

华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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 10 月 26 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 10 月 25 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 7 月 1 日起至 2022 年 9 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	226,571,586.66 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	206,920,088.09 份	19,651,498.57 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 7 月 1 日-2022 年 9 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	5,238,790.48	460,665.26
2. 本期利润	-22,621,862.14	-2,115,501.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1013	-0.1027
4. 期末基金资产净值	194,934,593.26	18,459,144.39
5. 期末基金份额净值	0.9421	0.9393

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

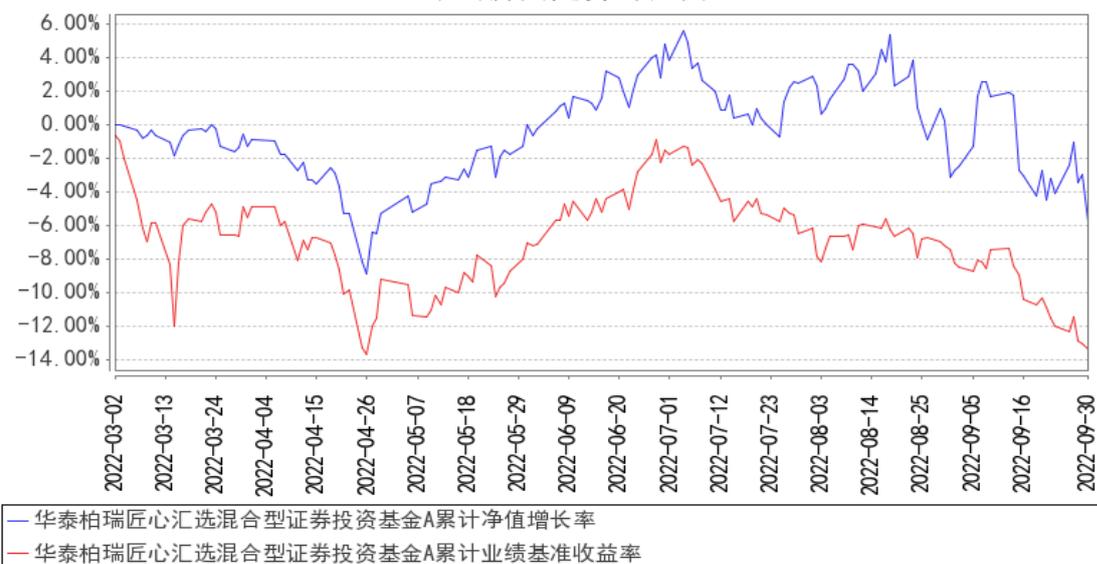
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.08%	1.40%	-12.00%	0.75%	1.92%	0.65%
过去六个月	-4.57%	1.22%	-8.25%	0.97%	3.68%	0.25%
自基金合同生效起至今	-5.79%	1.14%	-13.35%	1.12%	7.56%	0.02%

华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金 C

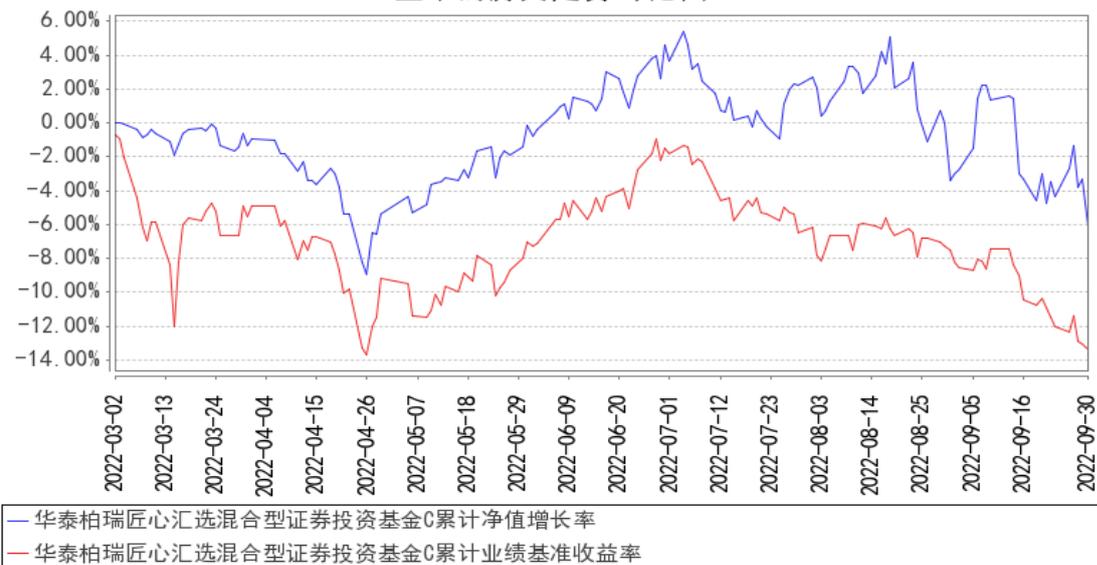
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.19%	1.40%	-12.00%	0.75%	1.81%	0.65%
过去六个月	-4.81%	1.22%	-8.25%	0.97%	3.44%	0.25%
自基金合同生效起至今	-6.07%	1.14%	-13.35%	1.12%	7.28%	0.02%

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 03 月 02 日（基金合同生效日）至 2022 年 09 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 3 季度，市场进入反弹后的回踩阶段，宽基指数普跌，沪深 300 指数下跌 15.2%，中证 500 指数下跌 11.5%，中证 1000 指数下跌 12.4%，创业板指数跌幅最大，达到 18.6%，投资者情绪逐渐走向低迷，走势又似“4 月”再现。

随着新冠疫情反复以及断贷事件发酵，市场的预期发生较大改变，疫后修复和经济复苏链条

的逻辑被打断，市场重新聚集到景气周期的方向上寻找细分领域的机会。此前我们提到，市场可能上行的风险有两个，一是社融结构持续改善，二是增量资金持续流入。这两点均未出现，使得指数重回震荡区间。从行业表现看，分化巨大，以机械、汽车、新能源、军工为代表的景气行业获得正收益，消费、医药和周期板块下跌。景气行业内部也发生了较大的分化，总量逻辑驱动领域表现一般，低渗透率和技术变化等特征的细分领域，如一体化压铸、汽车智能化、钠电池、PET 铜箔、人形机器人、Topcon、碳化硅等细分领域非常活跃，呈现主题投资的特征。

8 月上旬市场延续分化，业绩超预期方向获得进一步增持，小市值题材炒作盛行，局部交易出现拥挤。由于市场存量特征依然显著，8 月下旬之后，市场出现了较大幅度的补跌，景气赛道先后调整。从基本面分歧较大的新能源汽车中、上游、汽车整车扩散到能源相关的光伏、储能、风电以及一些新能源+的小市值公司。市场试图从两个角度实现一定的轮动：一是在景气赛道内部切换，比如电子行业的关注度显著提升。二是从景气赛道向疫后链条和经济链条进行切换，这些领域形成的业绩弹性仍不清晰，但调整较为充分，市场左侧交易困境反转。交易从周期向金融和消费扩散，市场风偏快速降低，以煤炭、石化为代表的旧能源，以保险、券商为代表的困境反转，以及以食品饮料和地产为代表的经济复苏方向均在 8 月份获得了超额收益。

进入 9 月份，市场延续调整，宽基指数大幅下跌，全月仅煤炭指数收红，旧能源、金融地产、出行链和医药消费有相对收益。市场缺乏主线，在情绪进入冰点期后，调整充分的方向在 9 月下旬获得了显著的相对收益，避险情绪浓厚。一些存在基本面分歧的方向，如汽车、新能源汽车调整幅度较大。市场处于风格拉锯期，业绩确定性高的方向和风险补偿充足的方向均获得了超额收益。

本基金在 7 月初的配置结构中有部分持仓与社融结构改善预期相关，如消费建材、内需家电、家居、券商以及食品饮料，疫情和断贷使得该部分资产出现下跌，我们根据宏观和中观变化做了相应的比例调整。在选股上聚焦业绩和 23 年景气度。整个组合大致可分为四类资产，一是以风光储为代表的业绩高增个股。二是以军工、电子、计算机为代表的泛“安全”个股。三是以食品饮料、消费者服务为代表的疫后复苏板块。四是以家电、建材代表的经济复苏板块。从配比上看，前两者占组合的大部分，后两者为我们针对 4 季度经济政策变化而配置的观察仓位。前两者业绩有迹可循，可把握性较高。后两者偏困境反转思路，其表现需要看政策力度和预期变化。

展望 4 季度，我们信心的最大来源是 A 股市场的估值水平与盈利增长、流动性的匹配度。沪深 300 为代表的宽基指数估值水平已处于历史偏低水平，并且流动性仍处于相对宽裕环境，股债大类资产的性价比处于对股票有利位置。截至 2022 年 9 月 30 日，与经济关联度较大的沪深 300、中证 800 的 PB 估值处于 16 年以来的 5%分位，Wind 全 A、中证 1000 和创业板指的 PB 估值处于 16

年以来的 7%、22%、44%分位。景气赛道，如新能源的 PB 估值处于 16 年以来的 76%分位，但 PE 估值处于 16 年以来的 11%分位，意味着如果景气度延续，估值下调的空间也很有限。

我们认为宏观环境可能造成扰动，但仍然充满信心。市场尾部风险主要来自大国博弈和海外经济衰退，国际局势的动荡使得风险偏好较低，而国内则要继续应对房地产下行风险，居民部门的消费、投资等行为已经受到相关影响。但即使尾部风险出现，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。政策方面，由于出口增速逐步回落，对于就业、流动性、经济增长的贡献都在边际减轻，人民币贬值压力也出现增强，因此稳定内需的必要性逐步增强，地产的中期风险在“保交楼”等政策发力下应会逐步缓解。

4 季度要兼顾宏观情景假设与行业景气变化，具体的投资机会主要从以下几个方面展开：一是，全球能源危机的演变尚不明朗，能源结构的重构或许刚刚开始，光伏、储能和海上风电的景气延续性较好，电力运营值得关注；二是，俄乌冲突使得逆全球化进程可能加速，国产替代或是未来数年确定性内需的来源之一，各领域国产化进程方兴未艾。三是，与国内经济弱相关，能够应对潜在宏观波动率放大的一些行业，比如军工、油运、黄金等，其中的优质个股能够作为较好的底仓补充。四是，国内稳增长和疫后修复相关的领域，如白酒、消费建材、医疗服务、机场、酒店等，一旦经济预期修复也有望受益。但考虑到当前疫情反复和经济复苏的曲折性，行情会伴随预期波动呈现起落。

我们认为当前市场处于风格拉锯期，最终胜出的风格将来自重要会议后对经济战略的定调和落实。当前市场的交易拥挤度基本修复完毕，市场重新聚集的方向值得重视。从自下而上来看，我们梳理了 23 年的景气度方向，电力设备、军工景气度延续性较好，机械、交运景气度改善，社服、地产链、公用事业、电子、计算机景气度或可改善。我们计划维持景气赛道、自主可控、疫后修复、经济复苏四类资产的配置结构，并将根据政策变化做一定的应对，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 0.9421 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.08%，同期业绩比较基准收益率为-12.00%，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 0.9393 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.19%，同期业绩比较基准收益率为-12.00%。

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	190,433,370.40	88.63
	其中：股票	190,433,370.40	88.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,293,415.92	3.39
	其中：债券	7,293,415.92	3.39
	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	14,968,633.18	6.97
8	其他资产	2,175,007.66	1.01
9	合计	214,870,427.16	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	52,495.20	0.02
B	采矿业	101,559.00	0.05
C	制造业	155,302,778.71	72.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,422,792.80	1.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,699,238.00	2.20
G	交通运输、仓储和邮政业	4,433,664.28	2.08
H	住宿和餐饮业	4,186,375.00	1.96
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,656,155.95	6.87
J	金融业	26,902.60	0.01
K	房地产业	7,200.00	0.00
L	租赁和商务服务业	59,475.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	55,819.05	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	12,951.52	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,386,496.29	2.06
R	文化、体育和娱乐业	29,467.00	0.01
S	综合	-	-

合计	190,433,370.40	89.24
----	----------------	-------

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	002865	钧达股份	60,000	11,280,000.00	5.29
2	688063	派能科技	24,090	9,636,000.00	4.52
3	603826	坤彩科技	155,200	9,420,640.00	4.41
4	002459	晶澳科技	134,991	8,644,823.64	4.05
5	688599	天合光能	132,854	8,517,269.94	3.99
6	600522	中天科技	371,400	8,345,358.00	3.91
7	688032	禾迈股份	6,425	7,056,513.25	3.31
8	300593	新雷能	152,900	6,947,776.00	3.26
9	002335	科华数据	152,000	6,414,400.00	3.01
10	002179	中航光电	86,480	5,015,840.00	2.35

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	7,293,415.92	3.42
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	7,293,415.92	3.42

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	7,293,415.92	3.42

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	158,722.01
2	应收证券清算款	2,011,127.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	5,158.29
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,175,007.66

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	260,384,326.58	24,700,420.72
报告期期间基金总申购份额	2,763,243.27	1,935,602.53
减：报告期期间基金总赎回份额	56,227,481.76	6,984,524.68
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	206,920,088.09	19,651,498.57

§ 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 10 月 26 日