

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金 2022 年中期报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞价值增长混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金于 2020 年 8 月 20 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 8 月 20 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	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 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	55
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	55
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	55
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	55

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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞价值增长混合	
基金主代码	460005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 7 月 16 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	276,941,887.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
下属分级基金的交易代码	460005	010037
报告期末下属分级基金的份额总额	275,509,355.02 份	1,432,531.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对宏观经济和投资环境的分析和预测，全面评估证券市场各大类资产的中长期预期风险收益率，确定基金资产在股票、债券和现金及其他资产之间的配置比例，适度控制系统性风险。主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益。重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票，辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金属主动管理的混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566

传真	021-38601799	010-66594942
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄 上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄 上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
本期已实现收益	-316,741,185.54	-1,505,447.63
本期利润	-216,348,154.69	-936,236.41
加权平均基金份额 本期利润	-0.7361	-0.6244
本期加权平均净 值利润率	-19.19%	-17.14%
本期基金份额净 值增长率	-14.15%	-14.49%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利 润	540,023,252.13	3,887,227.17
期末可供分配基 金份额利润	1.9601	2.7135

期末基金资产净值	1,076,237,865.69	5,319,759.16
期末基金份额净值	3.9064	3.7135
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	768.43%	-11.40%

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

华泰柏瑞价值增长混合 A

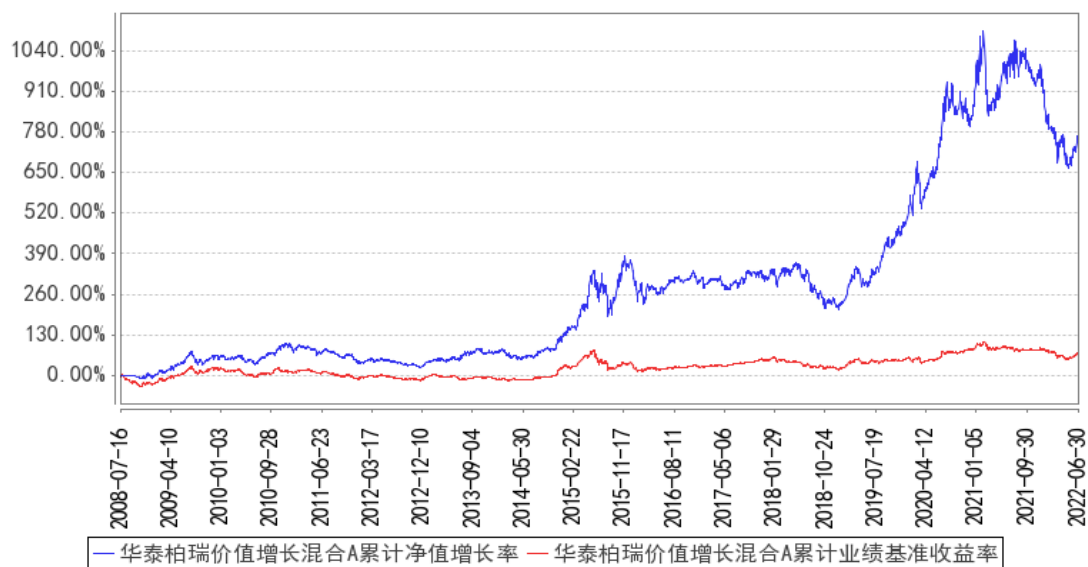
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.58%	1.31%	7.69%	0.86%	-0.11%	0.45%
过去三个月	1.18%	1.63%	5.27%	1.15%	-4.09%	0.48%
过去六个月	-14.15%	1.53%	-6.89%	1.16%	-7.26%	0.37%
过去一年	-22.30%	1.70%	-10.42%	1.00%	-11.88%	0.70%
过去三年	103.42%	1.68%	17.45%	1.01%	85.97%	0.67%
自基金合同生效起至今	768.43%	1.66%	71.35%	1.25%	697.08%	0.41%

华泰柏瑞价值增长混合 C

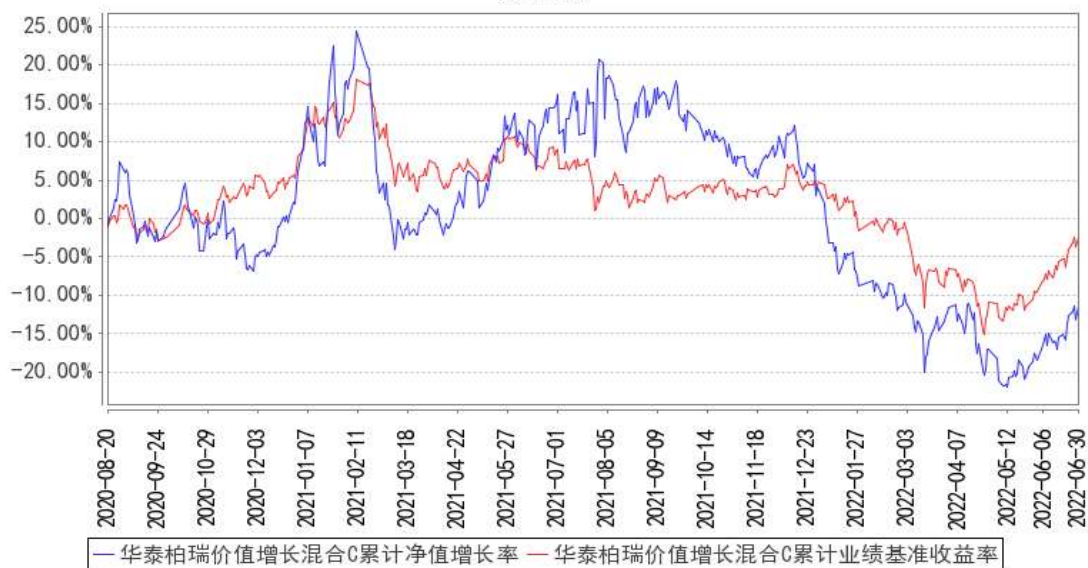
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.51%	1.31%	7.69%	0.86%	-0.18%	0.45%
过去三个月	0.98%	1.63%	5.27%	1.15%	-4.29%	0.48%
过去六个月	-14.49%	1.53%	-6.89%	1.16%	-7.60%	0.37%
过去一年	-22.92%	1.70%	-10.42%	1.00%	-12.50%	0.70%
自基金合同生效起至今	-11.40%	1.71%	-2.51%	0.98%	-8.89%	0.73%

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

华泰柏瑞价值增长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞价值增长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A 级图示日期为 2008 年 7 月 16 日至 2022 年 6 月 30 日。C 级图示日期为 2020 年 8 月 20 日至 2022 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华

泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证

稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2750.48 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓西	副总经理、本基金的基金经理	2020 年 2 月 18 日	-	23 年	副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018 年 8 月起任公司副总经

					理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期指基金管理公司作出决定之日。李晓西 2022 年 7 月 8 日离任本基金的基金经理。方纬 2022 年 7 月 8 日起任本基金的基金经理。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
李晓西	公募基金	5	5,922,506,543.40	2020 年 2 月 18 日
	私募资产管理计划	1	10,140,776.54	2022 年 3 月 22 日
	其他组合	-	-	-
	合计	6	5,932,647,319.94	-

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

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

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

回顾 2022 年上半年，全球宏观环境呈现出多年不遇的复杂局面。在战争、疫情、高油价和高通胀等多重因素共振作用下，A 股市场出现比较大幅度的回撤。4 月底，5 月初上海新冠疫情出现拐点，A 股开启了一轮上升趋势。上半年本基金下跌 14.15%，同期沪深 300 下跌 9.22%。

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价值增长混合 A 基金份额净值为 3.9064 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.15%，同期业绩比较基准收益率为-6.89%；截至本报告期末华泰柏瑞价值增长混合 C 基金份额净值为 3.7135 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.49%，同期业绩比较基准收益率为-6.89%。

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，在上述复杂宏观环境下，中国制造业崛起的势头没有减弱。在每次挫折中，中国企业的全球竞争力正慢慢变强。优秀的中国企业给我们投资带来信心，我们希望 A 股黄金 10 年正在开启，同时也希望投资者把握住这百年一遇的历史性投资机会。本基金将秉承价值投资理念，力争为投资人创造可持续可复制的优秀业绩。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

资产:			
银行存款	6.4.7.1	112,072,492.52	126,704,413.06
结算备付金		4,829,840.01	5,639,673.08
存出保证金		629,224.99	919,234.70
交易性金融资产	6.4.7.2	989,541,528.49	1,402,157,732.28
其中: 股票投资		989,541,528.49	1,402,157,732.28
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		-	3,206,065.89
应收股利		-	-
应收申购款		498,831.30	992,112.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	20,771.12
资产总计		1,107,571,917.31	1,539,640,002.73
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		17,982,563.66	9,584,187.43
应付赎回款		3,377,296.70	1,778,515.58
应付管理人报酬		1,287,368.83	2,086,423.08
应付托管费		214,561.49	347,737.21
应付销售服务费		3,344.61	3,925.45
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	3,149,157.17	4,759,748.51
负债合计		26,014,292.46	18,560,537.26

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	276,941,887.01	334,340,119.70
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	804,615,737.84	1,186,739,345.77
净资产合计		1,081,557,624.85	1,521,079,465.47
负债和净资产总计		1,107,571,917.31	1,539,640,002.73

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 276,941,887.01 份，其中 A 类基金份额净值 3.9064 元，A 类基金份额 275,509,355.02 份；C 类基金份额净值 3.7135 元，C 类基金份额 1,432,531.99 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-207,236,396.31	182,087,956.05
1. 利息收入		237,432.38	1,486,408.44
其中：存款利息收入	6.4.7.13	237,432.38	413,328.79
债券利息收入		-	933,573.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	139,506.03
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-308,767,432.56	354,979,748.37
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-312,710,937.29	350,975,112.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	12,670.00
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,943,504.73	3,991,965.38
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	100,962,242.07	-176,436,758.17
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	331,361.80	2,058,557.41
减：二、营业总支出		10,047,994.79	36,692,255.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,474,369.40	17,330,824.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,412,394.96	2,888,470.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	21,747.20	34,671.64
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	139,483.23	16,438,288.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-217,284,391.10	145,395,700.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-217,284,391.10	145,395,700.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-217,284,391.10	145,395,700.14

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	334,340,119.70	-	1,186,739,345.77	1,521,079,465.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期	334,340,119.70	-	1,186,739,345.77	1,521,079,465.47

期初净资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-57,398,232.69	-	-382,123,607.93	-439,521,840.62
（一）、综合收益总额	-	-	-217,284,391.10	-217,284,391.10
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-57,398,232.69	-	-164,839,216.83	-222,237,449.52
其中：1. 基金申购款	25,216,516.05	-	72,470,205.91	97,686,721.96
2. 基金赎回款	-82,614,748.74	-	-237,309,422.74	-319,924,171.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	276,941,887.01	-	804,615,737.84	1,081,557,624.85
项目	上年度可比期间			

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	539,630,129.59	-	2,369,782,708.47	2,909,412,838.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	539,630,129.59	-	2,369,782,708.47	2,909,412,838.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-221,676,909.27	-	-914,958,848.24	-1,136,635,757.51
（一）、综合收益总额	-	-	145,395,700.14	145,395,700.14
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-221,676,909.27	-	-936,517,537.93	-1,158,194,447.20
其中：1. 基金申购款	130,826,292.57	-	577,968,636.60	708,794,929.17
2. 基金赎回款	-352,503,201.84	-	1,514,486,174.53	-1,866,989,376.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-123,837,010.45	-123,837,010.45

变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	317,953,220.32	-	1,454,823,860.23	1,772,777,080.55

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

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(原名为友邦华泰价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 543 号《关于核准友邦华泰价值增长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由友邦华泰基金管理有限公司(已自 2010 年 4 月 30 日起更名为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《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 406,224,705.76 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 406,303,580.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 78,874.49 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2020 年 8 月 20 日起增加收取销售服务费的 C 类份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 C 类份额后，原有的基金份额全部自动划归为本基金 A 类份额。对投资者申购时收取申购费用，赎回时收

取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；对投资者申购时不收取申购费用，但在赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金增加 C 类基金份额后，将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、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。本基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的 60%-95%；现金、债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 8 月 30 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》、各项具体会计准则及相关规定（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》、《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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

除 6.4.5 的会计政策变更外，其他项目与上年度一致。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。金融资产减值计量方式的变更对于本基金的影响不重大。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 126,704,413.06 元、5,639,673.08 元、919,234.70 元、20,771.12 元、3,206,065.89 元和 992,112.60 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 126,721,937.53 元、5,642,464.66 元、919,689.77 元、0.00 元、3,206,065.89 元和 992,112.60 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，

金额为 1,402,157,732.28 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,402,157,732.28 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,584,187.43 元、1,778,515.58 元、2,086,423.08 元、347,737.21 元、3,925.45 元、4,534,626.78 元和 5,121.73 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,584,187.43 元、1,778,515.58 元、2,086,423.08 元、347,737.21 元、3,925.45 元、4,534,626.78 元和 5,121.73 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	112,072,492.52
等于：本金	112,063,057.69
加：应计利息	9,434.83
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	112,072,492.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	883,333,448.79	-	989,541,528.49	106,208,079.70
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	883,333,448.79	-	989,541,528.49	106,208,079.70

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：截至本报告期末，本基金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：截至本报告期末，本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：截至本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

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：截至本报告期末本基金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：截至本报告期末，本基金未投资债权。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未投资债权。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：截至本报告期末，本基金未投资其他债权。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未投资其他债权。

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：截至本报告期末，本基金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：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,185.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,029,875.28
其中：交易所市场	3,029,875.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	3,149,157.17

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞价值增长混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	333,003,002.87	333,003,002.87
本期申购	24,487,398.97	24,487,398.97
本期赎回（以“-”号填列）	-81,981,046.82	-81,981,046.82
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	275,509,355.02	275,509,355.02

华泰柏瑞价值增长混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,337,116.83	1,337,116.83
本期申购	729,117.08	729,117.08
本期赎回（以“-”号填列）	-633,701.92	-633,701.92
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	1,432,531.99	1,432,531.99

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：截至本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞价值增长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	996,265,506.24	186,003,996.12	1,182,269,502.36
本期利润	-316,741,185.54	100,393,030.85	-216,348,154.69
本期基金份额交易产生的变动数	-139,501,068.57	-25,691,768.43	-165,192,837.00
其中：基金申购款	56,714,481.87	13,772,058.67	70,486,540.54
基金赎回款	-196,215,550.44	-39,463,827.10	-235,679,377.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	540,023,252.13	260,705,258.54	800,728,510.67

华泰柏瑞价值增长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,936,941.42	-1,467,098.01	4,469,843.41
本期利润	-1,505,447.63	569,211.22	-936,236.41
本期基金份额交易产生的变动数	499,279.68	-145,659.51	353,620.17
其中：基金申购款	2,794,400.48	-810,735.11	1,983,665.37
基金赎回款	-2,295,120.80	665,075.60	-1,630,045.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,930,773.47	-1,043,546.30	3,887,227.17

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	188,042.13
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	43,401.61
其他	5,988.64
合计	237,432.38

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-312,710,937.29
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	-312,710,937.29

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	3,821,413,536.41
减：卖出股票成本总额	4,122,790,029.79
减：交易费用	11,334,443.91
买卖股票差价收入	-312,710,937.29

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。

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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

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。

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：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,943,504.73
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,943,504.73

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	100,962,242.07
股票投资	100,962,242.07
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	100,962,242.07

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	327,138.35
基金转换费收入	4,223.45
合计	331,361.80

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：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
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	11,787.29
合计	139,483.23

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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	2,517,905,954.23	33.97	2,340,579,067.40	22.59

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
华泰证券	2,313,560.09	33.77	661,000.12	21.82
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	2,143,799.24	22.47	964,391.07	20.60

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。权证交易不计佣金。

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

服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,474,369.40	17,330,824.64
其中：支付销售机构的客户维护费	2,616,593.11	5,095,810.07

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,412,394.96	2,888,470.86

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞价值增长混合	华泰柏瑞价值增长混合	合计
	A	C	
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	415.87	415.87
合计	0.00	415.87	415.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞价值增长混合	华泰柏瑞价值增长混合	合计
	A	C	

华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	926.14	926.14
合计	0.00	926.14	926.14

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.8% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期与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：无。

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：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
基金合同生效日（2008 年 7 月 16 日）持有的基金份额	10,007,525.00	0.00
报告期初持有的基金份额	998,680.58	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总 份额	998,680.58	0.00

报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
基金合同生效日（2008年7月16日）持有的基金份额	10,007,525.00	0.00
报告期初持有的基金份额	2,998,680.58	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	998,680.58	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3141%	0.0000%

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	112,072,492.52	188,042.13	257,134,185.29	337,341.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40

华泰联合证券	600938	中国海油	网下申购	120,005	1,296,054.00
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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：张）	总金额
华泰联合证券	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022 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
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦	2022	6 个月	新股锁	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-

	智能	年 6 月 20 日		定期内							
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股锁 定期内	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42		-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁 定期内	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28		-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股锁 定期内	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37		-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股锁 定期内	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90		-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁 定期内	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56		-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46		-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁 定期内	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02		-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08		-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股锁 定期内	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁 定期内	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92		-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股锁 定期内	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44		-
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期内	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62		-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁 定期内	109.30	45.69	843	61,426.60	38,516.67		-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁 定期内	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-

301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股锁定期内	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股锁定期内	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定期内	173.98	87.82	324	31,316.40	28,453.68	-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股锁定期内	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股锁定期内	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定期内	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股锁定期内	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股锁定期内	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定期内	19.18	32.07	2,757	52,879.26	88,416.99	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定期内	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定期内	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年4月	6个月	新股锁定期内	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-

		18 日								
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688267	中触媒	2022 年 2 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	41.90	31.90	3,390	142,041.00	108,141.00	-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股未上市	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内 (含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、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或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无

债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券的出借业务。

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，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，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 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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 2022 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 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为 0.32%。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	112,072,492.52	-	-	-	-	-	112,072,492.52
结算备付金	4,829,840.01	-	-	-	-	-	4,829,840.01
存出保证金	629,224.99	-	-	-	-	-	629,224.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	989,541,528.49	989,541,528.49
应收申购款	-	-	-	-	-	498,831.30	498,831.30
资产总计	117,531,557.52	-	-	-	-	990,040,359.79	1,107,571,917.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,377,296.70	3,377,296.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,287,368.83	1,287,368.83
应付托管费	-	-	-	-	-	214,561.49	214,561.49
应付清算款	-	-	-	-	-	17,982,563.66	17,982,563.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,344.61	3,344.61
其他负债	-	-	-	-	-	3,149,157.17	3,149,157.17
负债总计	-	-	-	-	-	26,014,292.46	26,014,292.46

利率敏感度缺口	117,531,557.52	-	-	-	-	964,026,067.33	1,081,557,624.85
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	126,704,413.06	-	-	-	-	-	126,704,413.06
结算备付金	5,639,673.08	-	-	-	-	-	5,639,673.08
存出保证金	919,234.70	-	-	-	-	-	919,234.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,402,157,732.28	-1,402,157,732.28
应收申购款	-	-	-	-	-	992,112.60	992,112.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,206,065.89	3,206,065.89
其他资产	-	-	-	-	-	20,771.12	20,771.12
资产总计	133,263,320.84	-	-	-	-	-1,406,376,681.89	1,539,640,002.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,778,515.58	1,778,515.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,086,423.08	2,086,423.08
应付托管费	-	-	-	-	-	347,737.21	347,737.21
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,584,187.43	9,584,187.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,925.45	3,925.45
其他负债	-	-	-	-	-	4,759,748.51	4,759,748.51
负债总计	-	-	-	-	-	18,560,537.26	18,560,537.26
利率敏感度缺口	133,263,320.84	-	-	-	-	-1,387,816,144.63	1,521,079,465.47

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 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(2021 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证资产占基金资产的 60%-95%；现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。每个交易日日终，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%。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 2022年6月30日		上年度末 2021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	989,541,528.49	91.49	1,402,157,732.28	92.18
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	989,541,528.49	91.49	1,402,157,732.28	92.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月	

			31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	62,741,210.86	100,402,507.00
	沪深 300 指数下降 5%	-62,741,210.86	-100,402,507.00

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	986,077,932.60	1,398,348,362.78
第二层次	1,390,620.12	3,809,369.50
第三层次	2,072,975.77	-
合计	989,541,528.49	1,402,157,732.28

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 2022 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(2021 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

注: 无。

§ 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	989,541,528.49	89.34
	其中: 股票	989,541,528.49	89.34
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	116,902,332.53	10.55
8	其他各项资产	1,128,056.29	0.10
9	合计	1,107,571,917.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	54,901,522.84	5.08
C	制造业	813,310,585.75	75.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,074.20	0.00
E	建筑业	14,886.32	0.00

F	批发和零售业	93,266.86	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	15,222.00	0.00
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,704,684.95	3.86
J	金融业	10,913,025.00	1.01
K	房地产业	195,552.00	0.02
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	45,958,046.30	4.25
N	水利、环境和公共设施管理业	283,844.25	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	22,052,903.69	2.04
R	文化、体育和娱乐业	20,977.11	0.00
S	综合	-	-
	合计	989,541,528.49	91.49

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	600519	贵州茅台	49,200	100,614,000.00	9.30
2	300750	宁德时代	135,150	72,170,100.00	6.67
3	601012	隆基绿能	1,069,040	71,230,135.20	6.59
4	603198	迎驾贡酒	1,075,505	70,058,395.70	6.48
5	000568	泸州老窖	282,700	69,696,858.00	6.44
6	600809	山西汾酒	207,260	67,318,048.00	6.22
7	002304	洋河股份	311,800	57,106,170.00	5.28
8	000768	中航西飞	1,517,090	45,952,656.10	4.25
9	603259	药明康德	440,757	45,834,320.43	4.24
10	601225	陕西煤业	2,054,700	43,518,546.00	4.02
11	300595	欧普康视	738,908	42,258,148.52	3.91
12	600570	恒生电子	950,938	41,403,840.52	3.83
13	300014	亿纬锂能	362,500	35,343,750.00	3.27
14	300207	欣旺达	993,300	31,388,280.00	2.90
15	300015	爱尔眼科	487,900	21,843,283.00	2.02
16	300568	星源材质	697,797	20,264,024.88	1.87
17	688223	晶科能源	1,241,933	18,542,059.69	1.71
18	600438	通威股份	294,800	17,646,728.00	1.63
19	605499	东鹏饮料	102,200	17,461,892.00	1.61

20	688033	天宜上佳	634,426	13,475,208.24	1.25
21	002245	蔚蓝锂芯	563,500	13,078,835.00	1.21
22	002013	中航机电	1,011,600	12,493,260.00	1.16
23	300033	同花顺	113,500	10,913,025.00	1.01
24	600760	中航沈飞	110,000	6,649,500.00	0.61
25	600938	中国海油	337,866	5,762,195.34	0.53
26	601088	中国神华	168,355	5,606,221.50	0.52
27	600600	青岛啤酒	53,947	5,606,172.24	0.52
28	603659	璞泰来	66,200	5,587,280.00	0.52
29	600487	亨通光电	370,500	5,387,070.00	0.50
30	002179	中航光电	79,660	5,044,071.20	0.47
31	000661	长春高新	12,400	2,894,408.00	0.27
32	002960	青鸟消防	100,300	2,747,217.00	0.25
33	688047	龙芯中科	7,418	683,568.70	0.06
34	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.03
35	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.02
36	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
37	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
38	600048	保利发展	11,200	195,552.00	0.02
39	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
40	300073	当升科技	1,783	161,076.22	0.01
41	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.01
42	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
43	688267	中触媒	3,390	108,141.00	0.01
44	301155	海力风电	1,054	95,914.00	0.01
45	301238	瑞泰新材	2,757	88,416.99	0.01
46	600161	天坛生物	3,384	82,163.52	0.01
47	300979	华利集团	925	67,599.00	0.01
48	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
49	300012	华测检测	2,416	56,075.36	0.01
50	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
51	301206	三元生物	843	38,516.67	0.00
52	300973	立高食品	360	37,422.00	0.00
53	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
54	301216	万凯新材	1,195	35,787.05	0.00
55	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
56	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
57	301219	腾远钴业	324	28,453.68	0.00
58	300981	中红医疗	1,082	27,288.04	0.00
59	688501	青达环保	1,759	27,071.01	0.00
60	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
61	301256	华融化学	2,508	25,768.08	0.00

62	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
63	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
64	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
65	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
66	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
67	603378	亚士创能	1,682	19,612.12	0.00
68	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
69	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
70	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
71	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
72	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
73	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
74	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
75	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
76	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
77	001216	华瓷股份	1,178	15,137.30	0.00
78	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.00
79	300982	苏文电能	317	14,886.32	0.00
80	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
81	600985	淮北矿业	1,000	14,560.00	0.00
82	301258	富士莱	342	14,430.81	0.00
83	603230	内蒙新华	1,141	14,273.91	0.00
84	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
85	605056	咸亨国际	934	14,168.78	0.00
86	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.00
87	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
88	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
89	300986	志特新材	370	13,616.00	0.00
90	301199	迈赫股份	402	12,880.08	0.00
91	300932	三友联众	689	12,670.71	0.00
92	300941	创识科技	599	12,608.95	0.00
93	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.00
94	605162	新中港	1,377	12,461.85	0.00
95	300997	欢乐家	928	12,398.08	0.00
96	605028	世茂能源	615	12,256.95	0.00
97	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
98	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
99	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00
100	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
101	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.00
102	300930	屹通新材	322	11,566.24	0.00
103	300940	南极光	491	11,553.23	0.00

104	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
105	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
106	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
107	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
108	605365	立达信	645	10,687.65	0.00
109	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.00
110	300968	格林精密	1,162	10,527.72	0.00
111	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.00
112	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
113	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
114	301017	漱玉平民	555	10,289.70	0.00
115	300942	易瑞生物	443	10,233.30	0.00
116	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
117	301009	可靠股份	801	9,996.48	0.00
118	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.00
119	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
120	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
121	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
122	301020	密封科技	421	9,472.50	0.00
123	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
124	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
125	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.00
126	300933	中辰股份	1,112	9,062.80	0.00
127	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
128	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
129	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
130	605580	恒盛能源	655	8,829.40	0.00
131	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
132	300962	中金辐照	576	8,697.60	0.00
133	300966	共同药业	286	8,537.10	0.00
134	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.00
135	301013	利和兴	707	8,476.93	0.00
136	300985	致远新能	295	8,466.50	0.00
137	300926	博俊科技	359	8,382.65	0.00
138	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.00
139	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
140	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
141	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
142	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
143	300937	药易购	244	7,812.88	0.00
144	300978	东箭科技	593	7,738.65	0.00
145	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00

146	301198	喜悦智行	341	7,689.55	0.00
147	300945	曼卡龙	474	7,621.92	0.00
148	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
149	603150	万朗磁塑	251	7,472.27	0.00
150	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
151	300956	英力股份	371	6,729.94	0.00
152	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
153	300987	川网传媒	391	6,596.17	0.00
154	301002	崧盛股份	261	6,491.07	0.00
155	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
156	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00
157	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
158	300952	恒辉安防	340	5,916.00	0.00
159	300991	创益通	407	5,852.66	0.00
160	300963	中洲特材	283	5,484.54	0.00
161	300961	深水海纳	394	5,342.64	0.00
162	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
163	300931	通用电梯	672	5,194.56	0.00
164	300948	冠中生态	324	5,141.88	0.00
165	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
166	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
167	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
168	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
169	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
170	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
171	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
172	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
173	300995	奇德新材	191	4,087.40	0.00
174	300929	华骐环保	293	4,028.75	0.00
175	600845	宝信软件	67	3,658.20	0.00
176	300999	金龙鱼	65	3,511.30	0.00
177	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	203,726,872.85	13.39
2	603259	药明康德	160,515,632.71	10.55
3	000002	万科 A	129,072,011.73	8.49
4	601155	新城控股	111,691,325.30	7.34
5	000568	泸州老窖	97,488,013.58	6.41

6	601088	中国神华	93,013,970.68	6.11
7	601225	陕西煤业	90,848,384.75	5.97
8	600809	山西汾酒	89,462,300.82	5.88
9	000983	山西焦煤	82,629,084.97	5.43
10	600985	淮北矿业	78,909,212.87	5.19
11	601012	隆基绿能	76,312,630.72	5.02
12	000876	新希望	73,126,258.41	4.81
13	601699	潞安环能	67,957,816.23	4.47
14	603456	九洲药业	64,317,217.75	4.23
15	603198	迎驾贡酒	61,491,608.18	4.04
16	300759	康龙化成	61,389,570.32	4.04
17	600048	保利发展	60,950,410.06	4.01
18	600570	恒生电子	60,754,759.92	3.99
19	000656	金科股份	60,429,408.00	3.97
20	600383	金地集团	60,249,640.14	3.96
21	000739	普洛药业	58,476,217.67	3.84
22	600938	中国海油	56,406,462.37	3.71
23	600585	海螺水泥	56,345,889.73	3.70
24	000860	顺鑫农业	55,290,644.90	3.63
25	688599	天合光能	54,956,739.81	3.61
26	601211	国泰君安	53,326,943.79	3.51
27	002714	牧原股份	52,058,259.46	3.42
28	000768	中航西飞	50,873,677.10	3.34
29	000069	华侨城 A	50,677,314.39	3.33
30	002304	洋河股份	50,581,259.87	3.33
31	600519	贵州茅台	49,655,165.00	3.26
32	300014	亿纬锂能	49,138,516.15	3.23
33	603806	福斯特	48,846,341.02	3.21
34	600030	中信证券	44,857,699.11	2.95
35	688223	晶科能源	44,457,054.52	2.92
36	600153	建发股份	43,476,910.98	2.86
37	300347	泰格医药	43,010,225.91	2.83
38	001979	招商蛇口	42,203,872.27	2.77
39	601166	兴业银行	41,050,585.00	2.70
40	300595	欧普康视	39,922,747.90	2.62
41	300207	欣旺达	37,504,081.26	2.47
42	600188	兖矿能源	36,658,171.57	2.41
43	600438	通威股份	35,707,929.29	2.35
44	601288	农业银行	34,735,358.00	2.28
45	601899	紫金矿业	34,405,075.53	2.26
46	000066	中国长城	34,398,710.89	2.26
47	601666	平煤股份	33,423,683.12	2.20

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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	300750	宁德时代	200,199,680.66	13.16
2	603259	药明康德	192,782,471.19	12.67
3	000568	泸州老窖	137,248,544.67	9.02
4	000002	万科 A	116,696,929.99	7.67
5	600809	山西汾酒	110,116,908.40	7.24
6	601088	中国神华	102,862,781.25	6.76
7	600570	恒生电子	96,044,661.14	6.31
8	601155	新城控股	93,007,754.06	6.11
9	600519	贵州茅台	92,394,344.13	6.07
10	300014	亿纬锂能	81,292,161.36	5.34
11	000983	山西焦煤	80,287,745.68	5.28
12	600985	淮北矿业	75,614,793.83	4.97
13	300760	迈瑞医疗	75,601,922.80	4.97
14	600030	中信证券	75,147,052.84	4.94
15	601225	陕西煤业	70,585,836.93	4.64
16	000739	普洛药业	70,319,243.17	4.62
17	002241	歌尔股份	68,487,446.50	4.50
18	600436	片仔癀	68,380,934.78	4.50
19	600383	金地集团	66,528,679.09	4.37
20	000876	新希望	65,687,396.51	4.32
21	001979	招商蛇口	64,896,284.24	4.27
22	600048	保利发展	61,497,119.66	4.04
23	600893	航发动力	60,734,668.49	3.99
24	603456	九洲药业	60,162,763.16	3.96
25	000799	酒鬼酒	57,926,532.54	3.81
26	600938	中国海油	56,757,636.51	3.73
27	300759	康龙化成	56,601,556.36	3.72
28	603369	今世缘	56,417,523.00	3.71
29	601699	潞安环能	56,317,793.68	3.70
30	603198	迎驾贡酒	55,208,860.14	3.63
31	000656	金科股份	54,895,333.82	3.61
32	600585	海螺水泥	52,426,970.76	3.45
33	600153	建发股份	50,412,911.52	3.31
34	688599	天合光能	50,354,932.71	3.31
35	601211	国泰君安	48,673,931.24	3.20
36	002714	牧原股份	47,335,579.95	3.11
37	603806	福斯特	47,326,617.69	3.11

38	000860	顺鑫农业	43,770,893.74	2.88
39	000069	华侨城 A	43,698,236.00	2.87
40	300347	泰格医药	42,322,994.60	2.78
41	600882	妙可蓝多	38,666,505.75	2.54
42	601166	兴业银行	38,052,850.00	2.50
43	600188	兖矿能源	37,790,473.60	2.48
44	601899	紫金矿业	36,742,037.57	2.42
45	000768	中航西飞	35,402,598.00	2.33
46	600745	闻泰科技	35,225,539.21	2.32
47	601288	农业银行	34,245,583.00	2.25

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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	3,609,211,583.93
卖出股票收入（成交）总额	3,821,413,536.41

注：“买入股票成本”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。

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，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。

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	629,224.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	498,831.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,128,056.29

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

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。

§ 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 价值增长	81,195	3,393.18	37,827,552.36	13.73	237,681,802.66	86.27

混合 A						
华泰柏瑞 价值增长 混合 C	1,636	875.63	0.00	0	1,432,531.99	100.00
合计	82,459	3,358.54	37,827,552.36	13.66	239,114,334.65	86.34

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	华泰柏瑞价值增长混合 A	516,684.02	0.1875
	华泰柏瑞价值增长混合 C	0.24	0.0000
	合计	516,684.26	0.1866

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞价值增长混合 A	0~10
	华泰柏瑞价值增长混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞价值增长混合 A	0
	华泰柏瑞价值增长混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
基金合同生效日 (2008 年 7 月 16 日) 基金份额总额	406,303,580.25	-
本报告期期初基金份额总额	333,003,002.87	1,337,116.83
本报告期基金总申购份额	24,487,398.97	729,117.08

减：本报告期基金总赎回份额	81,981,046.82	633,701.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	275,509,355.02	1,432,531.99

§ 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

2022 年 3 月 15 日，公司股东批准 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、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	2	2,607,103,693.16	35.17	2,422,984.99	35.37	-
华泰证券	3	2,517,905,9	33.97	2,313,560.0	33.77	-

		54.23		9		
兴业证券	1	711,543,280.43	9.60	662,658.68	9.67	-
中金财富证券	1	584,555,212.53	7.89	538,550.48	7.86	-
渤海证券	1	513,587,698.83	6.93	478,295.89	6.98	-
申万宏源	2	477,482,929.49	6.44	435,130.95	6.35	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

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

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

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

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

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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下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	2022 年 4 月 16 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 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	2022 年 1 月 1 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

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 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

2022 年 8 月 30 日