

# 华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞匠心汇选混合
基金主代码	013847
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日
报告期末基金份额总额	285,084,747.30 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金通过深入的基本面研究把握投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置</p> <p>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收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）A 股投资策略</p> <p>本基金主要采用“自下而上”的深度基本面研究策略，主要从以下几个方面进行深度研究从而精选个股：</p> <p>1) 公司主营业务：精选主营业务鲜明，具备行业竞争优势的公司，公司主营业务收入不低于行业平均水平，在管理、品牌、资源、技术、创新等方面具备比较优势；</p>

2) 公司商业模式：精选具有清晰业务规划和发展战略的公司，公司的核心商业模式具有稳定性和可持续性，具有较好发展前景；

3) 公司财务状况：精选财务状况良好的上市公司，利用公司各项财务指标，综合考察上市公司的资产负债情况、盈利能力、成长能力、估值水平等；

4) 公司治理结构情况：精选建立了完善、科学的公司治理结构的公司，包括管理团队稳定、高效，股东结构稳定，注重中小股东利益，信息披露透明，具有合理的激励与约束机制等；

5) 公司所处行业：精选符合盈利趋势向好、发展前景良好、具有良好投资价值的行业进行重点配置，主要采取定性分析和定量分析相结合的方法：

①定性分析：根据宏观经济运行特征、经济景气周期以及行业周期轮动特征，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个维度把握不同行业的景气度变化情况和发展趋势；

②定量分析：利用行业的估值、业绩等多个方面指标进行分析，如行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）等。

6) 公司估值：精选股价尚未反映内在价值或具有估值提升空间的上市公司，根据上市公司所处行业、业务模式以及公司发展中所处的不同阶段等特征，运用相对估值指标和绝对估值模型相结合，并通过估值水平的历史纵向比较和与同行业、全市场横向比较，评估上市公司的投资价值和安全边际。

（2）港股投资策略

本基金可以通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票，并且重点投资于主营业务具备行业竞争优势、核心商业模式具有稳定性和可持续性、财务状况良好、治理结构完善的上市公司。本基金也可以根据基金经理判断选择不投资香港股票。

3、债券组合投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对各类债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将重点关注非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等），具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

其中可转换债券和可交换债券，结合了权益类证券与固定收益类证券的特性，具有下行风险有限同时可分享基础股票价格上涨的特点。本基金将评估其内在投资价值，结合对可转换债券、可交换债券市场上的溢价率及其变动趋势、行业资金的配置以及基础股票基本面的综合分析，最终确定其投资权重及具体品种。

#### 4、资产支持证券投资策略

在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

#### 5、衍生品投资策略

##### （1）股指期货投资策略

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对基金投资组合进行管理，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

##### （2）国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。

##### （3）股票期权投资策略

本基金按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。

#### 6、融资业务的投资策略

本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

	7、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+银行活期存款利率（税后）*20%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于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。	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 A	华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 C
下属分级基金的交易代码	013847	013848
报告期末下属分级基金的份额总额	260,384,326.58 份	24,700,420.72 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	
	华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 A	华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 C
1. 本期已实现收益	-6,337,686.53	-783,943.64
2. 本期利润	17,712,298.16	1,767,505.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0568	0.0508
4. 期末基金资产净值	272,800,222.95	25,835,051.53
5. 期末基金份额净值	1.0477	1.0459

注：1、所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。

#### 3.2 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

华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 A

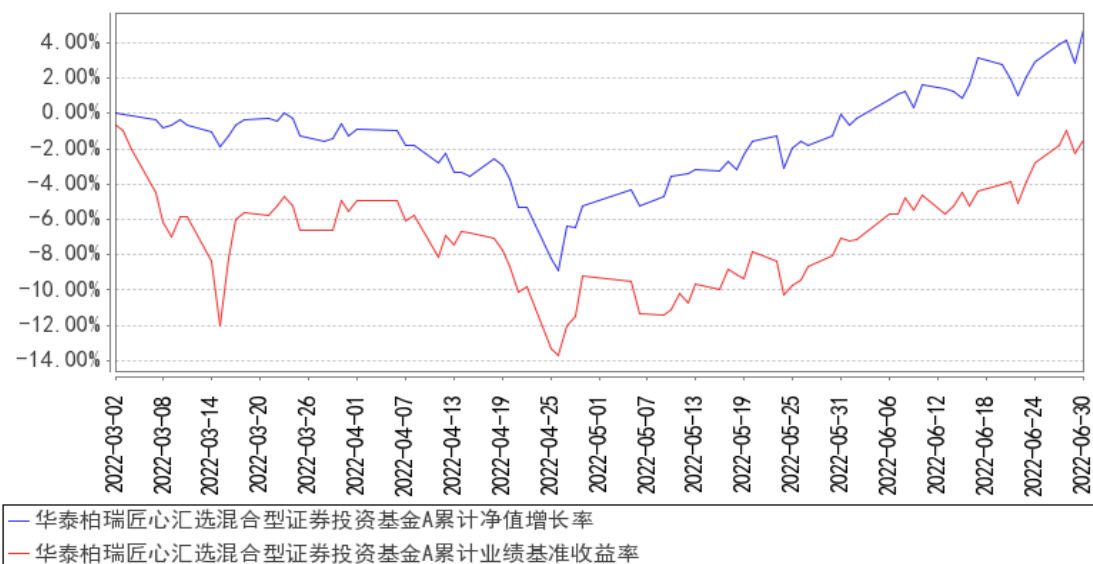
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.13%	0.98%	4.27%	1.15%	1.86%	-0.17%
自基金合同生效起至今	4.77%	0.88%	-1.53%	1.35%	6.30%	-0.47%

华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 C

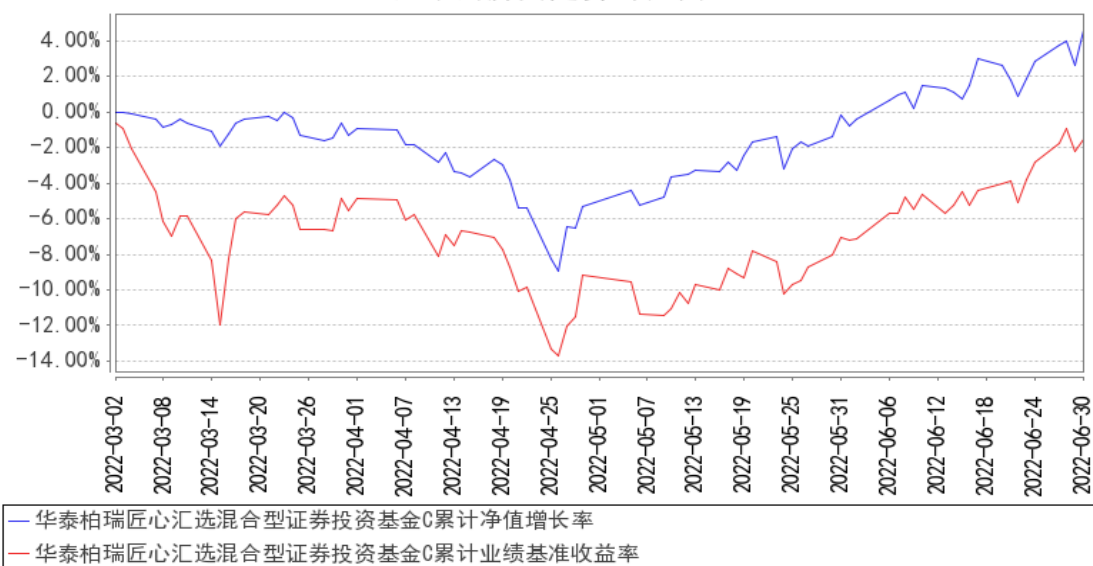
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.99%	0.98%	4.27%	1.15%	1.72%	-0.17%
自基金合同生效起至今	4.59%	0.87%	-1.53%	1.35%	6.12%	-0.48%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金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



华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金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：1、图示日期为 2022 年 3 月 2 日至 2022 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张慧	总经理助理、主动权益投资总监、本基金的基金经理	2022 年 3 月 2 日	-	15 年	经济学硕士，15 年证券从业经历。2007 年 7 月至 2010 年 6 月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理、投资部副总监、投资研究部副总监、投资研究部总监、主动权益投资总监，2021 年 12 月起任公司总经理助理。2013 年 9 月至 2018 年 5 月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014 年 5 月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月至 2020 年 8 月任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月

					起任华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月起任华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月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。2022 年 3 月起任华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

#### 4.1.1 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：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年 2 季度市场先抑后扬，由于新冠疫情的复燃，导致市场出现剧烈波动，企业盈利预期出现混乱，悲观预期蔓延。4 月延续了 3 月以来的调整，并创出了年内新低，4 月下旬随着常态化核酸措施的预期推行，行情转向疫后修复。季度来看，沪深 300 指数上涨 6.2%，创业板指数上涨



5.7%，中证 500 指数上涨 2.0%。

4 月份，成长股和小盘股出现剧烈的调整。随着疫情持续时间超预期，市场的主要矛盾聚焦到疫情以及疫情在全国的扩散上，对国内经济的悲观程度堪比 2018 年下半年，金融、必选消费、地产基建和高股息等成为避险资金的去向。从物流指数来看，4 月经济活动出现收缩，上市公司反馈在生产、物流、交付等某个环节或多个环节出现了困难，市场开始下调 2 季度盈利预测，尤其是需求和成本双重交困的制造业。随着年报、1 季报开始披露，机构投资者开始从季报中寻找业绩具有确定性和持续性的方向，低预期的个股遭到了抛售，业绩驱动的结构持续性在 4 月中下旬开始出现。

进入 5 月份，市场开始沿着季报提供的信息进行结构调整，业绩的确定性、持续性的重要性开始高于估值的重要性。随着上海疫情逐渐见顶回落，常态化核酸方案的预期推行，以及高层进一步强化了稳增长的信心，市场开始修正对于经济硬着陆风险的预期，投资机会沿着疫后修复的逻辑逐次展开。中证 1000 和创业板涨幅居前，军工、光伏、海缆、IGBT 等需求确定的成长方向以及医美、化妆品、快递等消费方向涨幅较好。尤其是汽车板块（包括整车、零部件和智能化）叠加了政策、超跌和疫后修复，涨幅排名第一。综合来看，5 月的反弹以疫后修复为主线，但轮动速度较快，单一方向很难持续获得超额收益，市场追高意愿不足。3-4 月下跌较多的板块，如果叠加较强的基本面逻辑，反弹高度相对较大。前期抗跌的板块，如地产、建筑、金融、养殖等出现回调，能源相关的方向因与国内经济预期关联度不大而走势相对独立，如原油相关、煤炭相关等。

进入 6 月份，市场延续反弹。市场的主流认知建立在流动性宽松而经济偏弱，因此成长方向获得了持续加仓。存量产品加仓和北上的持续流入给市场带来了一定的新增资金，使得行情的持续性超出市场预期。风格方面，海外开始交易衰退，周期方向冲高回落，汽车相关产业链延续强势表现。随着多数公司的估值进入 2022 年合理偏高水平，市场开始寻求更远期的成长空间，如储能、微逆、一体化压铸，并持续提升估值，估值有进入泡沫化的倾向，相关公司的市值开始逼近 2025 年合理市值。随着疫情防控政策更加合理化，疫后修复开始延续到消费领域，食品饮料、地产后周期（家电、建材、轻工）等表现位列市场前 1/2。证券和保险等底部板块也有一定补涨。而地产、农业、银行等板块表现较为落后。

本基金 4 月基金净值继续呈现调整，对净值拖累较多的主要是绿色电力和小市值成长股。我们将新能源车配置替换为光伏，尤其是新技术方向。根据年报和季报情况，我们增配了一部分具有性价比的公司，涉及医药、军工、油运和快递，维持了海缆的持仓。随着市场的持续反弹和部分公司的估值进入合理偏贵的水平，我们减持了部分成长板块，导致在 6 月中旬以后，净值反弹

跟不上市场节奏。我们观察到地产销售的改善超预期，社融结构存在改善的可能，因此增配了估值处于底部的消费建材、内需家电、家居、券商以及食品饮料，获得了一定的超额收益，但光伏组件、军工、油运、快递等 5 月涨幅较大的板块在 6 月对净值贡献较小，低配新能源汽车产业链和微逆、储能等远期估值资产对组合的相对收益产生了拖累。

历史经验表明，当市场处于衰退性宽松阶段，行情可能会以两种形式演绎。一是存在一个主导产业，类似 2013-2014 年的移动互联网化推动的硬、软件产业周期，由于主导产业的业绩持续具有相对优势，估值出现泡沫化。二是没有业绩突出的主导产业，则宽松流动性带来的投资机会以主题投资的形式展开。6 月的市场体现的是上述两种情景假设。

我们认为，市场已经完全修复了因为疫情复燃对指数带来的冲击。当前阶段，市场的上行风险可能来自两类因素。一是社融结构改善，历史上看，当中长期社融开始回升的时候，都会带来指数的行情。当前越来越多的信号，比如地产销售的改善、车市的改善、票据利率的回升都暗示社融结构可能已经开始改善，分歧在于持续性和高度。我们认为目前社融结构改善处于左侧阶段，赔率不错，市场的主流认知仍是衰退性宽松。一旦社融结构改善超预期，指数有望进一步上行，且市场风格也会发生一定变化，类似于 2012 年 4 季度。二是市场有增量资金的流入。6 月市场呈现一定的增量资金流入特征，存量产品加仓和北上流入共同使得市场打破了此前的存量交易格局。我们认为，存量加仓在 6 月可能更起主要作用。随着国内外基本面的相对变化，北上的流入趋势值得关注。上述两个因素都在发生着积极的变化，我们的持仓开始增配与社融结构改善的资产。

我们未来一段时间的持仓将从四个方向进行布局，并注重估值性价比和业绩变化趋势。第一，中期前景确定的成长，如光伏和海缆等。第二，一旦疫情修复，业绩能迅速恢复的行业，比如眼科、快递等。第三，与国内经济弱相关等方向，比如军工、油运、黄金等。第四，与社融结构改善相关的可选消费，如白酒、消费建材、家居和家电等。

市场的尾部风险主要为大国博弈和美国经济衰退。从时间维度上来看，需要关注今年下半年指数是否可能有进一步上行的可能，届时美国的加息缩表预期也基本隐含，国内的稳增长数据也逐渐显现，不排除在今年出现“上半年 2018 年，下半年 2019 年”的情况。即便尾部风险出现，种种因素持续压制市场，从两年到三年的时间维度上来看，投资的胜率是在不断提升的。

我们将保持对持仓个股业绩趋势的持续跟踪，并根据研究成果对组合结构做进一步的优化调整，争取获得超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 A 的基金份额净值为 1.0477 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.13%，同期业绩比较基准收益率为 4.27%，截至本报告期末华泰柏瑞

匠心汇选混合型证券投资基金 C 的基金份额净值为 1.0459 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.99%，同期业绩比较基准收益率为 4.27%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	271,548,765.84	87.03
	其中：股票	271,548,765.84	87.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,260,589.44	2.33
	其中：债券	7,260,589.44	2.33
	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	32,758,403.77	10.50
8	其他资产	445,187.70	0.14
9	合计	312,012,946.75	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	19,115,419.20	6.40
B	采矿业	10,388,348.00	3.48
C	制造业	178,630,933.80	59.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	73,871.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	24,425,883.40	8.18
H	住宿和餐饮业	31,450.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,086,408.84	1.70
J	金融业	9,070,208.20	3.04

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,237,727.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	4,766,381.87	1.60
N	水利、环境和公共设施管理业	101,378.98	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,053,520.55	5.04
R	文化、体育和娱乐业	1,567,235.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	271,548,765.84	90.93

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	603826	坤彩科技	261,900	15,415,434.00	5.16
2	300015	爱尔眼科	332,900	14,903,933.00	4.99
3	002714	牧原股份	226,320	12,508,706.40	4.19
4	002865	钧达股份	106,000	10,108,160.00	3.38
5	600233	圆通速递	448,500	9,144,915.00	3.06
6	002459	晶澳科技	115,391	9,104,349.90	3.05
7	300059	东方财富	356,360	9,051,544.00	3.03
8	002791	坚朗五金	62,200	8,068,584.00	2.70
9	600519	XD 贵州茅	3,900	7,975,500.00	2.67
10	002120	韵达股份	466,800	7,963,608.00	2.67

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,260,589.44	2.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,260,589.44	2.43

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019664	21 国债 16	71,430	7,260,589.44	2.43

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 本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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	74,777.03
2	应收证券清算款	271,987.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	98,423.51
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	445,187.70

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞匠心汇选混合型 证券投资基金 A	华泰柏瑞匠心汇选混合型 证券投资基金 C
报告期期初基金份额总额	320,811,581.97	36,939,312.91
报告期期间基金总申购份额	1,345,550.78	1,631,947.70
减：报告期期间基金总赎回份额	61,772,806.17	13,870,839.89
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	260,384,326.58	24,700,420.72

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 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

### 9.3 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

2022 年 7 月 21 日