

华泰保兴价值成长混合型证券投资基金  
2022年年度报告

2022年12月31日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023年03月25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。本年度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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月22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。

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§ 2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	7
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	10
§ 4	管理人报告 .....	11
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	11
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 .....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
4.9	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 .....	17
§ 5	托管人报告 .....	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	18
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	18
§ 6	审计报告 .....	19
6.1	审计报告基本信息 .....	19
6.2	审计报告的基本内容 .....	19
§ 7	年度财务报表 .....	21
7.1	资产负债表 .....	21
7.2	利润表 .....	22
7.3	净资产（基金净值）变动表 .....	23
7.4	报表附注 .....	24
§ 8	投资组合报告 .....	55
8.1	期末基金资产组合情况 .....	55
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3	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 .....	56
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62

8.6	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 .....	62
8.7	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 .....	62
8.8	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 .....	62
8.9	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 .....	62
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12	投资组合报告附注 .....	62
§ 9	基金份额持有人信息 .....	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
9.3	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 .....	64
§ 10	开放式基金份额变动 .....	65
§ 11	重大事件揭示 .....	66
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	66
11.2	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 .....	66
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
11.4	基金投资策略的改变 .....	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8	其他重大事件 .....	68
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
12.1	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 .....	72
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
§ 13	备查文件目录 .....	73
13.1	备查文件目录 .....	73
13.2	存放地点 .....	73
13.3	查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金	
基金简称	华泰保兴价值成长	
基金主代码	012132	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年11月10日	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	116,731,165.13份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C
下属分级基金的交易代码	012132	012177
报告期末下属分级基金的份额总额	106,713,138.52份	10,018,026.61份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续增长潜力的优质上市公司,在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置和精选个股,力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金坚持“价值与成长并重”的选股理念,采用行业配置和个股精选相结合的方法进行股票投资,对实体经济运行、产业及行业发展趋势、上下游行业运作态势等进行考察,兼顾企业的成长性与投资价值,力争实现基金资产的中长期稳健增值。主要包括:1、行业配置策略;2、个股配置策略;3、债券投资策略;4、股指期货投资策略;5、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中债总指数(全价)收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 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		华泰保兴基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尤小刚	韩鑫普
	联系电话	021-80299000	0755-82943666
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-632-9090	95565
传真		021-60756968	0755-82960794
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道88号3810室	深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址	上海市浦东新区博成路1101号 华泰金融大厦9层	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码	200126	518000
法定代表人	杨平	霍达

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）	南京市建邺区泰山路159号正太中心大厦A座14-16层
注册登记机构	华泰保兴基金管理有限公司	上海市浦东新区博成路1101号华泰金融大厦9层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2022年		2021年	
	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C
本期已实现收益	-21,862,245.80	-6,344,706.33	-1,832,756.13	-1,000,696.71
本期利润	-27,657,520.62	-6,808,292.34	-504,154.37	-162,750.22
加权平均基金份额本期利润	-0.2354	-0.2353	-0.0051	-0.0015
本期加权平均净值利润率	-26.90%	-26.39%	-0.51%	-0.15%
本期基金份额净值增长率	-24.23%	-24.39%	-0.51%	-0.54%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末	
	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C
期末可供分配利润	-26,273,413.67	-2,484,137.28	-1,809,814.33	-963,202.34
期末可供分配基金份额利润	-0.2462	-0.2480	-0.0189	-0.0193
期末基金资产净值	80,439,724.85	7,533,889.33	95,140,755.14	49,756,705.03
期末基金份额净值	0.7538	0.7520	0.9949	0.9946
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末	
	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C
基金份额累计净值增长率	-24.62%	-24.80%	-0.51%	-0.54%

注：1、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。

2、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、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。

#### 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

华泰保兴价值成长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
过去三个月	-6.72%	1.45%	1.41%	1.03%	-8.13%	0.42%
过去六个月	-19.43%	1.55%	-10.90%	0.88%	-8.53%	0.67%
过去一年	-24.23%	1.35%	-17.42%	1.02%	-6.81%	0.33%
自基金合同生效起至今	-24.62%	1.27%	-15.99%	0.98%	-8.63%	0.29%

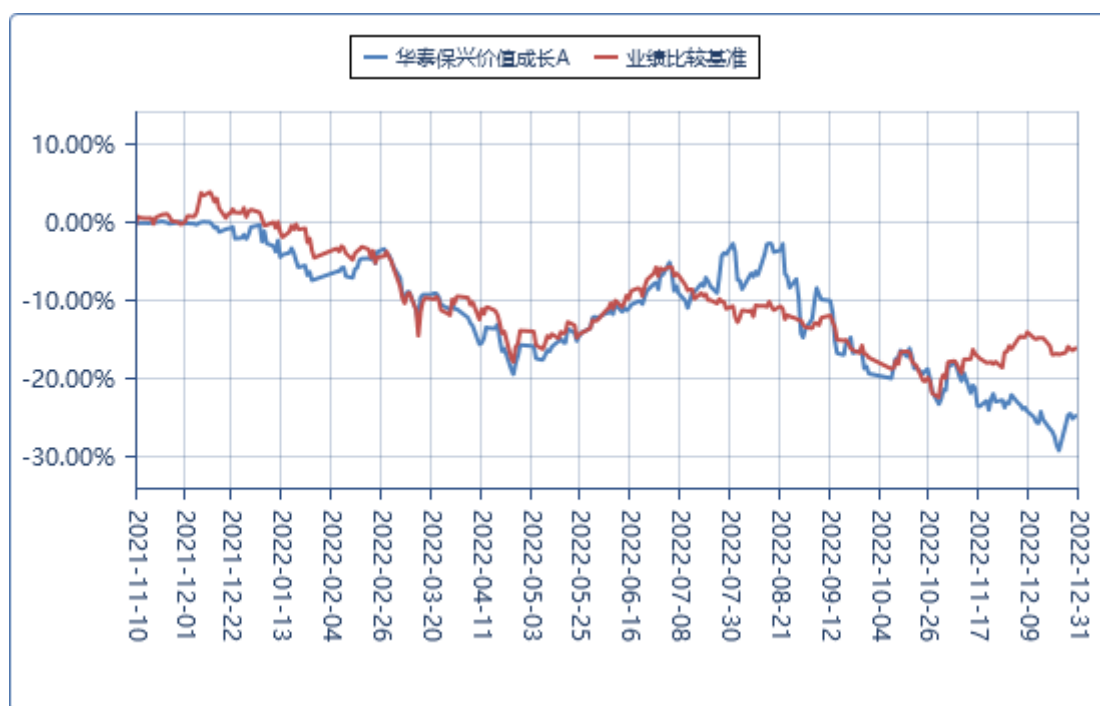
华泰保兴价值成长C

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
过去三个月	-6.77%	1.45%	1.41%	1.03%	-8.18%	0.42%
过去六个月	-19.51%	1.55%	-10.90%	0.88%	-8.61%	0.67%
过去一年	-24.39%	1.35%	-17.42%	1.02%	-6.97%	0.33%
自基金合同生效起至今	-24.80%	1.27%	-15.99%	0.98%	-8.81%	0.29%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*80%+中债总指数（全价）收益率\*20%。

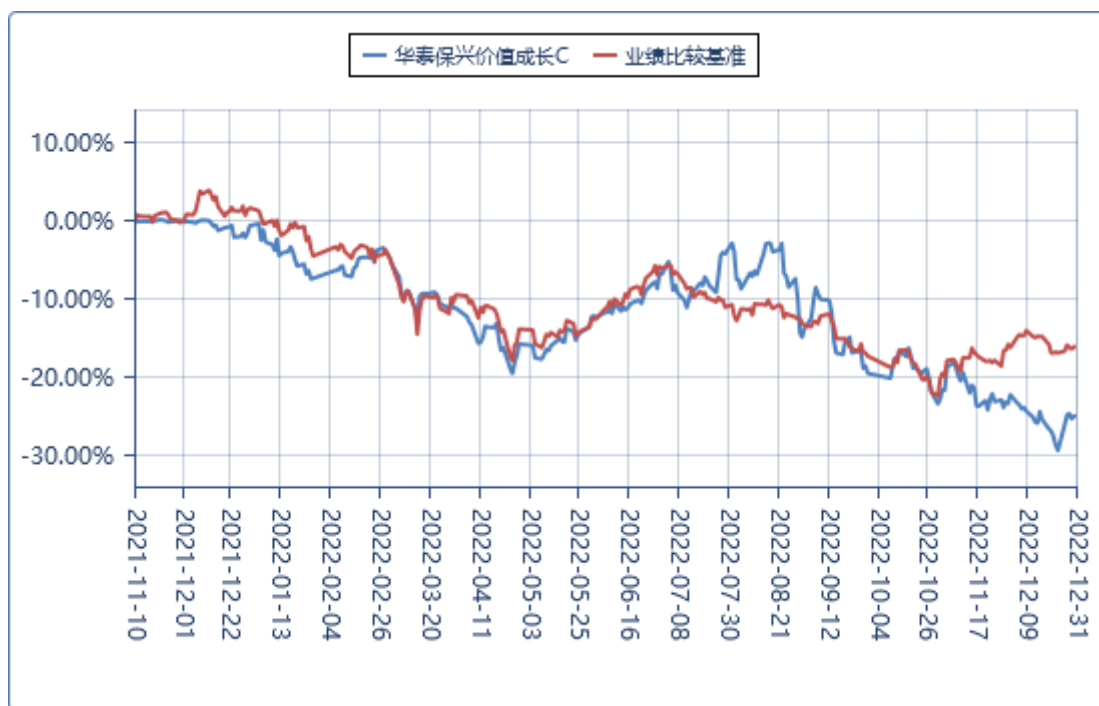
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰保兴价值成长A



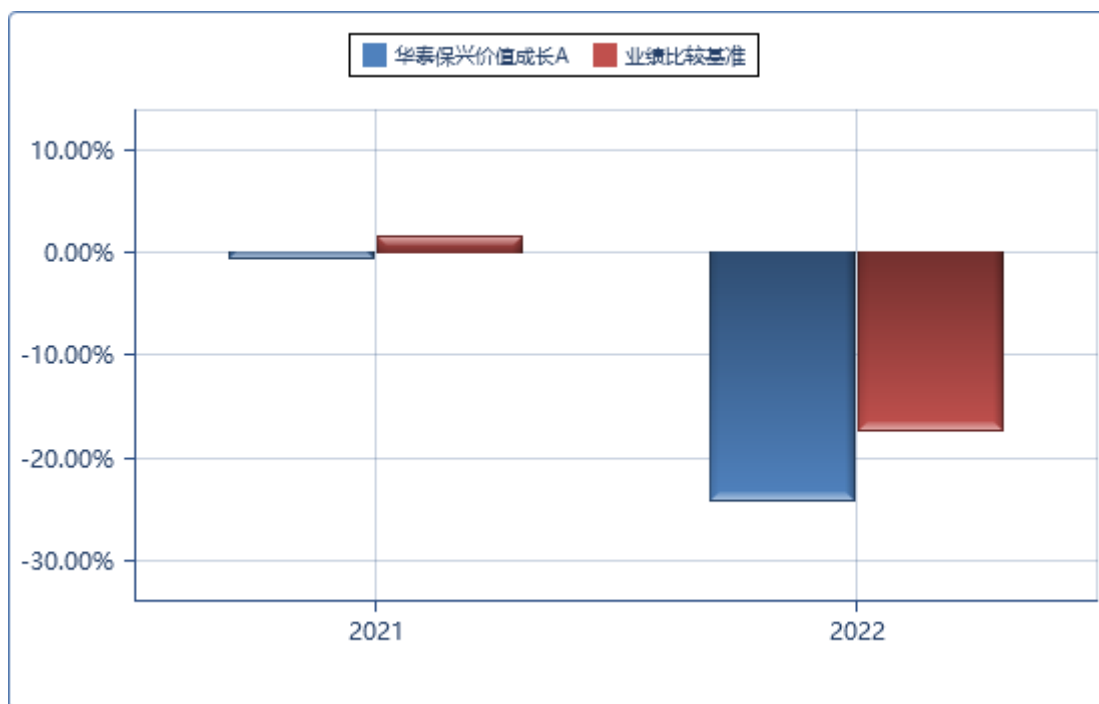


华泰保兴价值成长C

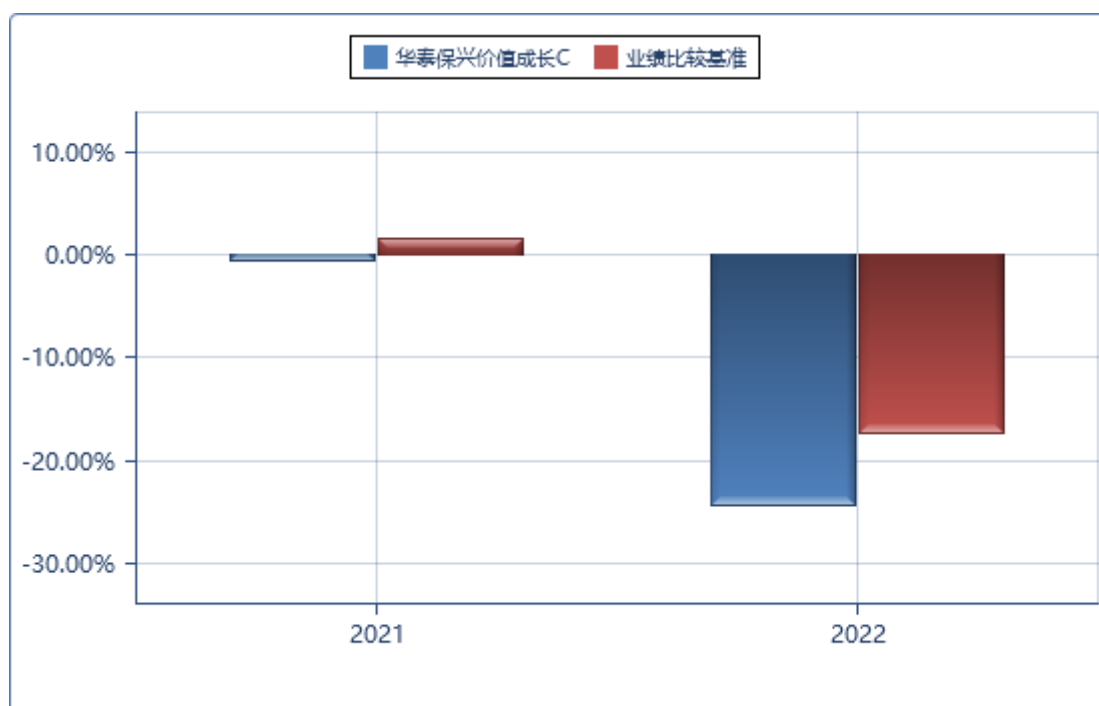


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴价值成长A



华泰保兴价值成长C



注：本基金合同于2021年11月10日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2021年11月10日（基金合同生效日）至2022年12月31日未进行利润分配。

## § 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

华泰保兴基金管理有限公司(以下或简称“公司”或“本公司”)经中国证监会证监许可[2016]1309号文核准,于2016年7月26日成立,公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司(以下简称“华泰保险集团”)、上海飞恒资产管理中心(有限合伙)(以下简称“飞恒资产”)、上海旷正资产管理中心(有限合伙)(以下简称“旷正资产”)、上海泰颐资产管理中心(有限合伙)(以下简称“泰颐资产”)、上海哲昌资产管理中心(有限合伙)(以下简称“哲昌资产”)、上海志庄资产管理中心(有限合伙)(以下简称“志庄资产”)。公司注册资本人民币24,000万元,其中,华泰保险集团持股比例为85%,飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台,合计持股比例为15%。

截至2022年12月31日,公司公开募集证券投资基金资产管理规模为人民币294.84亿元,包括华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金、华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金、华泰保兴货币市场基金、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、华泰保兴成长优选混合型证券投资基金、华泰保兴尊利债券型证券投资基金、华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰保兴健康消费混合型证券投资基金、华泰保兴安悦债券型证券投资基金、华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴科荣混合型证券投资基金、华泰保兴久盈63个月定期开放债券型证券投资基金、华泰保兴恒利中短债债券型证券投资基金、华泰保兴价值成长混合型证券投资基金、华泰保兴吉年盈混合型证券投资基金、华泰保兴鑫成优选混合型证券投资基金等23只产品。

#### 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		

尚烁徽	基金经理、公司总经理助理、权益投资总监、基金中基金（FOF）投资部总经理	2021年11月10日	-	12年	上海交通大学硕士。历任华泰资产管理有限公司权益组合部研究员、投资经理、高级投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间，曾管理华泰人寿保险股份有限公司投连险产品、保险机构相对收益型委托账户、绝对收益型委托账户、组合类保险资产管理产品和企业年金计划等。2016年8月加入华泰保兴基金管理有限公司。
-----	--------------------------------------	-------------	---	-----	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 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投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（证监会公告[2011]18号），公司制定了《华泰保兴基金管理有限公司公平交易制度》，该制度及控制方法适用公司管理所有投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、私募资产管理计划等），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节。

研究分析方面，公司研究部全面负责公司各投资组合投资业务的研究工作，研究部公平地为各投资组合管理部门提供研究服务，其研究报告在不同的投资组合之间均可共享，且在研究报告内容、

质量、数量及提供时间上均保持公平性。公司所有研究报告均在公司内部研究报告系统上统一发布。

授权和投资决策方面，对于证券投资基金业务，分别明确基金投资决策委员会、基金投资部门部门负责人、基金经理的职责和权限划分，并合理确定基金经理的投资权限，基金投资决策委员会、基金投资部门部门负责人等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预。基金经理在授权范围内可以自主决策，但超过投资权限的操作需要经过严格的审批；对于私募资产管理业务，分别明确专户投资决策委员会、专户投资部负责人、投资经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定专户投资部负责人及投资经理的投资权限。专户投资决策委员会和专户投资部负责人等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，但超过投资权限的操作需要经过严格的审批。公司建立严格的投资组合投资信息管理及保密制度。在投资交易管理系统中设置基金经理/投资经理的查询和操作权限，并进行定期检查系统中的权限设置情况，确保不同基金经理/投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。

交易执行方面，公司实行集中交易制度，设立独立交易室，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。所有投资对象的投资指令必须经由交易室负责人或其授权人审核分配至交易员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待，原则上应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成。交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，除需经过公平性审核的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关：（一）对于同一时间段的不同交易价格，投资交易系统对于不同投资组合一律按价格优先的顺序成交；（二）对于同一时间段的相同交易价格，投资交易系统对于不同投资组合自动按比例分配成交量，即按照不同投资组合平均分配的原则。

事后监督，风险管理部负责对不同投资组合公平交易行为进行交易价差等数量化分析，并通过定量分析结果对公平交易的过程、结果实施监督：每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析；每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行1日、3日、5日同向交易价差分析。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以

利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统内的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内，未发现各投资组合因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《异常交易监控与报告制度》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部、不同投资组合之间的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

2022年是基金经理从业13年以来挑战最大的一年。一方面是俄乌冲突叠加各种突发事件对宏观经济和资本市场造成了冲击，另一方面是市场整体运行的规律也出现了非常大的变化。本基金的投资策略以景气度为核心指标，力求找到景气度上行的产业并把握其经营上行阶段带来投资回报甜区。从2022年权益市场最后的表现来看，涨幅前5大行业中仅煤炭为景气、利润向上，其他所有行业均为景气极度受损的行业，包括社服、交运等。从该表象来分析，导致该现象的因素较多，其中比较重要的可能是景气投资方法论拥挤度到了一定的极限，此外量化、绝对收益资金占比和定价权的提升也起到了推波助澜的作用。简单讲，景气度投资更左侧了。因此，我们也会在现有方法论的基础上，针对市场出现的底层变化进行进一步的改造。力求在未来为持有人创造更好的回报。此外，在大类行业上，本基金会更聚焦于碳中和相关的行业，我们长期看好该战略下，国内相关行业的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴价值成长A份额净值为0.7538元，本报告期华泰保兴价值成长A份额净值增长率为-24.23%，同期业绩比较基准收益率为-17.42%；截至本报告期末华泰保兴价值成长C份额净值为0.7520元，本报告期华泰保兴价值成长C份额净值增长率为-24.39%，同期业绩比较基准收益率为-17.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年国内经济整体走出低迷的趋势，呈现较好的复苏场景，但是包括人口和国际局势在内的长期因素没有出现改变，复苏的持续性存疑。房地产市场正常周期在2年左右，2021年下滑至2023年见底，并且由于2022年底交易暂缓，2023年上半年呈现较好的复苏格局，但是一二线能否向下传导也有待观察，尤其是四五线地产以新房为主的背景下。线下消费有望迎来较好的复苏，包括餐饮、旅游等在过去3年被压抑的背景下，都将迎来一定的弹性。

证券市场经历了去年极端的下跌后，释放了绝大部分风险，今年结构性机会大概率远好于去年。大的产业趋势上，我们认为新能源包括光伏、新能源车等主流品种均走到30%渗透率的节点，最舒适的区域已经过了。新能源板块整体机会减少，源于逐步释放的供给和有一定不确定性的需求，其中储能市场尤其是大储市场渗透率仍然在非常早期阶段，存在长期投资机会，其他的投资机会将主要呈现在新能源的新技术和新产品中。传统的逆变器、组件行业，我们认为格局有潜在恶化的趋势，中间可能存在阶段性的投资机会，如硅料快速跌价导致行业需求释放，但在这个过程中更多是反弹为主，相关的辅材格局更稳定，可能具备更好的机会。与之相比，我们看好火电加绿电的公用事业运营商，2022年这些公司基本面相对较差，后面基本面将出现反转。此外，化工白马龙头也具备一定的投资机会，2021年国家启动碳中和战略后，相关公司远期项目受到了一定的影响，经过2年调整，其中部分公司将远期项目调整为新材料相关，我们认为有技术实力的公司将脱颖而出，并在未来2年开花结果。最后，我们认为今年制氢行业有望开启产业化元年。总体看，我们会持续关注低碳、控碳的新技术的研发和产业化进展。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在公司内部监察稽核工作中本着规范运作、防范风险和保护基金份额持有人利益的原则，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司的经营管理、基金的投资运作以及员工行为规范等方面进行日常监控、定期检查和专项检查，及时发现问题并督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报送监管机构。本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、完善规章制度，健全内部控制体系。根据法律法规、监管要求，对公司相关制度的合法性、规范性、有效性进行评估，并根据公司业务发展情况，不断完善内部规章制度，梳理业务流程，确保风险控制有效性，不断提升内部控制水平。

2、加强监察稽核，确保基金运作和公司经营合法合规。通过定期检查和专项检查的方式对公司日常经营活动和基金投资运作进行合规性监控，发现问题及时督促处理，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

3、强化培训教育，提高全员合规意识。积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训，通过法律法规、风险案例学习研讨，合规风控工作简报定期推送，积极培育员工的风险意识、合规意识，规范员工行为操守，提高员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由公司首席财务官和研究部、风险管理部、监察稽核部及运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

研究部负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，对拟采用的估值方法进行初步判断，提出适用的估值模型和参数。风险管理部负责对特殊投资品种的估值方法和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证研究部提供的估值模型参数并协助提供数据支持文件。监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核。运营保障部根据相关法规和公司估值管理办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的固定收益品种/在证券交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。



#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

#### 4.9 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	苏亚审[2023]258号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了华泰保兴价值成长混合型证券投资基金（以下简称“价值成长基金”）财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了价值成长基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于价值成长基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>华泰保兴基金管理有限公司管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括价值成长基金2022年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>



## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰保兴价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	16,361,689.71	53,919,585.75
结算备付金		-	5,939,586.55
存出保证金		-	18,626.98
交易性金融资产	7.4.7.2	72,095,569.70	86,472,022.00
其中：股票投资		72,095,569.70	86,334,022.00
基金投资		-	-
债券投资		-	138,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,381.61	54,450.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	13,590.44
资产总计		88,458,641.02	146,417,862.48
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		178,408.56	1,099,315.98
应付管理人报酬		113,762.31	237,666.87
应付托管费		11,376.22	23,766.69
应付销售服务费		1,469.58	15,170.40
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	7.4.7.6	180,010.17	144,482.37
负债合计		485,026.84	1,520,402.31
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	116,731,165.13	145,653,701.10
未分配利润	7.4.7.8	-28,757,550.95	-756,240.93
净资产合计		87,973,614.18	144,897,460.17
负债和净资产总计		88,458,641.02	146,417,862.48

注：1、报告截止日2022年12月31日，华泰保兴价值成长A基金份额净值0.7538元，基金份额总额106,713,138.52份；华泰保兴价值成长C基金份额净值0.7520元，基金份额总额10,018,026.61份。华泰保兴价值成长份额总额合计为116,731,165.13份。

2、本财务报表的实际编制期间为2022年度，比较财务报表的实际编制期间为2021年11月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰保兴价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日(基 金合同生效日)至 2021年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-32,099,375.52	118,560.66
1. 利息收入		468,529.02	474,029.17
其中：存款利息收入	7.4.7.9	205,654.22	291,819.56
债券利息收入		-	3.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		262,874.80	182,206.59
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-26,334,478.52	-2,546,174.76
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-27,879,919.59	-2,546,174.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	108,625.62	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	1,436,815.45	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-6,258,860.83	2,166,548.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	25,434.81	24,158.00
<b>减：二、营业总支出</b>		2,366,437.44	785,465.25
1. 管理人报酬		1,937,526.68	436,718.25
2. 托管费		193,752.76	43,671.84
3. 销售服务费		52,639.45	30,805.99
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.31	-
8. 其他费用	7.4.7.18	182,518.24	274,269.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-34,465,812.96	-666,904.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-34,465,812.96	-666,904.59
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-34,465,812.96	-666,904.59

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	145,653,701.10	-756,240.93	144,897,460.17
二、本期期初净资产（基金净值）	145,653,701.10	-756,240.93	144,897,460.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,922,535.97	-28,001,310.02	-56,923,845.99
（一）、综合收益总额	-	-34,465,812.96	-34,465,812.96
（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）	-28,922,535.97	6,464,502.94	-22,458,033.03
其中：1. 基金申购款	36,725,096.30	-2,114,934.97	34,610,161.33
2. 基金赎回款	-65,647,632.27	8,579,437.91	-57,068,194.36
（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、本期期末净资产(基金净值)	116,731,165.13	-28,757,550.95	87,973,614.18
项目	上期 2021年11月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	242,101,320.18	-	242,101,320.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-96,447,619.08	-756,240.93	-97,203,860.01
(一)、综合收益总额	-	-666,904.59	-666,904.59
(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)	-96,447,619.08	-89,336.34	-96,536,955.42
其中: 1. 基金申购款	2,907,658.80	-17,487.97	2,890,170.83
2. 基金赎回款	-99,355,277.88	-71,848.37	-99,427,126.25
(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、本期期末净资产(基金净值)	145,653,701.10	-756,240.93	144,897,460.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

王冠龙

陈庆

王云凌

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰保兴价值成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]774号《关于准予华泰保兴价值成长混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰保兴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《华泰保兴价值成长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基金,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242,038,037.64元,业经苏亚金诚会计师事务所(特殊普通合伙)苏亚验[2021]33号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴价值成



长混合型证券投资基金基金合同》于2021年11月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为242,101,320.18份基金份额，其中认购资金利息折合63,282.54份基金份额。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金基金合同》和《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费用的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，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，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分设不同的基金代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴价值成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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他存款）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 $\times$ 80%+中债总指数（全价）收益率 $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰保兴基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 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》《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度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12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2021年11月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：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。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金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。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益默认以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该类基金份额净值自动转为该类基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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，财政部于2022年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14号），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2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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。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。

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对比表如下：

原金融工具准则			新金融工具准则		
列报项目	计量类别	账面价值	列报项目	计量类别	账面价值
银行存款	摊余成本	53,919,585.75	银行存款	摊余成本	53,930,223.85
结算备付金	摊余成本	5,939,586.55	结算备付金	摊余成本	5,942,526.63
存出保证金	摊余成本	18,626.98	存出保证金	摊余成本	18,636.22
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	86,472,022.00	交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	86,472,025.02
衍生金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-	衍生金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-
买入返售金融资产	摊余成本	-	买入返售金融资产	摊余成本	-
应收利息	摊余成本	13,590.44	其他资产-应收利息	摊余成本	-
应收证券清算款	摊余成本	-	应收清算款	摊余成本	-
应收股利	摊余成本	-	应收股利	摊余成本	-
应收申购款	摊余成本	54,450.76	应收申购款	摊余成本	54,450.76
其他资产-其他应收款	摊余成本	-	其他资产-其他应收款	摊余成本	-
交易性金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-	交易性金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-
衍生金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-	衍生金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-
卖出回购金融资产款	摊余成本	-	卖出回购金融资产款	摊余成本	-
应付证券清算款	摊余成本	-	应付清算款	摊余成本	-
应付赎回款	摊余成本	1,099,315.98	应付赎回款	摊余成本	1,099,315.98
应付管理人报酬	摊余成本	237,666.87	应付管理人报酬	摊余成本	237,666.87
应付托管费	摊余成本	23,766.69	应付托管费	摊余成本	23,766.69
应付销售服务费	摊余成本	15,170.40	应付销售服务费	摊余成本	15,170.40
应付利润	摊余成本	-	应付利润	摊余成本	-
应付交易费用	摊余成本	115,648.35	其他负债-应付交易费用	摊余成本	115,648.35
应付利息	摊余成本	-	其他负债-应付利息	摊余成本	-
其他负债-其他应付款	摊余成本	28,834.02	其他负债-其他应付款	摊余成本	28,834.02

于2021年12月31日，本基金持有的“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，本基金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，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	4,831,427.91	8,329,221.40
等于：本金	4,829,106.11	8,329,221.40
加：应计利息	2,321.80	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	11,530,261.80	45,590,364.35
等于：本金	11,529,468.82	45,590,364.35
加：应计利息	792.98	-
合计	16,361,689.71	53,919,585.75

注：其他存款为存放在证券经纪商证券资金账户中用于证券交易结算的资金。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	76,187,882.28	-	72,095,569.70	-4,092,312.58

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	小计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	76,187,882.28	-	72,095,569.70	-4,092,312.58
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	84,167,473.75	-	86,334,022.00	2,166,548.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	138,000.00	138,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	小计	138,000.00	138,000.00	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	84,305,473.75	-	86,472,022.00	2,166,548.25

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日

应收利息	-	13,590.44
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	13,590.44

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10.17	1,352.26
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	115,648.35
其中：交易所市场	-	115,648.35
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	60,000.00	7,481.76
应付信息披露费	120,000.00	20,000.00
合计	180,010.17	144,482.37

#### 7.4.7.7 实收基金

华泰保兴价值成长A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,626,329.79	95,626,329.79
本期申购	36,043,923.47	36,043,923.47
本期赎回（以“-”号填列）	-24,957,114.74	-24,957,114.74
本期末	106,713,138.52	106,713,138.52

华泰保兴价值成长C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,027,371.31	50,027,371.31
本期申购	681,172.83	681,172.83
本期赎回（以“-”号填列）	-40,690,517.53	-40,690,517.53
本期末	10,018,026.61	10,018,026.61

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自2021年9月9日至2021年11月5日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币242,038,037.64元，折算为242,038,037.64份基金份额（其中A类基金份额99,434,348.02份，C类基金份额142,603,689.62份）。根据《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期间内认购资金产生的利息收入人民币63,282.54元在本基金成立后，折算为63,282.54份基金份额（其中A类基金份额34,885.10份，C类基金份额28,397.44份），划入基金份额持有人账户。

3、根据《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金基金合同》《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金招募说明书》及《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于2021年11月10日（基金合同生效日）至2021年12月9日期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换和定期定额投资等业务自2021年12月10日起开始办理。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 华泰保兴价值成长A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,809,814.33	1,324,239.68	-485,574.65
本期利润	-21,862,245.80	-5,795,274.82	-27,657,520.62
本期基金份额交易产生的变动数	1,738,041.48	131,640.12	1,869,681.60
其中：基金申购款	-1,319,498.38	-717,851.66	-2,037,350.04
基金赎回款	3,057,539.86	849,491.78	3,907,031.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,934,018.65	-4,339,395.02	-26,273,413.67

##### 华泰保兴价值成长C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-963,202.34	692,536.06	-270,666.28
本期利润	-6,344,706.33	-463,586.01	-6,808,292.34
本期基金份额交易产生的变动数	5,230,630.13	-635,808.79	4,594,821.34
其中：基金申购款	-64,641.71	-12,943.22	-77,584.93
基金赎回款	5,295,271.84	-622,865.57	4,672,406.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,077,278.54	-406,858.74	-2,484,137.28

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年11月10日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
活期存款利息收入	154,573.21	279,731.87
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	44,329.37	4,032.01
结算备付金利息收入	6,678.64	8,018.43
其他	73.00	37.25
合计	205,654.22	291,819.56

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商证券资金账户中用于证券交易结算的资金产生的利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 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01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
卖出股票成交总额	741,433,545.14	67,883,681.22
减：卖出股票成本总额	767,359,161.80	70,429,855.98
减：交易费用	1,954,302.93	-
买卖股票差价收入	-27,879,919.59	-2,546,174.76

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
债券投资收益—利息收入	226.77	-
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	108,398.85	-
债券投资收益—赎回差价收入	-	-
债券投资收益—申购差价收入	-	-
合计	108,625.62	-

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）
----	-------------------------------	---------------------------------



		至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	645,957.13	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	537,300.00	-
减：应计利息总额	232.43	-
减：交易费用	25.85	-
买卖债券差价收入	108,398.85	-

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,436,815.45	-
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,436,815.45	-

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-6,258,860.83	2,166,548.25
--股票投资	-6,258,860.83	2,166,548.25
--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	-6,258,860.83	2,166,548.25

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）至 2021年12月31日
基金赎回费收入	25,434.81	24,158.00
合计	25,434.81	24,158.00

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）至 2021年12月31日
审计费用	52,518.24	7,481.76
信息披露费	120,000.00	20,000.00
证券出借违约金	-	-
律师费	10,000.00	-
交易费用	-	246,387.41
其他费用	-	400.00
合计	182,518.24	274,269.17

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰保兴基金管理有限公司（“华泰保兴基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
上海旷正资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海志庄资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海飞恒资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海泰颐资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海哲昌资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
华泰保险集团股份有限公司（“华泰保险集团”）	基金管理人的控股股东
华泰人寿保险股份有限公司（“华泰寿险”）	基金管理人控股股东控制的机构

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）至2021年12月31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
招商证券	1,500,813,115.47	100.00%	222,481,010.95	100.00%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）至 2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
招商证券	645,957.13	100.00%	-	-

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）至 2021年12月31日

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	3,134,930,000.00	100.00%	1,973,000,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 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01月01日至2022年12月31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
招商证券	1,092,668.20	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）至2021年12月31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
招商证券	158,813.88	100.00%	115,648.35	100.00%

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合 同生效日）至2021年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,937,526.68	436,718.25
其中：支付销售机构的客户维护费	607,808.69	134,060.65

注：支付基金管理人华泰保兴基金管理有限公司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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合 同生效日）至2021年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	193,752.76	43,671.84

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 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01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C	合计
华泰保兴基金	-	25,170.84	25,170.84
招商证券	-	26,706.18	26,706.18
合计	-	51,877.02	51,877.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C	合计
华泰保兴基金	-	9,838.67	9,838.67
招商证券	-	19,937.95	19,937.95
合计	-	29,776.62	29,776.62

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰保兴基金管理有限公司，再由华泰保兴基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.20%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

华泰保兴价值成长A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月10日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
	基金合同生效日（2021年11月	-

10日)持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	10,005,000.00	-
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	10,005,000.00	-
报告期末持有的基金份额	-	10,005,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.87%

注:1、期间申购/买入总份额含转换入、红利再投、强制调增份额,期间赎回/卖出总份额含转换出、强制调减份额。

2、本基金的基金管理人运用自有资金投资本基金费率按法律文件公布的费率执行。

#### 7.4.10.5.2 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

华泰保兴价值成长A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华泰寿险	30,004,166.66	25.70%	30,004,166.66	20.60%

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金法律文件公布的费率执行。

#### 7.4.10.6 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01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年11月10日(基金合同生效日)至 2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券-托管账户	4,831,427.91	154,573.21	8,329,221.40	279,731.87
招商证券-证券资金户	11,530,261.80	44,329.37	45,590,364.35	4,032.01

注:1、本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

2、本基金证券资金户的存款为存放在证券经纪商招商证券股份有限公司证券资金账户中用于证券交易结算的资金,按协议约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末2022年12月31日本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和

战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，副总经理负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，使得各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

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评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；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的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及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之内。

#### 7.4.13.2 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招商证券股份有限公司，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12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2021年12月31日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.0952%）。



### 7.4.13.3 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，有效保障基金份额持有人利益。

于2022年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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7.4.12。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%。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	16,361,689.71	-	-	-	-	16,361,689.71
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	72,095,569.70	72,095,569.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	1,381.61	1,381.61
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,361,689.71	-	-	-	72,096,951.31	88,458,641.02
负债	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	178,408.56	178,408.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	113,762.31	113,762.31
应付托管费	-	-	-	-	11,376.22	11,376.22
应付销售服务费	-	-	-	-	1,469.58	1,469.58
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	-	-	-	-	180,010.17	180,010.17
负债总计	-	-	-	-	485,026.84	485,026.84
利率敏感度缺口	16,361,689.71	-	-	-	71,611,924.47	87,973,614.18
上年度末 2021年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-
银行存款	53,919,585.75	-	-	-	-	53,919,585.75
结算备付金	5,939,586.55	-	-	-	-	5,939,586.55
存出保证金	18,626.98	-	-	-	-	18,626.98
交易性金融资产	-	138,000.00	-	-	86,334,022.00	86,472,022.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	54,450.76	54,450.76
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	13,590.44	13,590.44
资产总计	59,877,799.28	138,000.00	-	-	86,402,063.20	146,417,862.48
负债	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	1,099,315.98	1,099,315.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	237,666.87	237,666.87
应付托管费	-	-	-	-	23,766.69	23,766.69
应付销售服务费	-	-	-	-	15,170.40	15,170.40
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	144,482.37	144,482.37
负债总计	-	-	-	-	1,520,402.31	1,520,402.31
利率敏感度缺口	59,877,799.28	138,000.00	-	-	84,881,660.89	144,897,460.17

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2021年12月31日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.0952%），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）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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证券投资品种，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投资占基金资产的比例范围为60%-95%。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，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	72,095,569.70	81.95	86,334,022.00	59.58
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	138,000.00	0.10
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	72,095,569.70	81.95	86,472,022.00	59.68

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	2,703,583.86	1,080,900.31
业绩比较基准下降5%	-2,703,583.86	-1,080,900.31	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	72,095,569.70	86,334,022.00
第二层次	-	138,000.00
第三层次	-	-
合计	72,095,569.70	86,472,022.00

#### 7.4.14.2.2 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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期末及上年度末持有的交易性金融资产无属于第三层次公允价值的余额，本报告期内及上年度可比期间亦无第三层次公允价值的变动。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2021年12月31日：同）。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	72,095,569.70	81.50
	其中：股票	72,095,569.70	81.50
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	16,361,689.71	18.50
8	其他各项资产	1,381.61	0.00
9	合计	88,458,641.02	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	-	-
B	采矿业	7,706,256.00	8.76
C	制造业	39,754,744.00	45.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,858,592.00	15.75
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,673,980.00	5.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	861,889.70	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	5,240,108.00	5.96
	合计	72,095,569.70	81.95

### 8.3 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	600603	广汇物流	640,600	5,240,108.00	5.96
2	600027	华电国际	831,200	4,887,456.00	5.56
3	600011	华能国际	627,600	4,776,036.00	5.43
4	300496	中科创达	46,600	4,673,980.00	5.31
5	002897	意华股份	73,700	4,332,823.00	4.93
6	000690	宝新能源	645,400	4,195,100.00	4.77
7	300360	炬华科技	285,900	4,159,845.00	4.73
8	002459	晶澳科技	67,100	4,032,039.00	4.58
9	002850	科达利	30,900	3,671,229.00	4.17
10	000400	许继电气	164,500	3,285,065.00	3.73
11	002472	双环传动	128,200	3,262,690.00	3.71
12	600256	广汇能源	342,200	3,086,644.00	3.51
13	601702	华峰铝业	198,800	2,972,060.00	3.38
14	002270	华明装备	384,500	2,960,650.00	3.37
15	600938	中国海油	172,000	2,614,400.00	2.97
16	605286	同力日升	57,700	2,427,439.00	2.76
17	603989	艾华集团	83,300	2,139,144.00	2.43
18	601088	中国神华	72,600	2,005,212.00	2.28
19	300827	上能电气	31,900	1,876,996.00	2.13
20	300990	同飞股份	17,800	1,635,464.00	1.86
21	002276	万马股份	197,200	1,626,900.00	1.85
22	601126	四方股份	94,000	1,372,400.00	1.56
23	688156	路德环境	28,746	860,942.70	0.98
24	000888	峨眉山A	100	947.00	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	000933	神火股份	21,685,848.00	14.97
2	002493	荣盛石化	18,080,784.00	12.48
3	002472	双环传动	18,039,927.53	12.45



4	600256	广汇能源	17,705,924.20	12.22
5	002897	意华股份	15,608,540.08	10.77
6	002244	滨江集团	15,056,243.45	10.39
7	000983	山西焦煤	14,400,218.14	9.94
8	000069	华侨城A	14,265,698.00	9.85
9	605286	同力日升	14,151,258.02	9.77
10	600522	中天科技	13,583,061.00	9.37
11	600938	中国海油	13,027,909.84	8.99
12	601166	兴业银行	12,927,967.00	8.92
13	601088	中国神华	11,017,819.78	7.60
14	600782	新钢股份	10,996,713.00	7.59
15	300274	阳光电源	10,611,941.00	7.32
16	600546	山煤国际	10,461,532.00	7.22
17	601699	潞安环能	10,300,849.03	7.11
18	603363	傲农生物	10,147,116.12	7.00
19	601702	华峰铝业	9,888,909.00	6.82
20	300841	康华生物	9,811,194.50	6.77
21	601369	陕鼓动力	9,649,435.00	6.66
22	002407	多氟多	9,154,395.65	6.32
23	002850	科达利	8,714,690.48	6.01
24	603799	华友钴业	8,648,776.00	5.97
25	002738	中矿资源	8,625,437.00	5.95
26	600048	保利发展	8,499,843.00	5.87
27	603311	金海高科	8,345,495.00	5.76
28	600603	广汇物流	7,737,956.00	5.34
29	600011	华能国际	7,701,955.00	5.32
30	603816	顾家家居	7,495,350.00	5.17
31	688063	派能科技	7,478,648.14	5.16
32	002920	德赛西威	7,447,161.00	5.14
33	600426	华鲁恒升	7,393,042.00	5.10
34	601117	中国化学	7,376,201.00	5.09
35	688223	晶科能源	7,257,929.68	5.01
36	600497	驰宏锌锗	7,216,144.00	4.98
37	600116	三峡水利	7,117,161.97	4.91
38	002567	唐人神	7,029,630.62	4.85
39	000301	东方盛虹	6,853,481.00	4.73
40	600027	华电国际	6,649,557.00	4.59
41	688348	昱能科技	6,516,941.47	4.50
42	002304	洋河股份	6,445,470.00	4.45
43	300863	卡倍亿	6,431,259.00	4.44
44	603345	安井食品	6,396,021.00	4.41

45	000792	盐湖股份	6,332,380.49	4.37
46	688116	天奈科技	6,307,122.34	4.35
47	002258	利尔化学	6,302,029.00	4.35
48	601225	陕西煤业	6,275,250.00	4.33
49	603833	欧派家居	6,271,420.00	4.33
50	603260	合盛硅业	6,204,806.03	4.28
51	603067	振华股份	6,005,904.00	4.14
52	601998	中信银行	5,805,779.00	4.01
53	300207	欣旺达	5,737,840.00	3.96
54	603501	韦尔股份	5,703,174.00	3.94
55	603606	东方电缆	5,626,851.00	3.88
56	600926	杭州银行	5,549,476.44	3.83
57	002756	永兴材料	5,414,865.00	3.74
58	002415	海康威视	5,384,837.71	3.72
59	300496	中科创达	5,311,180.00	3.67
60	002765	蓝黛科技	5,297,594.00	3.66
61	000963	华东医药	5,262,226.00	3.63
62	300568	星源材质	5,074,930.17	3.50
63	000690	宝新能源	4,978,815.00	3.44
64	300360	炬华科技	4,845,381.00	3.34
65	688667	菱电电控	4,676,577.24	3.23
66	605117	德业股份	4,521,219.80	3.12
67	002459	晶澳科技	4,498,824.00	3.10
68	301071	力量钻石	4,468,371.00	3.08
69	688778	厦钨新能	4,439,342.24	3.06
70	600519	贵州茅台	4,414,511.00	3.05
71	002996	顺博合金	4,369,776.00	3.02
72	002405	四维图新	4,335,878.00	2.99
73	003022	联泓新科	4,284,096.00	2.96
74	603986	兆易创新	4,161,113.77	2.87
75	603507	振江股份	4,111,677.00	2.84
76	300911	亿田智能	4,005,156.00	2.76
77	300122	智飞生物	3,939,152.00	2.72
78	600905	三峡能源	3,931,309.00	2.71
79	603517	绝味食品	3,930,708.00	2.71
80	603259	药明康德	3,914,244.00	2.70
81	300573	兴齐眼药	3,876,345.00	2.68
82	000858	五粮液	3,772,085.00	2.60
83	000002	万科A	3,732,848.00	2.58
84	000400	许继电气	3,715,014.00	2.56
85	300748	金力永磁	3,709,002.00	2.56

86	300896	爱美客	3,664,731.00	2.53
87	600406	国电南瑞	3,570,167.20	2.46
88	600021	上海电力	3,563,198.00	2.46
89	000625	长安汽车	3,528,033.26	2.43
90	600809	山西汾酒	3,501,904.00	2.42
91	300827	上能电气	3,349,183.76	2.31
92	600976	健民集团	3,333,750.99	2.30
93	600863	内蒙华电	3,290,836.00	2.27
94	002324	普利特	3,275,204.48	2.26
95	002120	韵达股份	3,242,986.00	2.24
96	601689	拓普集团	3,221,222.00	2.22
97	603596	伯特利	3,186,697.00	2.20
98	002270	华明装备	3,162,977.00	2.18
99	002545	东方铁塔	3,126,158.00	2.16
100	601001	晋控煤业	2,976,430.00	2.05
101	600176	中国巨石	2,968,026.85	2.05

#### 8.4.2 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	000933	神火股份	23,765,355.90	16.40
2	002472	双环传动	18,612,641.84	12.85
3	600256	广汇能源	15,906,760.80	10.98
4	002493	荣盛石化	15,818,643.00	10.92
5	002244	滨江集团	15,552,018.25	10.73
6	600522	中天科技	14,562,439.60	10.05
7	000983	山西焦煤	14,073,604.47	9.71
8	000069	华侨城A	14,036,478.00	9.69
9	603363	傲农生物	13,482,612.36	9.30
10	601702	华峰铝业	12,999,787.00	8.97
11	601166	兴业银行	12,547,508.00	8.66
12	000792	盐湖股份	12,524,594.00	8.64
13	600116	三峡水利	11,843,060.00	8.17
14	600938	中国海油	10,752,873.00	7.42
15	605286	同力日升	10,438,228.00	7.20
16	601699	潞安环能	10,333,339.42	7.13
17	600782	新钢股份	9,725,450.00	6.71
18	688348	昱能科技	9,615,866.27	6.64
19	600546	山煤国际	9,556,545.00	6.60
20	600976	健民集团	9,397,092.00	6.49
21	300274	阳光电源	9,276,695.00	6.40

22	002897	意华股份	9,179,636.72	6.34
23	601369	陕鼓动力	9,110,950.00	6.29
24	300841	康华生物	9,005,168.50	6.21
25	601088	中国神华	8,848,812.00	6.11
26	601919	中远海控	8,666,384.40	5.98
27	688223	晶科能源	8,561,858.41	5.91
28	603799	华友钴业	8,385,539.36	5.79
29	002466	天齐锂业	8,244,701.00	5.69
30	600048	保利发展	8,228,437.08	5.68
31	603816	顾家家居	7,804,008.10	5.39
32	002407	多氟多	7,737,167.94	5.34
33	603311	金海高科	7,536,639.00	5.20
34	600426	华鲁恒升	7,444,175.00	5.14
35	000733	振华科技	7,407,456.00	5.11
36	000301	东方盛虹	7,192,895.95	4.96
37	603345	安井食品	6,748,940.72	4.66
38	603260	合盛硅业	6,603,019.00	4.56
39	002258	利尔化学	6,545,406.00	4.52
40	603833	欧派家居	6,489,333.00	4.48
41	600497	驰宏锌锗	6,447,863.00	4.45
42	605117	德业股份	6,396,180.00	4.41
43	002567	唐人神	6,391,767.00	4.41
44	002304	洋河股份	6,307,858.00	4.35
45	688116	天奈科技	6,293,575.95	4.34
46	688063	派能科技	6,216,032.52	4.29
47	300863	卡倍亿	6,185,081.00	4.27
48	002920	德赛西威	6,085,073.00	4.20
49	300219	鸿利智汇	6,062,170.00	4.18
50	603067	振华股份	6,037,888.00	4.17
51	002756	永兴材料	6,023,707.00	4.16
52	601117	中国化学	5,961,359.28	4.11
53	002415	海康威视	5,721,884.00	3.95
54	601225	陕西煤业	5,694,517.00	3.93
55	002738	中矿资源	5,675,566.00	3.92
56	300207	欣旺达	5,662,726.00	3.91
57	002765	蓝黛科技	5,534,120.00	3.82
58	601998	中信银行	5,527,446.00	3.81
59	603606	东方电缆	5,418,075.81	3.74
60	600926	杭州银行	5,340,877.00	3.69
61	002270	华明装备	5,339,098.00	3.68
62	000963	华东医药	5,309,005.00	3.66

63	301071	力量钻石	5,077,001.00	3.50
64	300568	星源材质	4,938,489.00	3.41
65	600519	贵州茅台	4,917,575.00	3.39
66	603501	韦尔股份	4,640,807.00	3.20
67	688667	菱电电控	4,495,655.27	3.10
68	002436	兴森科技	4,367,719.00	3.01
69	002405	四维图新	4,302,236.00	2.97
70	603517	绝味食品	4,294,855.05	2.96
71	300737	科顺股份	4,277,464.20	2.95
72	300896	爱美客	4,128,255.40	2.85
73	600905	三峡能源	4,044,861.00	2.79
74	600603	广汇物流	3,872,926.00	2.67
75	603259	药明康德	3,870,856.00	2.67
76	603507	振江股份	3,840,725.00	2.65
77	600809	山西汾酒	3,820,151.00	2.64
78	000858	五粮液	3,748,577.00	2.59
79	603986	兆易创新	3,690,065.90	2.55
80	300748	金力永磁	3,676,776.00	2.54
81	002324	普利特	3,657,151.00	2.52
82	300911	亿田智能	3,634,293.00	2.51
83	600021	上海电力	3,608,286.00	2.49
84	002120	韵达股份	3,564,378.00	2.46
85	000002	万科A	3,562,679.55	2.46
86	003022	联泓新科	3,497,147.00	2.41
87	603596	伯特利	3,454,719.00	2.38
88	600406	国电南瑞	3,451,953.00	2.38
89	002850	科达利	3,279,848.00	2.26
90	002545	东方铁塔	3,234,466.00	2.23
91	002996	顺博合金	3,231,086.00	2.23
92	300122	智飞生物	3,182,314.00	2.20
93	601001	晋控煤业	3,135,053.00	2.16
94	601689	拓普集团	3,063,711.00	2.11
95	603871	嘉友国际	3,038,688.99	2.10
96	000625	长安汽车	2,999,230.54	2.07
97	688778	厦钨新能	2,956,638.25	2.04
98	688680	海优新材	2,911,035.36	2.01

#### 8.4.3 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	759,379,570.33
卖出股票收入（成交）总额	741,433,545.14

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

### 8.12.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 8.12.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,381.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,381.61

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
华泰保兴价值 成长A	1,556	68,581.71	30,203,079.37	28.30%	76,510,059.15	71.70%
华泰保兴价值 成长C	247	40,558.81	-	-	10,018,026.61	100.00%
合计	1,782	65,505.70	30,203,079.37	25.87%	86,528,085.76	74.13%

注：1、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）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 9.2 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	华泰保兴价值成长A	512,813.44	0.48%
	华泰保兴价值成长C	17.93	0.00%
	合计	512,831.37	0.44%

### 9.3 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	华泰保兴价值成长A	10~50
	华泰保兴价值成长C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放 式基金	华泰保兴价值成长A	0
	华泰保兴价值成长C	0
	合计	0



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴价值成长A	华泰保兴价值成长C
基金合同生效日（2021年11月10日）基金份额总额	99,469,233.12	142,632,087.06
本报告期期初基金份额总额	95,626,329.79	50,027,371.31
本报告期基金总申购份额	36,043,923.47	681,172.83
减：本报告期基金总赎回份额	24,957,114.74	40,690,517.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	106,713,138.52	10,018,026.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

自2022年1月25日起，章劲先生不再担任公司副总经理。

自2022年8月15日起，段方晓先生担任公司副总经理。

自2022年11月30日起，陈庆女士担任公司财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告年度本基金应支付审计费人民币52,518.24元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	华泰保兴基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022年07月21日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正（行政监管措施）
受到稽查或处罚等措施的原因	公司在管理某单一资产管理计划过程中，违反了《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第151号）第四十六条第一项规定。

管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	公司已完成整改并于2022年8月10日向中国证监会上海监管局提交了书面报告。截至报告期末,公司私募资产管理业务正常展业经营。
其他	无。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
招商证券	2	1,500,813,115.47	100.00%	1,092,668.20	100.00%	-

注:1、本基金采用券商结算模式。本报告期内基金管理人选择招商证券作为证券经纪机构,使用其交易单元作为本基金的交易单元。其中,股票交易佣金费率为0.8%,债券交易根据债券品种不同及交易市场不同费率区间为0.001%-0.065%,债券回购交易根据回购期限及交易市场不同费率区间为0.001%-0.03%。招商证券与基金管理人之间不存在关联关系。根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》(证监办发(2019)14号)规定,基金管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易,并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金,不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

2、基金管理人选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准如下:

- (1) 资金雄厚,信誉良好。
- (2) 财务状况良好,经营行为规范,最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- (3) 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) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、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。

3、基金管理人选择代理证券买卖的证券经纪机构的程序如下:

基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经纪机构，由基金管理人与基金托管人及证券经纪机构签订本基金的证券经纪服务协议，明确三方在本基金参与场内证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。

### 11.7.2 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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券	1,045,257.13	100.00%	3,134,930,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 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	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年01月05日
2	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年01月06日
3	华泰保兴基金管理有限公司关于提请投资者及时上传身份证件影像的通知	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年01月07日
4	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年01月20日
5	华泰保兴基金管理有限公司关于高级管理人员离任的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年01月27日
6	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济南安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年02月09日
7	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海联泰基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年03月07日
8	华泰保兴基金管理有限公司关于华泰保兴价值成长混合型证券投资基金增加上海好买基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2022年03月10日

9	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加北京中植基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年03月23日
10	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《证券时报》	2022年03月29日
11	华泰保兴基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年03月29日
12	华泰保兴基金管理有限公司关于华泰保兴恒利中短债债券型证券投资基金增加销售机构及开通认/申购、赎回、定投和转换业务并参加费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年03月31日
13	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2022年04月09日
14	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金2022年第1季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年04月22日
15	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金2022年第1季度报告的提示性公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年04月22日
16	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年04月29日
17	华泰保兴基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年05月09日
18	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年05月09日
19	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《证券时报》	2022年06月10日
20	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年06月29日
21	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金2022年第2季度报告的提示性公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年07月21日
22	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金2022年第2季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年07月21日
23	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年07月21日

24	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司银银平台为销售机构及开通认/申购、赎回、定投业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年08月10日
25	华泰保兴基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年08月16日
26	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》	2022年08月22日
27	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金2022年中期报告的提示性公告	管理人网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年08月27日
28	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金2022年中期报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年08月27日
29	华泰保兴基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回及转换转出份额和最低保留余额的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年09月10日
30	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年09月21日
31	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通平台为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》	2022年09月23日
32	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金(A份额)基金产品资料概要更新(2022年第1号)	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、销售机构网站或网点	2022年09月29日
33	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金(C份额)基金产品资料概要更新(2022年第1号)	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、销售机构网站或网点	2022年09月29日
34	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金更新招募说明书(2022年第1号)	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年09月29日
35	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年10月19日
36	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金2022年第3季度报告的提示性公告	管理人网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年10月26日
37	华泰保兴价值成长混合型证券投资基金2022年第3季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年10月26日
38	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构及开通认/申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年11月10日
39	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为销售机构及开通认/	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》	2022年11月26日

	申购、赎回、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》《证券日报》	
40	华泰保兴基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年12月02日
41	华泰保兴基金管理有限公司关于调整旗下基金首次申购、追加申购及定期定额投资最低金额限制的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2022年12月09日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220105, 20220628-20221231	30,004,166.66	-	-	30,004,166.66	25.70%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴价值成长混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

### 13.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站[www.ehuataifund.com](http://www.ehuataifund.com)查阅
- 3、拨打基金管理人客服热线电话400-632-9090（免长途话费）查询

华泰保兴基金管理有限公司  
2023年03月25日