 2000 指数同期涨跌幅分别为-16.84% 和 -23.28%。横向比较来看，大市值与高股息板块相对较强，中小市值下跌较多。

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。由于我们对上市公司财务质量和经营质量的把控较为系统和严谨，在投资全流程中的风控较为严格，因而在本轮小微盘急跌过程和上市公司退市风波中，超额收益几乎不受影响，超额收益波动较小。

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智慧混合 A 的基金份额净值为 1.3252 元,本报告期基金份额净值增长率为-1.54%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%,截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 C 的基金份额净值为 1.3803 元,本报告期基金份额净值增长率为-1.66%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度,中国经济的韧性仍然值得期待。上半年,出口数据显示出强劲的景气度,往后看短期或许会受到海外政治周期扰动,但我们预计许多企业的“出海”战略布局长期有望持续贡献增长。时隔十年,“国九条”再次发布,投资者可能更加重视公司基本面质量的定价,证券市场的定价有效性有望逐步提高。当前,A股市场许多股票已处于超跌状态,整体估值较低,等待投资人情绪的恢复。在不出现极端情况的前提下,我们对未来几个季度的A股股票市场持比较乐观的态度,对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面,我们看到市场正逐渐回归基本面逻辑。从因子表现来看,华泰柏瑞量化团队的质量因子近期表现较好,我们预期其趋势或仍将延续,而我们的成长因子可能会继续表现良好;同时,小微盘的风险得到释放之后,大小市值、各行业股票可能均有机会,量化投资全市场选股的优势可能将得以更好体现。

如上所述,我们认为,当前A股市场整体估值偏低,投资人交易行为更加注重基本面,我们认为专注于基本面的量化投资超额收益有望得到进一步提高,或是很不错的配置风格均衡的基本面量化基金的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,基金管理人严格执行基金估值控制流程,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人,基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：华泰柏瑞量化智慧灵活配置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	27,608,234.40	15,612,665.37
结算备付金		1,240,189.89	647,156.47
存出保证金		1,672,679.63	29,868.01
交易性金融资产	6.4.7.2	254,485,966.99	234,737,872.65
其中：股票投资		254,485,966.99	234,737,872.65
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		5,834.84	-
应收股利		-	-
应收申购款		104,224.72	161,017.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		285,117,130.47	251,188,579.71
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		282,059.47	176,509.05
应付管理人报酬		284,287.33	250,535.47
应付托管费		47,381.19	41,755.93
应付销售服务费		15,676.55	7,562.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	283,893.00	352,804.98
负债合计		913,297.54	829,168.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	212,194,756.40	184,882,780.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	72,009,076.53	65,476,630.86
净资产合计		284,203,832.93	250,359,411.38
负债和净资产总计		285,117,130.47	251,188,579.71

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 212,194,756.40 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.3252 元，基金份额总额 157,568,675.91 份；下属 C 类基金份额净值 1.3803 元，基金份额总额 54,626,080.49 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置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		2,217,366.35	23,135,131.58
1. 利息收入		114,028.64	58,116.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	114,028.64	58,116.51
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,422,976.06	2,149,275.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-16,294,837.70	-2,566,254.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	611,277.32	-124,860.21
股利收益	6.4.7.19	4,260,584.32	4,840,390.29
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	13,495,892.50	20,875,927.10
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	30,421.27	51,812.14
减：二、营业总支出		2,160,444.75	3,122,339.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,693,972.69	2,546,772.27
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	282,328.72	424,462.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	83,875.71	53,386.57
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		2,357.50	-

8. 其他费用	6.4.7.23	97,910.13	97,718.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56,921.60	20,012,792.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56,921.60	20,012,792.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		56,921.60	20,012,792.16

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置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	184,882,780.52	-	65,476,630.86	250,359,411.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	184,882,780.52	-	65,476,630.86	250,359,411.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,311,975.88	-	6,532,445.67	33,844,421.55
（一）、综合收益总额	-	-	56,921.60	56,921.60
（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）	27,311,975.88	-	6,475,524.07	33,787,499.95
其中：1. 基金申购款	70,177,850.57	-	22,756,783.62	92,934,634.19
2. 基金赎回款	-42,865,874.69	-	-16,281,259.55	-59,147,134.24
（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	212,194,756.40	-	72,009,076.53	284,203,832.93
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	236,594,275.68	-	90,779,511.65	327,373,787.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	236,594,275.68	-	90,779,511.65	327,373,787.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,206,265.87	-	22,333,348.19	26,539,614.06
（一）、综合收益总额	-	-	20,012,792.16	20,012,792.16
（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）	4,206,265.87	-	2,320,556.03	6,526,821.90
其中：1. 基金申购款	38,488,047.00	-	18,676,672.95	57,164,719.95
2. 基金赎回款	-34,281,781.13	-	-16,356,116.92	-50,637,898.05
（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	240,800,541.55	-	113,112,859.84	353,913,401.39
-----------	----------------	---	----------------	----------------

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

华泰柏瑞量化智慧灵活配置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”)证监基金字[2015]第 439 号《关于准予华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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 906,808,361.90 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 664 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 906,942,174.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 133,812.17 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,本基金自 2018 年 6 月 19 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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

的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0%-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：95% X 中证 500 指数收益率+5% X 银行活期存款利率(税后)。

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》、《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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[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。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。

(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	27,608,234.40
等于：本金	27,605,477.69
加：应计利息	2,756.71
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	27,608,234.40

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	252,697,005.74	-	254,485,966.99	1,788,961.25
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		252,697,005.74	-	254,485,966.99	1,788,961.25

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	14,495,880.00	-	-	
其中：股指期货投资	14,495,880.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	14,495,880.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	中证500股指期货2409	14.00	13,650,560.00	-845,320.00
合计				-845,320.00
减：可抵销期货暂收款				-845,320.00
净额				0.00

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	157.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	196,714.05
其中：交易所市场	196,714.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,021.48
合计	283,893.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化智慧混合 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	158,344,178.45	158,344,178.45
本期申购	20,425,277.37	20,425,277.37
本期赎回（以“-”号填列）	-21,200,779.91	-21,200,779.91
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	157,568,675.91	157,568,675.91

华泰柏瑞量化智慧混合 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	26,538,602.07	26,538,602.07
本期申购	49,752,573.20	49,752,573.20
本期赎回（以“-”号填列）	-21,665,094.78	-21,665,094.78
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	54,626,080.49	54,626,080.49

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

华泰柏瑞量化智慧混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,947,840.50	-27,182,616.22	54,765,224.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	81,947,840.50	-27,182,616.22	54,765,224.28
本期利润	-10,377,230.37	8,092,252.27	-2,284,978.10
本期基金份额交易产生的变动数	-318,336.32	-928,066.43	-1,246,402.75

其中：基金申购款	9,350,469.35	-3,299,663.39	6,050,805.96
基金赎回款	-9,668,805.67	2,371,596.96	-7,297,208.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71,252,273.81	-20,018,430.38	51,233,843.43

华泰柏瑞量化智慧混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,643,666.97	-1,932,260.39	10,711,406.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,643,666.97	-1,932,260.39	10,711,406.58
本期利润	-3,061,740.53	5,403,640.23	2,341,899.70
本期基金份额交易产生的变动数	12,627,529.95	-4,905,603.13	7,721,926.82
其中：基金申购款	21,300,299.01	-4,594,321.35	16,705,977.66
基金赎回款	-8,672,769.06	-311,281.78	-8,984,050.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,209,456.39	-1,434,223.29	20,775,233.10

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	40,572.01
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	73,156.48
其他	300.15
合计	114,028.64

注：其他为结算保证金利息收入、直销申购款利息收入和期货备付金利息收入。

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
	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	-16,294,837.70
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	-16,294,837.70

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	224,101,662.95
减：卖出股票成本总额	239,814,057.72
减：交易费用	582,442.93
买卖股票差价收入	-16,294,837.70

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	611,277.32

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	4,260,584.32
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	4,260,584.32

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	14,341,212.50
股票投资	14,341,212.50
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	-845,320.00
权证投资	-
期货投资	-845,320.00
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	13,495,892.50

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	30,300.02
基金转换费收入	121.25
合计	30,421.27

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	9,000.00
银行划款手续费	1,888.65
合计	97,910.13

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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”）	基金管理人的股东的子公司

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	59,644,240.07	12.75	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

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	56,105.52	12.74	56,105.52	28.52
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 (%)
-	-	-	-	-

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,693,972.69	2,546,772.27
其中：应支付销售机构的客户维护 费	492,243.99	669,439.98
应支付基金管理人的净管理费	1,201,728.70	1,877,332.29

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 25 日，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 26 日起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	282,328.72	424,462.08

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 25 日，支付基金托管人中国工商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：

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

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 26 日起，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	28.30	28.30
华泰证券股份有限公司	0.00	11.08	11.08
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	44,566.59	44,566.59
合计	0.00	44,605.97	44,605.97
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		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	35,679.32	35,679.32
合计	0.00	35,679.32	35,679.32

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 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 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

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日（2015年6月3日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,820,001.53	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	3,820,001.53	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.8002%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日（2015年6月3日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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 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
中国工商银行	27,608,234.40	40,572.01	31,442,935.98	40,318.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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
华泰联合证券有限责任公司	688709	成都华微	网下申购	4,527	71,028.63
华泰联合证券有限责任公司	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券有限责任公司	603341	龙旗科技	网下申购	1,506	39,156.00
华泰联合证券有限责任公司	603312	西典新能	网下申购	907	26,321.14
华泰联合证券有限责任公司	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
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
华泰联合证券有限责任公司	301408.SZ	华人健康	网下申购	7,705	125,129.20
华泰联合证券有限责任公司	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券有限责任公司	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券有限责任公司	603137.SH	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券有限责任公司	688478.SH	晶升股份	网下申购	3,330	108,291.60
华泰联合证券有限责任公司	688469.SH	中芯集成	网下申购	36,430	207,286.70
华泰联合证券有限责任公司	688512.SH	慧智微	网下申购	5,082	106,315.44
华泰联合证券有限责任公司	688472.SH	阿特斯	网下申购	12,242	135,886.20
华泰联合证券有限责任公司	300804.SZ	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券有限责任公司	688429.SH	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券有限责任公司	601916.SH	浙商银行	网上配股	120,240	242,884.80

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	186	3,158.28	2,507.28	-
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	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定期内	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
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	150	5,972.74	13,686.00	-
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	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定期内	11.88	18.98	668	7,935.84	12,678.64	-
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	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定期内	44.95	65.93	186	8,360.70	12,262.98	-
301587	中瑞	2024年3月	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

	股份	27 日		期内						
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	-
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	341	5,524.20	5,442.36	-
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	91	2,640.82	2,307.76	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股 锁定期内	72.46	68.06	40	2,898.40	2,722.40	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股 锁定期内	26.00	37.49	151	3,926.00	5,660.99	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股 锁定期内	19.18	22.66	176	3,375.68	3,988.16	-
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	69	2,634.42	2,684.10	-
603381	永	2024	6 个月	新股	23.35	25.13	127	2,965.45	3,191.51	-

	臻股份	年6月19日		锁定期内						
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	363	8,225.58	5,768.07	-
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	105	9,130.80	18,367.65	-
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	453	7,107.57	8,511.87	-

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

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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、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工商银行，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，本基金无债券投资 (2023 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 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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	27,608,234.40	-	-	-	-	-	27,608,234.40
结算备付金	1,240,189.89	-	-	-	-	-	1,240,189.89
存出保证金	1,672,679.63	-	-	-	-	-	1,672,679.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	254,485,966.99	254,485,966.99
应收申购款	-	-	-	-	-	104,224.72	104,224.72
应收清算款	-	-	-	-	-	5,834.84	5,834.84
资产总计	30,521,103.92	-	-	-	-	254,596,026.55	285,117,130.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	282,059.47	282,059.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	284,287.33	284,287.33
应付托管费	-	-	-	-	-	47,381.19	47,381.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,676.55	15,676.55
其他负债	-	-	-	-	-	283,893.00	283,893.00
负债总计	-	-	-	-	-	913,297.54	913,297.54
利率敏感度缺口	30,521,103.92	-	-	-	-	-253,682,729.01	284,203,832.93
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	15,612,665.37	-	-	-	-	-	15,612,665.37
结算备付金	647,156.47	-	-	-	-	-	647,156.47
存出保证金	29,868.01	-	-	-	-	-	29,868.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	234,737,872.65	234,737,872.65
应收申购款	-	-	-	-	-	161,017.21	161,017.21
资产总计	16,289,689.85	-	-	-	-	234,898,889.86	251,188,579.71
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	176,509.05	176,509.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	250,535.47	250,535.47
应付托管费	-	-	-	-	-	41,755.93	41,755.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,562.90	7,562.90
其他负债	-	-	-	-	-	352,804.98	352,804.98
负债总计	-	-	-	-	-	829,168.33	829,168.33
利率敏感度缺口	16,289,689.85	-	-	-	-	-234,069,721.53	250,359,411.38

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 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(2023 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 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	254,485,966.99	89.54	234,737,872.65	93.76
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	254,485,966.99	89.54	234,737,872.65	93.76

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	中证 500 指数上升 5%	12,342,567.16	11,682,513.13
中证 500 指数下降 5%	-12,342,567.16	-11,682,513.13	

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	254,233,327.92	233,880,444.70
第二层次	45,611.11	-
第三层次	207,027.96	857,427.95
合计	254,485,966.99	234,737,872.65

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 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	254,485,966.99	89.26
	其中：股票	254,485,966.99	89.26
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	28,848,424.29	10.12
8	其他各项资产	1,782,739.19	0.63
9	合计	285,117,130.47	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	989,110.00	0.35
B	采矿业	18,985,002.00	6.68

C	制造业	159,357,330.34	56.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,543,159.80	2.30
E	建筑业	5,579,976.12	1.96
F	批发和零售业	3,959,706.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	5,275,555.21	1.86
H	住宿和餐饮业	132,145.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,819,939.52	4.51
J	金融业	25,481,186.10	8.97
K	房地产业	942,846.00	0.33
L	租赁和商务服务业	5,659,059.00	1.99
M	科学研究和技术服务业	1,682,264.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	2,299,636.90	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,619,560.00	0.57
Q	卫生和社会工作	364,392.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	2,795,099.00	0.98
S	综合	-	-
	合计	254,485,966.99	89.54

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	601233	桐昆股份	169,200	2,700,432.00	0.95
2	600066	宇通客车	104,100	2,685,780.00	0.95
3	002600	领益智造	368,100	2,620,872.00	0.92
4	002384	东山精密	117,000	2,421,900.00	0.85
5	600489	中金黄金	162,300	2,402,040.00	0.85
6	601001	晋控煤业	143,400	2,368,968.00	0.83
7	601577	长沙银行	258,700	2,116,166.00	0.74
8	601108	财通证券	298,600	1,973,746.00	0.69
9	000932	华菱钢铁	444,466	1,968,984.38	0.69
10	688169	石头科技	5,000	1,963,000.00	0.69
11	600312	平高电气	100,800	1,960,560.00	0.69
12	603338	浙江鼎力	32,300	1,951,566.00	0.69
13	688798	艾为电子	34,300	1,942,066.00	0.68
14	600642	申能股份	218,200	1,926,706.00	0.68
15	300866	安克创新	26,910	1,916,261.10	0.67
16	601717	郑煤机	128,900	1,907,720.00	0.67

17	688408	中信博	20,600	1,896,848.00	0.67
18	300529	健帆生物	69,700	1,896,537.00	0.67
19	000933	神火股份	92,900	1,879,367.00	0.66
20	600737	中粮糖业	193,100	1,851,829.00	0.65
21	000728	国元证券	299,800	1,816,788.00	0.64
22	601211	国泰君安	133,200	1,804,860.00	0.64
23	600901	江苏租赁	356,240	1,799,012.00	0.63
24	603568	伟明环保	81,800	1,683,444.00	0.59
25	002128	电投能源	79,400	1,675,340.00	0.59
26	002517	恺英网络	173,800	1,659,790.00	0.58
27	002152	广电运通	158,000	1,652,680.00	0.58
28	000630	铜陵有色	454,200	1,639,662.00	0.58
29	601598	中国外运	290,967	1,638,144.21	0.58
30	605098	行动教育	38,000	1,619,560.00	0.57
31	688188	柏楚电子	8,720	1,609,276.00	0.57
32	002532	天山铝业	196,500	1,593,615.00	0.56
33	601668	中国建筑	298,100	1,582,911.00	0.56
34	600755	厦门国贸	219,900	1,576,683.00	0.55
35	002736	国信证券	180,500	1,568,545.00	0.55
36	688036	传音控股	20,160	1,543,046.40	0.54
37	601156	东航物流	74,300	1,512,005.00	0.53
38	002465	海格通信	145,200	1,504,272.00	0.53
39	688608	恒玄科技	10,200	1,493,076.00	0.53
40	300207	欣旺达	98,100	1,488,177.00	0.52
41	603368	柳药集团	83,600	1,463,000.00	0.51
42	002947	恒铭达	41,500	1,460,800.00	0.51
43	688253	英诺特	37,900	1,444,369.00	0.51
44	600153	建发股份	160,700	1,435,051.00	0.50
45	600582	天地科技	207,600	1,430,364.00	0.50
46	000915	华特达因	47,100	1,420,536.00	0.50
47	000426	兴业银锡	104,100	1,413,678.00	0.50
48	000997	新大陆	100,600	1,399,346.00	0.49
49	688016	心脉医疗	14,250	1,397,212.50	0.49
50	002756	永兴材料	38,930	1,392,915.40	0.49
51	300308	中际旭创	10,080	1,389,830.40	0.49
52	002025	航天电器	29,800	1,382,124.00	0.49
53	601390	中国中铁	211,906	1,381,627.12	0.49
54	600566	济川药业	42,300	1,341,333.00	0.47
55	600988	赤峰黄金	80,800	1,320,272.00	0.46
56	300428	立中集团	70,400	1,308,736.00	0.46
57	688766	普冉股份	13,440	1,305,964.80	0.46
58	688578	艾力斯	20,107	1,281,620.18	0.45
59	603893	瑞芯微	21,500	1,272,155.00	0.45

60	601665	齐鲁银行	259,000	1,271,690.00	0.45
61	600057	厦门象屿	187,000	1,271,600.00	0.45
62	600765	中航重机	62,100	1,266,840.00	0.45
63	300251	光线传媒	150,000	1,261,500.00	0.44
64	688276	百克生物	44,200	1,253,954.00	0.44
65	688208	道通科技	51,757	1,249,413.98	0.44
66	688278	特宝生物	23,172	1,240,860.60	0.44
67	600160	巨化股份	50,400	1,216,152.00	0.43
68	603300	华铁应急	221,000	1,206,660.00	0.42
69	000568	泸州老窖	8,300	1,190,967.00	0.42
70	603267	鸿远电子	34,500	1,176,450.00	0.41
71	300009	安科生物	137,200	1,171,688.00	0.41
72	605333	沪光股份	41,800	1,164,130.00	0.41
73	002557	洽洽食品	40,800	1,150,152.00	0.40
74	601881	中国银河	104,900	1,139,214.00	0.40
75	600346	恒力石化	81,500	1,136,925.00	0.40
76	000951	中国重汽	77,800	1,114,096.00	0.39
77	601137	博威合金	73,000	1,112,520.00	0.39
78	600968	海油发展	269,000	1,108,280.00	0.39
79	600985	淮北矿业	65,500	1,096,470.00	0.39
80	603699	纽威股份	64,000	1,095,680.00	0.39
81	300144	宋城演艺	135,500	1,088,065.00	0.38
82	002991	甘源食品	17,900	1,085,635.00	0.38
83	603605	珀莱雅	9,700	1,076,603.00	0.38
84	300395	菲利华	34,900	1,073,175.00	0.38
85	688006	杭可科技	60,667	1,058,639.15	0.37
86	688486	龙迅股份	18,412	1,055,007.60	0.37
87	600019	宝钢股份	158,000	1,050,700.00	0.37
88	000581	威孚高科	64,100	1,043,548.00	0.37
89	603225	新凤鸣	66,900	1,042,971.00	0.37
90	600299	安迪苏	107,200	1,039,840.00	0.37
91	000423	东阿阿胶	16,600	1,039,160.00	0.37
92	000830	鲁西化工	89,300	1,034,987.00	0.36
93	000923	河钢资源	59,500	1,024,590.00	0.36
94	300783	三只松鼠	46,800	1,023,516.00	0.36
95	600926	杭州银行	78,000	1,017,900.00	0.36
96	600557	康缘药业	64,700	1,015,790.00	0.36
97	601186	中国铁建	118,100	1,012,117.00	0.36
98	601318	中国平安	24,400	1,009,184.00	0.36
99	000878	云南铜业	80,000	996,800.00	0.35
100	300628	亿联网络	27,100	996,467.00	0.35
101	002422	科伦药业	32,700	991,791.00	0.35
102	688123	聚辰股份	16,000	973,280.00	0.34

103	600999	招商证券	69,900	972,309.00	0.34
104	601666	平煤股份	86,100	964,320.00	0.34
105	002371	北方华创	3,000	959,670.00	0.34
106	000786	北新建材	31,600	937,256.00	0.33
107	000703	恒逸石化	131,500	932,335.00	0.33
108	300433	蓝思科技	50,900	928,925.00	0.33
109	002008	大族激光	44,200	919,360.00	0.32
110	000400	许继电气	26,700	918,747.00	0.32
111	002648	卫星化学	50,600	909,788.00	0.32
112	002203	海亮股份	114,000	909,720.00	0.32
113	002558	巨人网络	94,800	894,912.00	0.31
114	300115	长盈精密	74,500	893,255.00	0.31
115	300274	阳光电源	14,140	877,104.20	0.31
116	002478	常宝股份	175,843	875,698.14	0.31
117	601555	东吴证券	147,600	870,840.00	0.31
118	601567	三星医疗	24,800	868,000.00	0.31
119	300926	博俊科技	42,920	859,258.40	0.30
120	603317	天味食品	74,760	853,011.60	0.30
121	002429	兆驰股份	176,700	849,927.00	0.30
122	600483	福能股份	72,630	846,865.80	0.30
123	600096	云天化	43,600	846,712.00	0.30
124	300773	拉卡拉	68,000	845,240.00	0.30
125	002468	申通快递	100,000	840,000.00	0.30
126	300001	特锐德	40,400	812,848.00	0.29
127	688082	盛美上海	9,611	812,225.61	0.29
128	600141	兴发集团	42,400	808,992.00	0.28
129	600718	东软集团	97,000	802,190.00	0.28
130	002563	森马服饰	137,900	801,199.00	0.28
131	688248	南网科技	27,000	800,010.00	0.28
132	601336	新华保险	26,500	795,795.00	0.28
133	600362	江西铜业	33,500	793,280.00	0.28
134	002948	青岛银行	235,200	792,624.00	0.28
135	601838	成都银行	51,900	788,361.00	0.28
136	000651	格力电器	20,100	788,322.00	0.28
137	603507	振江股份	24,000	787,680.00	0.28
138	601169	北京银行	133,700	780,808.00	0.27
139	000975	山金国际	47,800	778,662.00	0.27
140	603323	苏农银行	161,700	777,777.00	0.27
141	300724	捷佳伟创	14,200	766,942.00	0.27
142	688233	神工股份	39,400	759,238.00	0.27
143	003012	东鹏控股	123,600	755,196.00	0.27
144	688281	华秦科技	9,000	749,880.00	0.26
145	000998	隆平高科	76,200	749,046.00	0.26

146	600030	中信证券	40,770	743,237.10	0.26
147	688105	诺唯赞	36,000	720,360.00	0.25
148	600521	华海药业	42,100	717,805.00	0.25
149	688153	唯捷创芯	18,907	699,559.00	0.25
150	601636	旗滨集团	107,683	694,555.35	0.24
151	002409	雅克科技	11,000	692,010.00	0.24
152	600875	东方电气	37,200	686,340.00	0.24
153	688213	思特威	14,000	679,000.00	0.24
154	688234	天岳先进	14,400	675,648.00	0.24
155	002906	华阳集团	25,100	671,676.00	0.24
156	000690	宝新能源	130,000	663,000.00	0.23
157	000672	上峰水泥	107,677	658,983.24	0.23
158	300285	国瓷材料	36,800	656,880.00	0.23
159	300002	神州泰岳	80,400	652,848.00	0.23
160	300857	协创数据	11,400	649,800.00	0.23
161	000598	兴蓉环境	85,600	643,712.00	0.23
162	002895	川恒股份	35,000	640,850.00	0.23
163	600529	山东药玻	25,100	636,034.00	0.22
164	000738	航发控制	31,500	632,205.00	0.22
165	603727	博迈科	47,900	630,364.00	0.22
166	002594	比亚迪	2,500	625,625.00	0.22
167	002608	江苏国信	80,700	625,425.00	0.22
168	300502	新易盛	5,900	622,745.00	0.22
169	600528	中铁工业	84,720	620,150.40	0.22
170	688520	神州细胞	15,681	617,047.35	0.22
171	000858	五粮液	4,600	588,984.00	0.21
172	301207	华兰疫苗	33,100	584,877.00	0.21
173	601077	渝农商行	116,400	584,328.00	0.21
174	002273	水晶光电	34,200	580,716.00	0.20
175	600109	国金证券	76,900	580,595.00	0.20
176	002469	三维化学	101,300	577,410.00	0.20
177	600583	海油工程	97,200	574,452.00	0.20
178	600027	华电国际	82,700	573,938.00	0.20
179	688599	天合光能	33,375	564,705.00	0.20
180	688187	时代电气	11,346	560,265.48	0.20
181	601319	中国人保	108,500	558,775.00	0.20
182	002993	奥海科技	15,000	558,000.00	0.20
183	603995	甬金股份	31,800	557,136.00	0.20
184	605166	聚合顺	52,500	550,725.00	0.19
185	601127	赛力斯	6,000	546,720.00	0.19
186	601958	金钼股份	52,500	546,525.00	0.19
187	000778	新兴铸管	157,000	546,360.00	0.19
188	688506	百利天恒	3,000	544,200.00	0.19

189	603348	文灿股份	19,600	542,724.00	0.19
190	603518	锦泓集团	61,400	540,320.00	0.19
191	002683	广东宏大	26,600	535,458.00	0.19
192	600502	安徽建工	121,900	524,170.00	0.18
193	001914	招商积余	52,000	521,040.00	0.18
194	002064	华峰化学	72,200	517,674.00	0.18
195	688518	联赢激光	30,600	511,020.00	0.18
196	688389	普门科技	31,400	510,564.00	0.18
197	000636	风华高科	39,000	509,340.00	0.18
198	601916	浙商银行	184,400	508,944.00	0.18
199	603678	火炬电子	20,500	506,145.00	0.18
200	601991	大唐发电	167,800	505,078.00	0.18
201	001872	招商港口	26,100	502,425.00	0.18
202	300389	艾比森	40,900	502,252.00	0.18
203	600409	三友化工	99,200	497,984.00	0.18
204	600050	中国联通	103,200	485,040.00	0.17
205	300457	赢合科技	26,600	474,278.00	0.17
206	601168	西部矿业	26,400	473,880.00	0.17
207	300769	德方纳米	16,700	470,940.00	0.17
208	300638	广和通	27,500	470,250.00	0.17
209	002237	恒邦股份	40,700	468,457.00	0.16
210	002185	华天科技	55,800	454,770.00	0.16
211	601898	中煤能源	36,400	454,272.00	0.16
212	002155	湖南黄金	24,700	447,070.00	0.16
213	601886	江河集团	89,600	437,248.00	0.15
214	002612	朗姿股份	31,500	435,330.00	0.15
215	603160	汇顶科技	6,300	433,125.00	0.15
216	603612	索通发展	33,900	432,564.00	0.15
217	002637	赞宇科技	51,100	432,306.00	0.15
218	002244	滨江集团	58,100	421,806.00	0.15
219	600219	南山铝业	110,000	419,100.00	0.15
220	301061	匠心家居	8,710	409,021.60	0.14
221	002120	韵达股份	52,800	408,672.00	0.14
222	300559	佳发教育	42,700	408,639.00	0.14
223	002179	中航光电	10,600	403,330.00	0.14
224	002158	汉钟精机	24,100	402,952.00	0.14
225	300573	兴齐眼药	2,380	390,320.00	0.14
226	688480	赛恩斯	13,764	383,465.04	0.13
227	301301	川宁生物	30,000	383,400.00	0.13
228	000513	丽珠集团	10,000	372,100.00	0.13
229	688525	佰维存储	5,800	372,070.00	0.13
230	002035	华帝股份	59,700	371,931.00	0.13
231	605123	派克新材	6,600	370,788.00	0.13

232	002463	沪电股份	10,000	365,000.00	0.13
233	002044	美年健康	96,400	364,392.00	0.13
234	601615	明阳智能	38,600	364,384.00	0.13
235	688332	中科蓝讯	6,100	359,839.00	0.13
236	600535	天士力	28,200	354,756.00	0.12
237	300595	欧普康视	22,400	351,232.00	0.12
238	300034	钢研高纳	22,100	351,169.00	0.12
239	300679	电连技术	8,600	345,978.00	0.12
240	688239	航宇科技	9,877	343,719.60	0.12
241	600820	隧道股份	52,300	341,519.00	0.12
242	301308	江波龙	3,600	341,064.00	0.12
243	300383	光环新网	40,000	338,000.00	0.12
244	603228	景旺电子	10,400	330,720.00	0.12
245	600000	浦发银行	40,100	330,023.00	0.12
246	000950	重药控股	67,500	328,725.00	0.12
247	300181	佐力药业	21,300	322,056.00	0.11
248	002068	黑猫股份	44,800	318,080.00	0.11
249	600348	华阳股份	31,100	309,756.00	0.11
250	300253	卫宁健康	52,400	309,160.00	0.11
251	300562	乐心医疗	34,600	308,286.00	0.11
252	601369	陕鼓动力	37,700	302,354.00	0.11
253	601800	中国交建	33,600	300,384.00	0.11
254	600859	王府井	25,100	294,674.00	0.10
255	000983	山西焦煤	27,700	285,587.00	0.10
256	002020	京新药业	27,000	282,690.00	0.10
257	000550	江铃汽车	13,000	282,230.00	0.10
258	300973	立高食品	10,000	280,900.00	0.10
259	688143	长盈通	13,000	278,460.00	0.10
260	002315	焦点科技	10,000	269,600.00	0.09
261	600861	北京人力	16,400	267,648.00	0.09
262	600567	山鹰国际	170,600	255,900.00	0.09
263	600499	科达制造	30,000	252,900.00	0.09
264	688778	厦钨新能	8,000	249,920.00	0.09
265	603233	大参林	17,220	246,246.00	0.09
266	688236	春立医疗	17,250	244,605.00	0.09
267	603056	德邦股份	18,600	243,660.00	0.09
268	601139	深圳燃气	36,300	242,484.00	0.09
269	600862	中航高科	12,800	240,384.00	0.08
270	002299	圣农发展	17,600	240,064.00	0.08
271	688111	金山办公	1,028	233,870.00	0.08
272	688088	虹软科技	8,100	233,766.00	0.08
273	600167	联美控股	44,700	232,887.00	0.08
274	002850	科达利	3,000	229,140.00	0.08

275	601601	中国太保	8,200	228,452.00	0.08
276	001308	康冠科技	10,000	225,000.00	0.08
277	002236	大华股份	14,400	222,624.00	0.08
278	002847	盐津铺子	5,180	221,548.60	0.08
279	002373	千方科技	24,300	220,401.00	0.08
280	002961	瑞达期货	20,100	220,095.00	0.08
281	000887	中鼎股份	17,900	219,096.00	0.08
282	000338	潍柴动力	12,900	209,496.00	0.07
283	300487	蓝晓科技	4,900	204,624.00	0.07
284	301260	格力博	14,000	190,680.00	0.07
285	600497	驰宏锌锗	35,700	190,638.00	0.07
286	688120	华海清科	1,000	189,580.00	0.07
287	002056	横店东磁	15,000	187,050.00	0.07
288	603345	安井食品	2,500	185,775.00	0.07
289	603093	南华期货	21,100	182,726.00	0.06
290	600398	海澜之家	19,200	177,408.00	0.06
291	002283	天润工业	40,900	175,461.00	0.06
292	002978	安宁股份	6,100	169,946.00	0.06
293	688012	中微公司	1,200	169,512.00	0.06
294	603517	绝味食品	10,800	166,320.00	0.06
295	688551	科威尔	5,200	163,800.00	0.06
296	301109	军信股份	10,950	163,702.50	0.06
297	603127	昭衍新药	12,200	161,894.00	0.06
298	300119	瑞普生物	11,800	160,716.00	0.06
299	688772	珠海冠宇	10,766	160,413.40	0.06
300	600977	中国电影	14,900	160,324.00	0.06
301	300037	新宙邦	5,600	159,936.00	0.06
302	601677	明泰铝业	13,700	158,372.00	0.06
303	000883	湖北能源	26,300	158,063.00	0.06
304	002727	一心堂	10,400	156,936.00	0.06
305	688029	南微医学	2,500	153,900.00	0.05
306	002624	完美世界	20,200	153,520.00	0.05
307	600373	中文传媒	9,900	146,916.00	0.05
308	601019	山东出版	11,700	138,294.00	0.05
309	603899	晨光股份	4,400	137,632.00	0.05
310	300394	天孚通信	1,540	136,166.80	0.05
311	688252	天德钰	9,100	132,223.00	0.05
312	600258	首旅酒店	10,700	132,145.00	0.05
313	600909	华安证券	30,000	126,300.00	0.04
314	600956	新天绿能	15,300	125,001.00	0.04
315	688516	奥特维	2,909	121,625.29	0.04
316	601919	中远海控	7,700	119,273.00	0.04
317	605007	五洲特纸	9,400	118,722.00	0.04

318	605338	巴比食品	8,900	117,925.00	0.04
319	688536	思瑞浦	1,200	117,372.00	0.04
320	603303	得邦照明	10,000	114,800.00	0.04
321	000001	平安银行	10,600	107,590.00	0.04
322	300130	新国都	6,400	106,496.00	0.04
323	605555	德昌股份	5,600	104,216.00	0.04
324	600971	恒源煤电	8,600	102,684.00	0.04
325	600938	中国海油	3,000	99,000.00	0.03
326	301015	百洋医药	4,100	96,473.00	0.03
327	002555	三七互娱	7,300	95,265.00	0.03
328	601888	中国中免	1,500	93,735.00	0.03
329	600967	内蒙一机	12,700	91,440.00	0.03
330	002351	漫步者	6,800	89,420.00	0.03
331	603439	贵州三力	6,900	88,044.00	0.03
332	002153	石基信息	15,000	85,950.00	0.03
333	002706	良信股份	12,300	84,378.00	0.03
334	601607	上海医药	4,200	80,262.00	0.03
335	002212	天融信	16,100	78,407.00	0.03
336	000785	居然之家	31,000	75,330.00	0.03
337	600282	南钢股份	14,900	74,202.00	0.03
338	002392	北京利尔	20,500	64,575.00	0.02
339	688002	睿创微纳	2,300	64,331.00	0.02
340	600475	华光环能	7,300	63,583.00	0.02
341	002340	格林美	9,400	59,878.00	0.02
342	002946	新乳业	6,700	58,692.00	0.02
343	603876	鼎胜新材	6,200	57,474.00	0.02
344	601633	长城汽车	1,900	48,070.00	0.02
345	002550	千红制药	8,800	47,432.00	0.02
346	300122	智飞生物	1,600	44,848.00	0.02
347	000683	远兴能源	6,400	44,224.00	0.02
348	000967	盈峰环境	10,300	43,569.00	0.02
349	605589	圣泉集团	2,000	40,580.00	0.01
350	002572	索菲亚	2,600	39,858.00	0.01
351	002690	美亚光电	2,200	36,300.00	0.01
352	600352	浙江龙盛	3,400	29,206.00	0.01
353	300682	朗新集团	3,100	26,381.00	0.01
354	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
355	300870	欧陆通	500	21,690.00	0.01
356	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
357	300693	盛弘股份	990	20,730.60	0.01
358	688692	达梦数据	105	18,367.65	0.01
359	603688	石英股份	600	17,766.00	0.01
360	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.01

361	600563	法拉电子	200	15,236.00	0.01
362	603609	禾丰股份	2,100	13,734.00	0.00
363	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
364	000776	广发证券	1,100	13,387.00	0.00
365	603993	洛阳钼业	1,500	12,750.00	0.00
366	301565	中仑新材	668	12,678.64	0.00
367	301580	爱迪特	186	12,262.98	0.00
368	002925	盈趣科技	900	11,403.00	0.00
369	600004	白云机场	1,200	11,376.00	0.00
370	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
371	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
372	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
373	688709	成都华微	453	8,511.87	0.00
374	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
375	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
376	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
377	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
378	603866	桃李面包	1,400	7,098.00	0.00
379	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
380	688584	上海合晶	363	5,768.07	0.00
381	603341	龙旗科技	151	5,660.99	0.00
382	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
383	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
384	601033	永兴股份	341	5,442.36	0.00
385	300747	锐科激光	300	5,325.00	0.00
386	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
387	002746	仙坛股份	900	5,157.00	0.00
388	603344	星德胜	176	3,988.16	0.00
389	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
390	603381	永臻股份	127	3,191.51	0.00
391	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
392	603325	博隆技术	40	2,722.40	0.00
393	603375	盛景微	69	2,684.10	0.00
394	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
395	001379	腾达科技	186	2,507.28	0.00
396	300068	南都电源	300	2,484.00	0.00
397	603312	西典新能	91	2,307.76	0.00
398	002803	吉宏股份	200	2,226.00	0.00
399	600927	永安期货	100	1,115.00	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	002384	东山精密	2,554,815.00	1.02
2	688798	艾为电子	1,985,235.02	0.79
3	000987	越秀资本	1,934,454.00	0.77
4	002517	恺英网络	1,922,037.00	0.77
5	002152	广电运通	1,904,094.00	0.76
6	601108	财通证券	1,857,083.00	0.74
7	002465	海格通信	1,833,419.00	0.73
8	688276	百克生物	1,801,992.17	0.72
9	600153	建发股份	1,780,017.39	0.71
10	601598	中国外运	1,754,891.99	0.70
11	603678	火炬电子	1,691,786.00	0.68
12	002128	电投能源	1,682,959.00	0.67
13	000426	兴业银锡	1,652,921.00	0.66
14	600348	华阳股份	1,632,516.00	0.65
15	601555	东吴证券	1,613,741.00	0.64
16	000690	宝新能源	1,607,377.00	0.64
17	600918	中泰证券	1,566,832.00	0.63
18	300841	康华生物	1,562,814.00	0.62
19	601636	旗滨集团	1,554,652.76	0.62
20	603338	浙江鼎力	1,491,967.00	0.60

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	000521	长虹美菱	2,392,534.91	0.96
2	600482	中国动力	1,952,441.00	0.78
3	002990	盛视科技	1,943,359.00	0.78
4	000987	越秀资本	1,835,422.30	0.73
5	600918	中泰证券	1,819,920.00	0.73
6	601699	潞安环能	1,710,698.00	0.68
7	688439	振华风光	1,704,604.38	0.68
8	603688	石英股份	1,606,091.00	0.64
9	301153	中科江南	1,588,907.34	0.63
10	002027	分众传媒	1,502,580.00	0.60
11	300841	康华生物	1,421,954.00	0.57
12	688510	航亚科技	1,412,948.62	0.56

13	000623	吉林敖东	1,392,142.00	0.56
14	601138	工业富联	1,372,206.00	0.55
15	600348	华阳股份	1,362,365.00	0.54
16	603871	嘉友国际	1,352,512.80	0.54
17	000528	柳 工	1,345,275.00	0.54
18	603678	火炬电子	1,342,792.00	0.54
19	600061	国投资本	1,339,205.00	0.53
20	000690	宝新能源	1,303,119.00	0.52

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	245,220,939.56
卖出股票收入（成交）总额	224,101,662.95

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

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间因市场流动性较差或者股指期货贴水较大时，我们有使用股指期货套保调整或保持仓位。

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	1,672,679.63
2	应收清算款	5,834.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	104,224.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,782,739.19

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	134,511	1,171.42	41,295,641.71	26.21	116,273,034.20	73.79

量化智慧混合 A						
华泰柏瑞量化智慧混合 C	3,396	16,085.42	45,435,961.18	83.18	9,190,119.31	16.82
合计	137,463	1,543.65	86,731,602.89	40.87	125,463,153.51	59.13

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	华泰柏瑞量化智慧混合 A	473,300.55	0.3004
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0.00	0.0000
	合计	473,300.55	0.2231

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	华泰柏瑞量化智慧混合 A	10~50
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	10~50
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日 (2015年6月3日) 基金份额总额	906,942,174.07	-
本报告期期初基金份额总额	158,344,178.45	26,538,602.07
本报告期基金总申购份额	20,425,277.37	49,752,573.20
减：本报告期基金总赎回份额	21,200,779.91	21,665,094.78
本报告期基金拆分变	-	-

动份额		
本报告期末基金份 额总额	157,568,675.91	54,626,080.49

§ 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，陆桢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 (%)	

广发证券	6	115,310,505.52	24.64	108,993.74	24.75	-
中信建投	2	100,158,271.53	21.40	93,927.95	21.33	-
申万宏源	2	63,006,706.62	13.46	59,596.51	13.53	-
华泰证券	2	59,644,240.07	12.75	56,105.52	12.74	-
国信证券	1	32,619,059.07	6.97	30,529.57	6.93	-
东方证券	2	28,090,640.96	6.00	26,419.44	6.00	-
上海证券	2	23,804,306.55	5.09	22,279.06	5.06	-
国泰君安	2	16,750,476.35	3.58	15,676.45	3.56	-
中金公司	2	12,701,545.94	2.71	11,888.01	2.70	-
长江证券	2	8,378,171.34	1.79	7,840.97	1.78	-
中信证券	3	7,511,592.22	1.61	7,105.32	1.61	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-

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

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

3、本报告期内，本基金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(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
爱建证	-	-	-	-	-	-

券						
国投证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金投资关联方承销期内分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
3	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
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 24 日
6	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
7	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
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	2024 年 02 月 01 日
9	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
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	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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日