# 华泰柏瑞恒利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：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2022 年 1 月 1 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 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 ..... 9

**§4 管理人报告 ..... 10**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 14
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 ..... 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 17
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 ..... 17**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 17
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 ..... 17
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 ..... 18

**§6 审计报告 ..... 18**

6.1 审计报告基本信息 ..... 18
6.2 审计报告的基本内容 ..... 18

**§7 年度财务报表 ..... 20**

7.1 资产负债表 ..... 20
7.2 利润表 ..... 21
7.3 净资产（基金净值）变动表 ..... 22
7.4 报表附注 ..... 25

**§8 投资组合报告 ..... 62**

8.1 期末基金资产组合情况 ..... 62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 62

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 ..... 63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 68
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 ..... 68
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 ..... 68
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 ..... 68
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 ..... 68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 69
8.12 投资组合报告附注 ..... 69

**§9 基金份额持有人信息 ..... 70**

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 70
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 ..... 70

**§10 开放式基金份额变动 ..... 71**

**§11 重大事件揭示 ..... 71**

11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 71
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 ..... 71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 72
11.4 基金投资策略的改变 ..... 72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 72
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 ..... 72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 72
11.8 其他重大事件 ..... 73

**§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 75**

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 ..... 75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 75

**§13 备查文件目录 ..... 75**

13.1 备查文件目录 ..... 75
13.2 存放地点 ..... 76
13.3 查阅方式 ..... 76

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华泰柏瑞恒利混合 | |
| 基金主代码 | 012953 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 14 日 | |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,061,907,553.28 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞恒利混合 A | 华泰柏瑞恒利混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012953 | 012954 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 563,865,526.48 份 | 498,042,026.80 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活合理配置，追求超越业绩比较基准的投资回报力争金产持续稳健增值。 |
| 投资策略 | 1、大类资产配置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益。2、债券组合投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资业务的投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 上证国债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 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。 |

## 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 | 兴业银行股份有限公司 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘万方 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 021-38601777 | 021-52629999-212056 |
| | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-0001 | 95561 |
| 传真 | | 021-38601799 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | | 200135 | 200120 |
| 法定代表人 | | 贾波 | 吕家进 |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 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 9 月 14 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 华泰柏瑞恒利混合 A | 华泰柏瑞恒利混合 C | 华泰柏瑞恒利混合 A | 华泰柏瑞恒利混合 C |
| 本期已实现收益 | 29,701,376.22 | 22,082,127.30 | 5,193,509.33 | 1,819,482.31 |
| 本期利润 | 26,018,594.14 | 13,817,919.65 | 8,849,604.23 | 2,676,196.74 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0380 | 0.0356 | 0.0147 | 0.0129 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.70% | 3.43% | 1.48% | 1.30% |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.00% | 3.79% | 0.67% | 0.61% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末 | | 2021 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 26,500,684.16 | 22,013,561.44 | 5,287,102.84 | 802,970.67 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0470 | 0.0442 | 0.0067 | 0.0061 |
| 期末基金资产净值 | 590,366,210.64 | 520,055,588.24 | 792,221,633.39 | 132,724,808.84 |
| 期末基金份额净值 | 1.0470 | 1.0442 | 1.0067 | 1.0061 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022 年末 | | 2021 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 4.70% | 4.42% | 0.67% | 0.61% |

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

华泰柏瑞恒利混合 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.30% | 0.19% | 1.37% | 0.27% | -1.67% | -0.08% |
| 过去六个月 | 1.55% | 0.19% | -1.07% | 0.23% | 2.62% | -0.04% |
| 过去一年 | 4.00% | 0.26% | -0.94% | 0.27% | 4.94% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.70% | 0.26% | -0.71% | 0.25% | 5.41% | 0.01% |

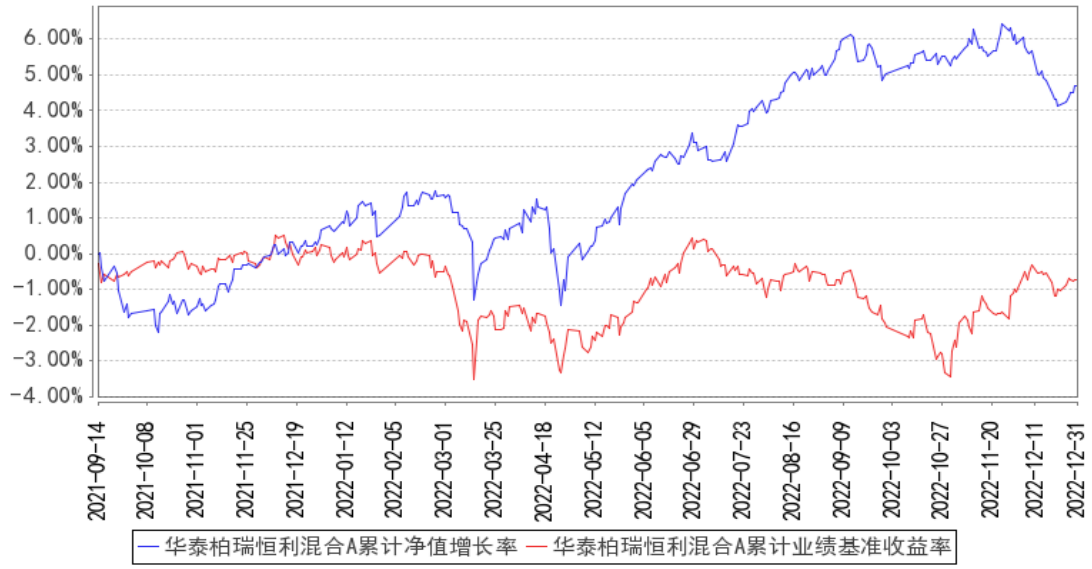
华泰柏瑞恒利混合 C

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|

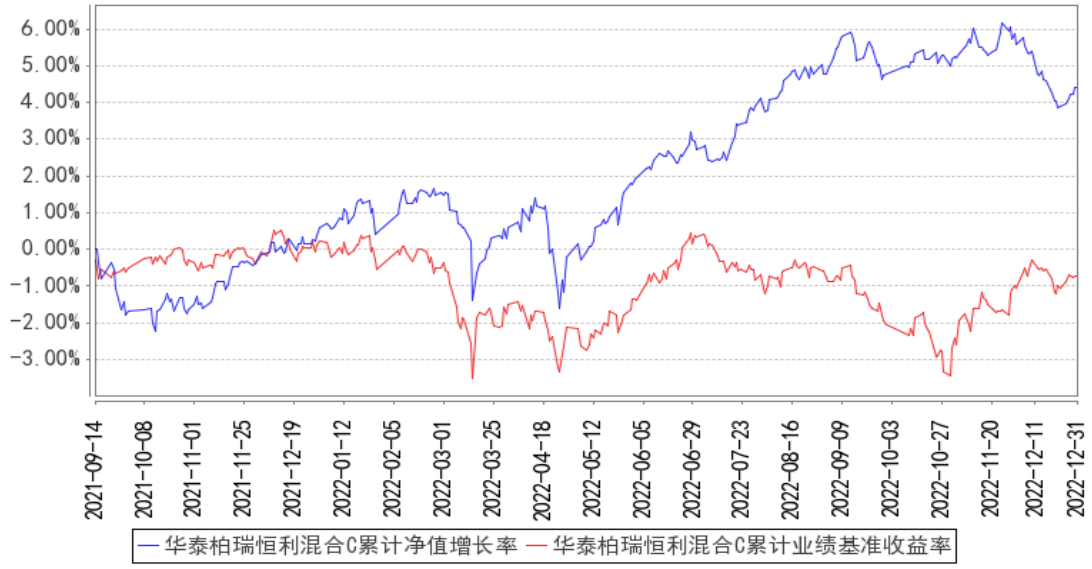
| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.35% | 0.19% | 1.37% | 0.27% | -1.72% | -0.08% |
| 过去六个月 | 1.45% | 0.19% | -1.07% | 0.23% | 2.52% | -0.04% |
| 过去一年 | 3.79% | 0.26% | -0.94% | 0.27% | 4.73% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.42% | 0.25% | -0.71% | 0.25% | 5.13% | 0.00% |

### 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

**华泰柏瑞恒利混合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**




**华泰柏瑞恒利混合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**

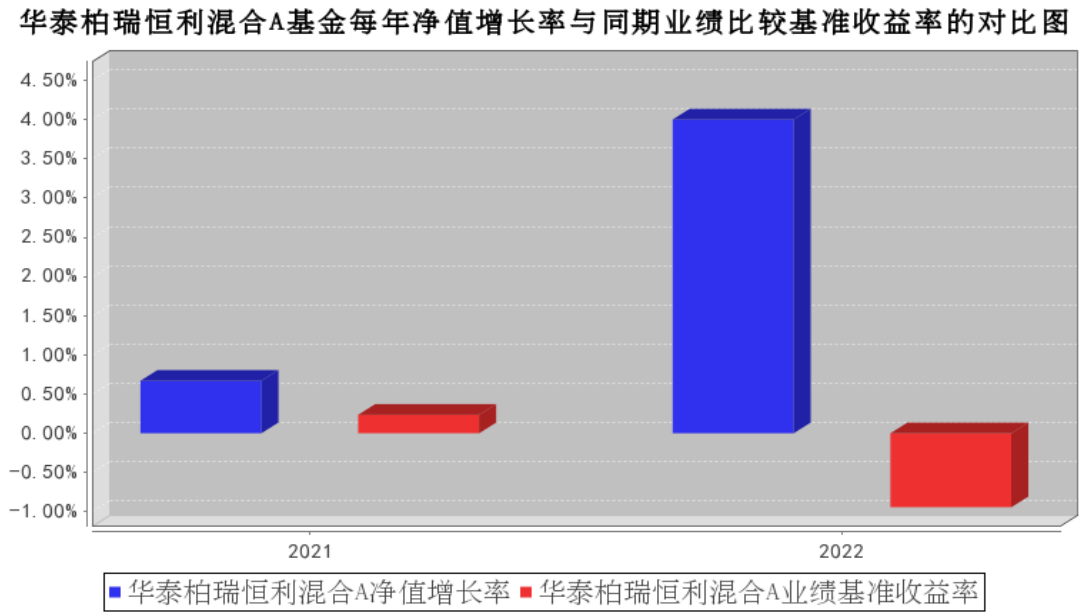


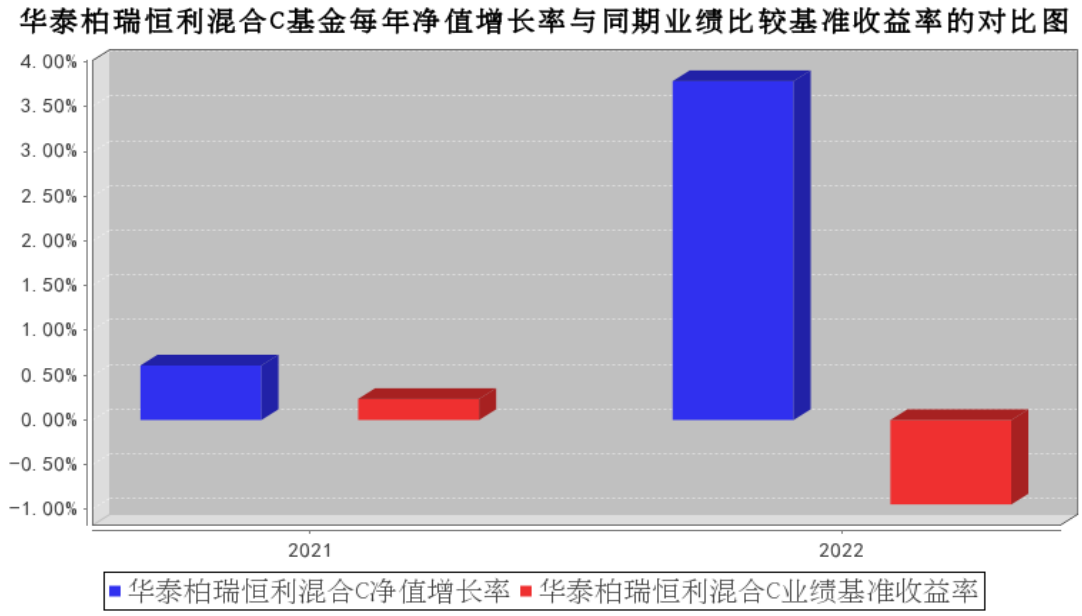

注：1、A 类和 C 类图示日期均为 2021 年 9 月 14 日至 2022 年 12 月 31 日。

2、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。

### 3.2.3 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




注：本基金成立于 2021 年 9 月 14 日。2021 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金报告期末A类可供分配利润为26,500,684.16元，C类为22,013,561.44元。本基金未实施过利润分配。

# §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

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、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、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、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联接基金(QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）。截至 2022 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 3,091.70 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 | | |
| 王林军 | 本基金的基金经理助理 | 2022 年 11 月 8 日 | - | 5 年 | 清华大学电气工程专业硕士。2017 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2021 年 12 月起任基金经理助理。 |
| 何子建 | 固定收益部副总监、本基金的基金经理 | 2021 年 9 月 14 日 | - | 8 年 | 工商管理硕士，经济学学士。2014 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员、基金经理助理。2019 年 3 月起任华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起任华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月起任华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 1 月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月起任华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 董辰 | 投资二部副总监、本基金的基金经理 | 2021 年 9 月 14 日 | - | 9 年 | 上海理工大学金融学硕士，曾任长江证券首席分析师，2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任投资研究部高级研究员、研究总监助理兼基金经理助理。2020 年 7 月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞多策略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的基金经理。2021 年 6 月至 2022 年 10 月任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月起任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 谭笑 | 研究部副总监、本基金的基金经理助理 | 2022 年 11 月 8 日 | - | 8 年 | 山东大学金融学硕士。2014 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任研究部副总监兼基金经理助理。 |

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估， 同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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。

本报告期内，本基金与公司所管理的其他投资组合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%的同日反向交易共 2 次，系与被动跟踪指数的产品发生反向交易，不存在利益输送行为。

## 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

固收方面，2022 年，债券市场呈现宽幅震荡格局。这一年，全球经济发展面对非常复杂的局

面。发达经济体面对本世纪以来最严重的通胀，连续不断收紧货币政策。此外，俄乌冲突持续不断，欧元区面临严重能源短缺问题，造成价格高企。新冠疫情持续蔓延，导致经济活动普遍放缓，金融市场大幅震荡。同时国内疫情多点散发，消费抑制明显，房地产行业持续下行，增大地方财政压力。断贷风波、村镇银行风险、互联网行业减员等多重超预期因素影响下，经济形势也面临较大挑战。

一季度，年初资金面总体宽松，“降息”预期一致，推动收益率曲线下行。而后两会经济增长目标设置偏积极，“宽信用”预期升温，利率出现回升。进入二季度，随着俄乌冲突升级，以及国内金融数据转弱，上海等地疫情暴发，资金面维持宽松，利率下行。三季度，疫情反复、断贷风波和村镇银行风险事件加剧了经济复苏的不确定性，资金面宽松预期增强，利率持续震荡下行。四季度，疫情防控二十条、支持地产十六条等政策出台，在岸人民币贬值，债市急速回调并引发债基、银行理财产品因净值波动赎回负反馈，十年期国开、国债一度上行超 20BPS，短债利率上行更加剧烈。随后在资金面、政策面呵护下，市场情绪逐渐平复。

目前曲线回升至合理水平，配置性价比逐渐提升。随着发展新局面形成，疫情在 2023 年春节前陆续达峰，在此之后，国内消费、服务业的复苏进度以及地产需求侧回暖情况将是市场重要的影响因素。

权益方面，2022 年 A 股受美联储加息、新冠疫情、房地产市场疲弱等因素的整体影响表现不佳。

### 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恒利混合 A 的基金份额净值为 1.0470 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.00%，同期业绩比较基准收益率为-0.94%，截至本报告期末华泰柏瑞恒利混合 C 的基金份额净值为 1.0442 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.79%，同期业绩比较基准收益率为-0.94%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固收方面，展望 2023 年，将持续关注银行间体系流动性的变化和经济增长总需求实际变化。在预期与现实的博弈中调整配置。债市收益率或将继续呈现震荡格局。

策略上，维持适当的久期与适中的杠杆水平，努力规避信用风险，同时把握时机力争博取资本利得。

权益方面，展望后市，一些压制因素或出现积极变化，美联储加息周期接近尾声，疫情影响逐渐消散，房地产托底政策不断出台，A 股有望走出阴霾。

结构来看，贵金属在美联储货币政策周期转向、海外衰退压力不断加大的环境下或仍有较多机会。地产板块政策周期目前向上，龙头集中度提升的演绎或仍在继续。随着经济复苏，工业品

景气改善也值得重点关注。成长方面，大制造、医药、军工、计算机等行业可能仍有较多自下而上的选股机会。

本基金将继续在公司质量、景气度和成长空间三个维度精选个股，尽力控制回撤，争取获取超额收益。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1)全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法

合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按照除权除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

注：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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的

监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内未做利润分配。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 | 普华永道中天审字(2023)第 24646 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 | 华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | (一)我们审计的内容<br>我们审计了华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞恒利混合基金”)的财务报表，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)变动表以及财务报表附注。<br>(二)我们的意见<br>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在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，公允反映了华泰柏瑞恒利混合基金 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。 |
| 形成审计意见的基础 | 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。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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞恒利混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | - |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 华泰柏瑞恒利混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)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。<br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞恒利混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞恒利混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞恒利混合基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。<br>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞恒利混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞恒利混合基金不能持续经营。<br>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |

| | | |
|---|---|---|
| 注册会计师的姓名 | 朱宏宇 | 朱寅婷 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 | |
| 审计报告日期 | 2023 年 3 月 28 日 | |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞恒利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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 6,087,451.56 | 4,723,299.06 |
| 结算备付金 | | 517,966.14 | 719,334.91 |
| 存出保证金 | | 105,860.48 | 103,292.39 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,325,412,333.99 | 1,021,600,311.63 |
| 其中：股票投资 | | 206,262,510.98 | 177,386,311.63 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,119,149,823.01 | 844,214,000.00 |
| 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 | - | 119,000,392.50 |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 7.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | 1,044,174.04 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 32,689.75 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | 8,815,978.60 |
| 资产总计 | | 1,332,156,301.92 | 1,156,006,783.13 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2022 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 220,090,198.97 | 219,999,070.00 |
| 应付清算款 | | 490,565.48 | - |
| 应付赎回款 | | 3,879.10 | 10,038,903.42 |
| 应付管理人报酬 | | 594,722.67 | 440,839.16 |
| 应付托管费 | | 99,120.46 | 73,473.18 |
| 应付销售服务费 | | 90,242.08 | 27,952.63 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 6,534.30 | 6,430.08 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 359,239.98 | 473,672.43 |
| 负债合计 | | 221,734,503.04 | 231,060,340.90 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 1,061,907,553.28 | 918,856,368.72 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | 48,514,245.60 | 6,090,073.51 |
| 净资产合计 | | 1,110,421,798.88 | 924,946,442.23 |
| 负债和净资产总计 | | 1,332,156,301.92 | 1,156,006,783.13 |

注： 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,061,907,553.28 份，其中 A 类基金份额净值 1.0470 元，A 类基金份额 563,865,526.48 份；C 类基金份额净值 1.0442 元，C 类基金份额 498,042,026.80 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 52,407,448.73 | 14,781,322.95 |
| 1.利息收入 | | 164,372.52 | 5,867,377.94 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 80,425.40 | 59,068.19 |
| 债券利息收入 | | - | 5,294,774.56 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 83,947.12 | 513,535.19 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 63,795,081.39 | 4,155,482.08 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | 34,707,920.64 | 5,813,479.78 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.15 | 26,649,884.76 | -1,693,761.70 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.18 | -318,163.16 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.19 | 2,755,439.15 | 35,764.00 |
| 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） | 7.4.7.20 | -11,946,989.73 | 4,512,809.33 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.21 | 394,984.55 | 245,653.60 |
| **减：二、营业总支出** | | 12,570,934.94 | 3,255,521.98 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 6,621,799.78 | 1,415,765.51 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 1,103,633.31 | 235,960.91 |
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 790,453.59 | 121,169.76 |
| 4．投资顾问费 | | - | - |
| 5．利息支出 | | 3,769,161.65 | 638,782.66 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,769,161.65 | 638,782.66 |
| 6．信用减值损失 | 7.4.7.22 | - | - |
| 7．税金及附加 | | 11,346.55 | 1,694.56 |
| 8．其他费用 | 7.4.7.23 | 274,540.06 | 842,148.58 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 39,836,513.79 | 11,525,800.97 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 39,836,513.79 | 11,525,800.97 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 39,836,513.79 | 11,525,800.97 |

## 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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） | 918,856,368.72 | - | 6,090,073.51 | 924,946,442.23 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 918,856,368.72 | - | 6,090,073.51 | 924,946,442.23 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 143,051,184.56 | - | 42,424,172.09 | 185,475,356.65 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 39,836,513.79 | 39,836,513.79 |
| （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） | 143,051,184.56 | - | 2,587,658.30 | 145,638,842.86 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,101,248,359.04 | - | 32,816,260.73 | 1,134,064,619.77 |
| 2.基金赎回款 | -958,197,174.48 | - | -30,228,602.43 | -988,425,776.91 |
| （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、本期期末净资产（基金净值） | 1,061,907,553.28 | - | 48,514,245.60 | 1,110,421,798.88 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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) | - | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 240,023,948.90 | - | - | 240,023,948.90 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 678,832,419.82 | - | 6,090,073.51 | 684,922,493.33 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 11,525,800.97 | 11,525,800.97 |
| (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) | 678,832,419.82 | - | -5,435,727.46 | 673,396,692.36 |
| 其中：1.基金申购款 | 920,047,186.21 | - | -4,946,990.55 | 915,100,195.66 |
| 2.基金赎回款 | -241,214,766.39 | - | -488,736.91 | -241,703,503.30 |
| (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、本期期末净资产(基金净值) | 918,856,368.72 | - | 6,090,073.51 | 924,946,442.23 |

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：

| | | |
|---|---|---|
| 韩勇 | 房伟力 | 赵景云 |
| 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

华泰柏瑞恒利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]2247 号《关于准予华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 240,004,598.81 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0910 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 240,023,948.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,350.09 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。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，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞恒利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，包括国内依法发行或上市的股票(包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、存托凭证、债券(包含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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相关规定)。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0%-30%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资

产净值的 5%。本基金投资同业存单的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为上证国债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%。

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 2023 年 3 月 28 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》、《 华泰柏瑞恒利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 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

### 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

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。

### 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

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。

### 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、资产支持证券投资和衍生工具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基金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基金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

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扣除按票面利率(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后的净额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及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分红除权日的基金份额净值自动转为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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

### 7.4.4.13 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。

### 7.4.4.14 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

票投资和债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 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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。

(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、买入返售金融资产、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 4,723,299.06 元、719,334.91 元、103,292.39 元、119,000,392.50 元、8,815,978.60 元和 1,044,174.04 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、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 4,725,137.86 元、719,690.98 元、103,343.54 元、119,006,814.93 元、0.00 元和 1,044,174.04 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 1,021,600,311.63 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 1,030,407,621.78 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 219,999,070.00 元、10,038,903.42 元、440,839.16 元、73,473.18 元、27,952.63 元、268,317.81 元和 105,354.62 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、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-应付利息，金额分别为 220,104,424.62 元、10,038,903.42 元、440,839.16 元、73,473.18 元、27,952.63 元、268,317.81 元和 0.00 元。

(ii) 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) 《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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 6,087,451.56 | 4,723,299.06 |
| 等于：本金 | 6,086,743.84 | 4,723,299.06 |
| 加：应计利息 | 707.72 | - |
| 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 | 6,087,451.56 | 4,723,299.06 |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 209,105,057.76 | - | 206,262,510.98 | -2,842,546.78 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 1,113,340,633.62 | 10,400,823.01 | 1,119,149,823.01 | -4,591,633.62 |
| | 合计 | 1,113,340,633.62 | 10,400,823.01 | 1,119,149,823.01 | -4,591,633.62 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,322,445,691.38 | 10,400,823.01 | 1,325,412,333.99 | -7,434,180.40 |
| 项目 | | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 | | | |
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 176,252,361.36 | - | 177,386,311.63 | 1,133,950.27 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 49,921,000.00 | - | 49,970,000.00 | 49,000.00 |
| | 银行间市场 | 790,914,140.94 | - | 794,244,000.00 | 3,329,859.06 |
| | 合计 | 840,835,140.94 | - | 844,214,000.00 | 3,378,859.06 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,017,087,502.30 | - | 1,021,600,311.63 | 4,512,809.33 |

### 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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | - | - |
| 项目 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 119,000,392.50 | - |
| 合计 | 119,000,392.50 | - |

#### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

| |
|---|
| 注：无。 |

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 7.4.7.7 其他权益工具投资

#### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应收利息 | - | 8,815,978.60 |
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | - | 8,815,978.60 |

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 0.01 | - |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 149,239.97 | 268,317.81 |
| 其中：交易所市场 | 131,442.96 | 238,469.33 |
| 银行间市场 | 17,797.01 | 29,848.48 |
| 应付利息 | - | 105,354.62 |
| 预提费用 | 210,000.00 | 100,000.00 |
| 合计 | 359,239.98 | 473,672.43 |

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞恒利混合 A

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 786,934,530.55 | 786,934,530.55 |
| 本期申购 | 371,919,381.36 | 371,919,381.36 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -594,988,385.43 | -594,988,385.43 |
| 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 | 563,865,526.48 | 563,865,526.48 |

华泰柏瑞恒利混合 C

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 131,921,838.17 | 131,921,838.17 |
| 本期申购 | 729,328,977.68 | 729,328,977.68 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -363,208,789.05 | -363,208,789.05 |

| | | |
|---|---|---|
| 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 | 498,042,026.80 | 498,042,026.80 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未持有其他综合收益。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞恒利混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 本期期初 | 5,916,178.92 | -629,076.08 | 5,287,102.84 |
| 本期利润 | 29,701,376.22 | -3,682,782.08 | 26,018,594.14 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,419,104.95 | -385,907.87 | -4,805,012.82 |
| 其中：基金申购款 | 13,524,282.26 | 2,582,539.85 | 16,106,822.11 |
| 基金赎回款 | -17,943,387.21 | -2,968,447.72 | -20,911,834.93 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 31,198,450.19 | -4,697,766.03 | 26,500,684.16 |

华泰柏瑞恒利混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 本期期初 | 909,042.02 | -106,071.35 | 802,970.67 |
| 本期利润 | 22,082,127.30 | -8,264,207.65 | 13,817,919.65 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,161,312.96 | 4,231,358.16 | 7,392,671.12 |
| 其中：基金申购款 | 12,971,423.51 | 3,738,015.11 | 16,709,438.62 |
| 基金赎回款 | -9,810,110.55 | 493,343.05 | -9,316,767.50 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 26,152,482.28 | -4,138,920.84 | 22,013,561.44 |

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 42,299.99 | 41,096.81 |
| 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 | 36,243.21 | 17,664.37 |
| 其他 | 1,882.20 | 307.01 |

| | | |
|---|---|---|
| 合计 | 80,425.40 | 59,068.19 |

## 7.4.7.14 股票投资收益

### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 34,707,920.64 | 5,813,479.78 |
| 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 | 34,707,920.64 | 5,813,479.78 |

### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 659,575,834.42 | 273,594,198.12 |
| 减：卖出股票成本总额 | 623,326,290.33 | 267,780,718.34 |
| 减：交易费用 | 1,541,623.45 | - |
| 买卖股票差价收入 | 34,707,920.64 | 5,813,479.78 |

### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

## 7.4.7.15 债券投资收益

### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年9月14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 | 29,495,976.09 | - |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -2,846,091.33 | -1,693,761.70 |
| 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 | 26,649,884.76 | -1,693,761.70 |

### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年9月14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 | 2,813,900,584.65 | 1,653,184,081.20 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,793,095,606.91 | 1,649,369,512.13 |
| 减：应计利息总额 | 23,621,058.02 | 5,508,330.77 |
| 减：交易费用 | 30,011.05 | - |
| 买卖债券差价收入 | -2,846,091.33 | -1,693,761.70 |

### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无债券赎回差价收入。

### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无债券申购差价收入。

### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.17 贵金属投资收益

#### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

### 7.4.7.18 衍生工具收益

#### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>收益金额<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股指期货投资收益 | -318,163.16 | - |

### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 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 | 2,755,439.15 | 35,764.00 |
| 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 | 2,755,439.15 | 35,764.00 |

### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -11,946,989.73 | 4,512,809.33 |

| | | |
|---|---|---|
| 股票投资 | -3,976,497.05 | 1,133,950.27 |
| 债券投资 | -7,970,492.68 | 3,378,859.06 |
| 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 | -11,946,989.73 | 4,512,809.33 |

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 394,444.56 | 245,653.60 |
| 基金转换费收入 | 539.99 | - |
| 合计 | 394,984.55 | 245,653.60 |

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 50%归入基金资产。C 类基金份额的赎回费全额归入基金资产。

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 50%归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

## 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 90,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 40,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 其他费用 | 400.00 | - |
| 银行间账户服务费 | 37,200.00 | - |
| 银行划款手续费 | 26,940.06 | 4,393.44 |
| 交易费用 | - | 737,755.14 |
| 合计 | 274,540.06 | 842,148.58 |

## 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 |
| 兴业银行股份有限公司(“兴业银行”) | 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 |
| 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 |
| PineBridge Investment LLC | 基金管理人的股东 |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2021年9月14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（%） |
| 华泰证券 | 570,882,600.40 | 44.65 | 288,169,382.90 | 40.74 |

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1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（%） |
| 华泰证券 | 523,777.81 | 77.79 | 104,116.30 | 79.21 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年9月14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（%） |
|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | 262,610.99 | 74.78 | 175,699.58 | 73.68 |

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 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 | 6,621,799.78 | 1,415,765.51 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 290,058.88 | 27,891.56 |

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 0.60%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×0.60%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 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 | 1,103,633.31 | 235,960.91 |

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华泰柏瑞恒利混合 A | 华泰柏瑞恒利混合 C | 合计 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 兴业银行股份有限公司 | 0.00 | 74.18 | 74.18 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 0.00 | 700,019.87 | 700,019.87 |
| 合计 | 0.00 | 700,094.05 | 700,094.05 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 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 | | |
| | 华泰柏瑞恒利混合 A | 华泰柏瑞恒利混合 C | 合计 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 0.00 | 104,506.70 | 104,506.70 |
| 合计 | 0.00 | 104,506.70 | 104,506.70 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰柏瑞基金，再由华泰柏瑞基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 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

单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | 855,805,122.06 | - | - | - | 3,149,000,000.00 | 1,009,887.25 |
| 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | - | - | - | - | - | - |

### 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

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

### 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

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

#### 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

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2021年9月14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 |
| 兴业银行 | 6,087,451.56 | 42,299.99 | 4,723,299.06 | 41,096.81 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张 ） | 总金额 |
| 华泰联合证券 | 301327 | 华宝新能 | 网下申购 | 2,417 | 574,037.50 |
| 华泰联合证券 | 688353 | 华盛锂电 | 网下申购 | 4,358 | 428,609.30 |
| 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 | 688046 | 药康生物 | 网下申购 | 12,070 | 271,937.10 |
| 华泰联合证券 | 113650 | 博 22 转债 | 网上配售 | 2,270 | 227,000.00 |
| 华泰联合证券 | 688351 | 微电生理 | 网下申购 | 10,946 | 180,718.46 |
| 华泰联合证券 | 301339 | 通行宝 | 网下申购 | 9,127 | 171,405.06 |
| 华泰联合证券 | 688209 | 英集芯 | 网下申购 | 6,822 | 165,297.06 |
| 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 | 301290 | 东星医疗 | 网下申购 | 3,291 | 145,100.19 |
| 华泰联合证券 | 301153 | 中科江南 | 网下申购 | 3,973 | 133,810.64 |
| 华泰联合证券 | 301160 | 翔楼新材 | 网下申购 | 3,918 | 123,652.08 |
| 华泰联合证券 | 301277 | 新天地 | 网下申购 | 4,384 | 118,368.00 |
| 华泰联合证券 | 688420 | 美腾科技 | 网下申购 | 2,408 | 117,895.68 |
| 华泰联合证券 | 688253 | 英诺特 | 网下申购 | 4,364 | 113,725.84 |
| 华泰联合证券 | 301298 | 东利机械 | 网下申购 | 6,340 | 80,391.20 |
| 华泰联合证券 | 301316 | 慧博云通 | 网下申购 | 3,584 | 27,238.40 |
| 华泰联合证券 | 001258 | 立新能源 | 网下申购 | 3,188 | 10,775.44 |
| 华泰联合证券 | 001231 | 农心科技 | 网下申购 | 355 | 6,308.35 |

| 上年度可比期间<br>2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张 ） | 总金额 |
| 华泰联合证券 | 301155 | 海力风电 | 网下申购 | 7,900 | 479,214.00 |
| 华泰联合证券 | 688192 | 迪哲医药 | 网下申购 | 8,368 | 439,989.44 |
| 华泰联合证券 | 688151 | 华强科技 | 网下申购 | 11,259 | 395,078.31 |
| 华泰联合证券 | 688105 | 诺唯赞 | 网下申购 | 4,998 | 274,890.00 |
| 华泰联合证券 | 301179 | 泽宇智能 | 网下申购 | 2,941 | 129,374.59 |
| 华泰联合证券 | 688236 | 春立医疗 | 网下申购 | 4,052 | 120,790.12 |
| 华泰联合证券 | 001234 | 泰慕士 | 网下申购 | 333 | 5,504.49 |

### 7.4.10.8 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其他需要说明的关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

注：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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 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 |
| 301139 | 元道通信 | 2022 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 38.46 | 25.31 | 566 | 21,768.36 | 14,325.46 | - |
| 301161 | 唯万密封 | 2022 年 9 月 6 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 18.66 | 21.73 | 346 | 6,456.36 | 7,518.58 | - |
| 301165 | 锐捷网络 | 2022 年 11 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 32.38 | 31.61 | 1,077 | 34,873.26 | 34,043.97 | - |
| 301175 | 中科环保 | 2022 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 3.82 | 6.01 | 6,370 | 24,333.40 | 38,283.70 | - |
| 301176 | 逸豪新材 | 2022 年 9 月 21 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 23.88 | 16.89 | 544 | 12,990.72 | 9,188.16 | - |
| 301227 | 森鹰 | 2022 年 | 6 个月 | 新股锁 | 38.25 | 29.49 | 284 | 10,863.00 | 8,375.16 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 窗业 | 9 月 16 日 | | 定期内 | | | | | | |
| 301230 | 泓博医药 | 2022 年 10 月 21 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 40.00 | 48.32 | 269 | 10,760.00 | 12,998.08 | - |
| 301231 | 荣信文化 | 2022 年 8 月 31 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 25.49 | 20.38 | 275 | 7,009.75 | 5,604.50 | - |
| 301233 | 盛帮股份 | 2022 年 6 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 41.52 | 34.30 | 158 | 6,560.16 | 5,419.40 | - |
| 301239 | 普瑞眼科 | 2022 年 6 月 22 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 33.65 | 69.68 | 575 | 19,348.75 | 40,066.00 | - |
| 301265 | 华新环保 | 2022 年 12 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 13.28 | 11.40 | 819 | 10,876.32 | 9,336.60 | - |
| 301267 | 华厦眼科 | 2022 年 10 月 26 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 50.88 | 66.20 | 962 | 48,946.56 | 63,684.40 | - |
| 301269 | 华大九天 | 2022 年 7 月 21 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 32.69 | 87.94 | 1,034 | 33,801.46 | 90,929.96 | - |
| 301277 | 新天地 | 2022 年 11 月 9 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 27.00 | 25.78 | 439 | 11,853.00 | 11,317.42 | - |
| 301283 | 聚胶股份 | 2022 年 8 月 26 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 52.69 | 51.41 | 235 | 12,382.15 | 12,081.35 | - |
| 301285 | 鸿日达 | 2022 年 9 月 21 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 14.60 | 12.60 | 561 | 8,190.60 | 7,068.60 | - |
| 301290 | 东星医疗 | 2022 年 11 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 44.09 | 35.13 | 330 | 14,549.70 | 11,592.90 | - |
| 301296 | 新巨丰 | 2022 年 8 月 26 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 18.19 | 14.90 | 1,042 | 18,953.98 | 15,525.80 | - |
| 301297 | 富乐德 | 2022 年 12 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 8.48 | 12.99 | 1,015 | 8,607.20 | 13,184.85 | - |
| 301301 | 川宁生物 | 2022 年 12 月 20 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 5.00 | 7.53 | 3,574 | 17,870.00 | 26,912.22 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301306 | 西测测试 | 2022 年 7 月 19 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 43.23 | 42.29 | 255 | 11,023.65 | 10,783.95 | - |
| 301309 | 万得凯 | 2022 年 9 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 39.00 | 24.46 | 228 | 8,892.00 | 5,576.88 | - |
| 301311 | 昆船智能 | 2022 年 11 月 23 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 13.88 | 15.86 | 832 | 11,548.16 | 13,195.52 | - |
| 301313 | 凡拓数创 | 2022 年 9 月 22 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 25.25 | 29.14 | 247 | 6,236.75 | 7,197.58 | - |
| 301316 | 慧博云通 | 2022 年 9 月 29 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 7.60 | 14.32 | 359 | 2,728.40 | 5,140.88 | - |
| 301319 | 唯特偶 | 2022 年 9 月 22 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 47.75 | 53.27 | 115 | 5,491.25 | 6,126.05 | - |
| 301326 | 捷邦科技 | 2022 年 9 月 9 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 51.72 | 36.62 | 227 | 11,740.44 | 8,312.74 | - |
| 301327 | 华宝新能 | 2022 年 9 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 237.50 | 176.97 | 242 | 57,475.00 | 42,826.74 | - |
| 301328 | 维峰电子 | 2022 年 8 月 30 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 78.80 | 76.96 | 191 | 15,050.80 | 14,699.36 | - |
| 301339 | 通行宝 | 2022 年 9 月 2 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 18.78 | 15.59 | 913 | 17,146.14 | 14,233.67 | - |
| 301349 | 信德新材 | 2022 年 8 月 30 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 138.88 | 103.52 | 180 | 24,998.40 | 18,633.60 | - |
| 301359 | 东南电子 | 2022 年 11 月 2 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 20.84 | 19.90 | 328 | 6,835.52 | 6,527.20 | - |
| 301361 | 众智科技 | 2022 年 11 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 26.44 | 20.96 | 517 | 13,669.48 | 10,836.32 | - |
| 301363 | 美好医疗 | 2022 年 9 月 28 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 30.66 | 37.85 | 445 | 13,643.70 | 16,843.25 | - |
| 301367 | 怡和嘉业 | 2022 年 10 月 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 119.88 | 175.78 | 223 | 26,733.24 | 39,198.94 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 21 日 | | | | | | | | |
| 301388 | 欣灵电气 | 2022 年 10 月 26 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 25.88 | 21.60 | 292 | 7,556.96 | 6,307.20 | - |
| 301396 | 宏景科技 | 2022 年 11 月 4 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 40.13 | 31.90 | 396 | 15,891.48 | 12,632.40 | - |
| 688252 | 天德钰 | 2022 年 9 月 20 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 21.68 | 15.78 | 5,201 | 112,757.68 | 82,071.78 | - |
| 688381 | 帝奥微 | 2022 年 8 月 15 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 41.68 | 37.98 | 7,362 | 306,848.16 | 279,608.76 | - |

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。

### 7.4.12.2 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

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，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款余额 220,090,198.97 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 210208 | 21 国开 08 | 2023 年 1 月 3 日 | 101.26 | 338,000 | 34,224,574.30 |
| 210218 | 21 国开 18 | 2023 年 1 月 3 日 | 100.95 | 1,000,000 | 100,951,452.05 |
| 220308 | 22 进出 08 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.96 | 1,000,000 | 99,959,863.01 |
| 合计 | | | | 2,338,000 | 235,135,889.36 |

### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 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

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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。

### 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兴业银行，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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 21.76%(2021 年 12 月 31 日：38.07%)。

### 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，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约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时间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 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%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 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。

##### 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 | 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 | 6,087,451.56 | - | - | - | - | - | 6,087,451.56 |
| 结算备付金 | 517,966.14 | - | - | - | - | - | 517,966.14 |
| 存出保证金 | 105,860.48 | - | - | - | - | - | 105,860.48 |
| 交易性金融资产 | - | 31,268,761.64 | 161,228,065.75 | 817,384,987.39 | 109,268,008.23 | 206,262,510.98 | 1,325,412,333.99 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 32,689.75 | 32,689.75 |
| 资产总计 | 6,711,278.18 | 31,268,761.64 | 161,228,065.75 | 817,384,987.39 | 109,268,008.23 | 206,295,200.73 | 1,332,156,301.92 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 220,090,198.97 | - | - | - | - | - | 220,090,198.97 |
| 应付清算 | - | - | - | - | - | 490,565.48 | 490,565.48 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 款 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 3,879.10 | 3,879.10 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 594,722.67 | 594,722.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 99,120.46 | 99,120.46 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 90,242.08 | 90,242.08 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 6,534.30 | 6,534.30 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 359,239.98 | 359,239.98 |
| 负债总计 | 220,090,198.97 | - | - | - | - | 1,644,304.07 | 221,734,503.04 |
| 利率敏感度缺口 | -213,378,920.79 | 31,268,761.64 | 161,228,065.75 | 817,384,987.39 | 109,268,008.23 | 204,650,896.66 | 1,110,421,798.88 |
| 上 | 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 |

| 年度末2021年12月31日 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 4,723,299.06 | - | - | - | - | - | 4,723,299.06 |
| 结算备付金 | 719,334.91 | - | - | - | - | - | 719,334.91 |
| 存出保证金 | 103,292.39 | - | - | - | - | - | 103,292.39 |
| 交易性金融资产 | - | - | 80,054,000.00 | 734,064,000.00 | 30,096,000.00 | 177,386,311.63 | 1,021,600,311.63 |
| 买入返售金融资产 | 119,000,392.50 | - | - | - | - | - | 119,000,392.50 |
| 应收证券 | - | - | - | - | - | 1,044,174.04 | 1,044,174.04 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 清算款 | | | | | | | |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 8,815,978.60 | 8,815,978.60 |
| 资产总计 | 124,546,318.86 | - | 80,054,000.00 | 734,064,000.00 | 30,096,000.00 | 187,246,464.27 | 1,156,006,783.13 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 10,038,903.42 | 10,038,903.42 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 440,839.16 | 440,839.16 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 73,473.18 | 73,473.18 |
| 卖出回购金融资产款 | 219,999,070.00 | - | - | - | - | - | 219,999,070.00 |
| 应付销售服务 | - | - | - | - | - | 27,952.63 | 27,952.63 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 费 | | | | | | | |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 6,430.08 | 6,430.08 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 473,672.43 | 473,672.43 |
| 负债总计 | 219,999,070.00 | - | - | - | - | 11,061,270.90 | 231,060,340.90 |
| 利率敏感度缺口 | -95,452,751.14 | - | 80,054,000.00 | 734,064,000.00 | 30,096,000.00 | 176,185,193.37 | 924,946,442.23 |

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

| 假设 | 除市场利率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） | |
| | | 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） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 5,303,941.69 | 5,035,963.18 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -5,258,765.63 | -4,978,382.97 |

### 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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 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<br>2022 年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>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 | 206,262,510.98 | 18.58 | 177,386,311.63 | 19.18 |
| 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 | 206,262,510.98 | 18.58 | 177,386,311.63 | 19.18 |

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 18.58%(2021 年 12 月 31 日：19.18%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

## 7.4.14 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 205,224,301.05 | 174,845,362.69 |
| 第二层次 | 1,119,149,823.01 | 846,754,948.94 |
| 第三层次 | 1,038,209.93 | - |
| 合计 | 1,325,412,333.99 | 1,021,600,311.63 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | - | - |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 2,959,235.32 | 2,959,235.32 |
| 转出第三层次 | - | 2,327,476.98 | 2,327,476.98 |
| 当期利得或损失总额 | - | 406,451.59 | 406,451.59 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 406,451.59 | 406,451.59 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 1,038,209.93 | 1,038,209.93 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 20,947.99 | 20,947.99 |

| 项目 | 上年度可比同期<br>2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | - | |
| 期初余额 | - | - | - |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | - | - |
| 当期利得或损失总额 | - | - | - |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | - | - |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | - | - |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | - | - |

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 证券交易所上市但尚在限售期内的股票 | 1038209.93 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 0.1891~2.4756 | 负相关 |

| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| - | - | - | - | - | - |

### 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资产(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 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 206,262,510.98 | 15.48 |
| | 其中：股票 | 206,262,510.98 | 15.48 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,119,149,823.01 | 84.01 |
| | 其中：债券 | 1,119,149,823.01 | 84.01 |
| | 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 | 6,605,417.70 | 0.50 |
| 8 | 其他各项资产 | 138,550.23 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 1,332,156,301.92 | 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

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 | 6,265,071.00 | 0.56 |
| B | 采矿业 | 71,577,545.44 | 6.45 |
| C | 制造业 | 60,505,257.87 | 5.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,482,134.00 | 1.21 |
| E | 建筑业 | 7,912,227.20 | 0.71 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,650,401.90 | 0.51 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,276,191.73 | 0.48 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 30,804,334.74 | 2.77 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 365,770.88 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 38,283.70 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 103,750.40 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,281,542.12 | 0.39 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 206,262,510.98 | 18.58 |

## 8.2.2 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通过港股通投资的股票。

## 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 | 600489 | 中金黄金 | 2,551,200 | 20,894,328.00 | 1.88 |
| 2 | 002155 | 湖南黄金 | 1,355,600 | 17,555,020.00 | 1.58 |
| 3 | 600547 | 山东黄金 | 747,220 | 14,316,735.20 | 1.29 |
| 4 | 000975 | 银泰黄金 | 1,149,476 | 12,690,215.04 | 1.14 |
| 5 | 600048 | 保利发展 | 591,043 | 8,942,480.59 | 0.81 |
| 6 | 001979 | 招商蛇口 | 698,205 | 8,818,329.15 | 0.79 |
| 7 | 000932 | 华菱钢铁 | 1,443,700 | 6,785,390.00 | 0.61 |
| 8 | 600383 | 金地集团 | 635,400 | 6,500,142.00 | 0.59 |
| 9 | 002353 | 杰瑞股份 | 184,800 | 5,157,768.00 | 0.46 |
| 10 | 601985 | 中国核电 | 849,800 | 5,098,800.00 | 0.46 |
| 11 | 002371 | 北方华创 | 20,400 | 4,596,120.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 12 | 601669 | 中国电建 | 588,090 | 4,163,677.20 | 0.37 |
| 13 | 002299 | 圣农发展 | 174,800 | 4,141,012.00 | 0.37 |
| 14 | 601872 | 招商轮船 | 682,810 | 3,816,907.90 | 0.34 |
| 15 | 300699 | 光威复材 | 52,700 | 3,807,575.00 | 0.34 |
| 16 | 600968 | 海油发展 | 1,197,430 | 3,448,598.40 | 0.31 |
| 17 | 000830 | 鲁西化工 | 263,700 | 3,267,243.00 | 0.29 |
| 18 | 000002 | 万科 A | 170,400 | 3,101,280.00 | 0.28 |
| 19 | 600282 | 南钢股份 | 970,000 | 3,055,500.00 | 0.28 |
| 20 | 002624 | 完美世界 | 220,800 | 2,808,576.00 | 0.25 |
| 21 | 600782 | 新钢股份 | 639,300 | 2,614,737.00 | 0.24 |
| 22 | 000333 | 美的集团 | 47,600 | 2,465,680.00 | 0.22 |
| 23 | 600150 | 中国船舶 | 108,663 | 2,421,011.64 | 0.22 |
| 24 | 600011 | 华能国际 | 292,300 | 2,224,403.00 | 0.20 |
| 25 | 002458 | 益生股份 | 152,810 | 2,124,059.00 | 0.19 |
| 26 | 000922 | 佳电股份 | 225,400 | 2,021,838.00 | 0.18 |
| 27 | 600970 | 中材国际 | 229,300 | 1,953,636.00 | 0.18 |
| 28 | 603565 | 中谷物流 | 126,100 | 1,833,494.00 | 0.17 |
| 29 | 601155 | 新城控股 | 85,000 | 1,742,500.00 | 0.16 |
| 30 | 600376 | 首开股份 | 298,700 | 1,699,603.00 | 0.15 |
| 31 | 600023 | 浙能电力 | 449,400 | 1,568,406.00 | 0.14 |
| 32 | 002594 | 比亚迪 | 6,000 | 1,541,820.00 | 0.14 |
| 33 | 300092 | 科新机电 | 114,000 | 1,521,900.00 | 0.14 |
| 34 | 300251 | 光线传媒 | 173,800 | 1,505,108.00 | 0.14 |
| 35 | 001330 | 博纳影业 | 118,500 | 1,419,630.00 | 0.13 |
| 36 | 600027 | 华电国际 | 241,400 | 1,419,432.00 | 0.13 |
| 37 | 000543 | 皖能电力 | 297,400 | 1,332,352.00 | 0.12 |
| 38 | 000600 | 建投能源 | 251,300 | 1,319,325.00 | 0.12 |
| 39 | 300144 | 宋城演艺 | 89,000 | 1,299,400.00 | 0.12 |
| 40 | 000928 | 中钢国际 | 216,000 | 1,270,080.00 | 0.11 |
| 41 | 000630 | 铜陵有色 | 395,600 | 1,234,272.00 | 0.11 |
| 42 | 600938 | 中国海油 | 77,604 | 1,179,580.80 | 0.11 |
| 43 | 605189 | 富春染织 | 63,200 | 1,167,936.00 | 0.11 |
| 44 | 603889 | 新澳股份 | 158,600 | 1,138,748.00 | 0.10 |
| 45 | 002130 | 沃尔核材 | 176,200 | 1,136,490.00 | 0.10 |
| 46 | 002237 | 恒邦股份 | 95,900 | 1,010,786.00 | 0.09 |
| 47 | 601899 | 紫金矿业 | 99,300 | 993,000.00 | 0.09 |
| 48 | 000625 | 长安汽车 | 79,900 | 983,569.00 | 0.09 |
| 49 | 603987 | 康德莱 | 67,600 | 931,528.00 | 0.08 |
| 50 | 601600 | 中国铝业 | 208,000 | 929,760.00 | 0.08 |
| 51 | 600309 | 万华化学 | 9,993 | 925,851.45 | 0.08 |
| 52 | 000921 | 海信家电 | 66,800 | 879,756.00 | 0.08 |
| 53 | 601238 | 广汽集团 | 73,800 | 814,014.00 | 0.07 |
| 54 | 600536 | 中国软件 | 13,800 | 804,954.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 55 | 003021 | 兆威机电 | 15,600 | 749,892.00 | 0.07 |
| 56 | 000636 | 风华高科 | 47,700 | 707,391.00 | 0.06 |
| 57 | 600764 | 中国海防 | 28,700 | 658,952.00 | 0.06 |
| 58 | 002768 | 国恩股份 | 22,600 | 655,852.00 | 0.06 |
| 59 | 603055 | 台华新材 | 63,500 | 641,350.00 | 0.06 |
| 60 | 300447 | 全信股份 | 39,500 | 608,300.00 | 0.05 |
| 61 | 603609 | 禾丰股份 | 47,300 | 560,032.00 | 0.05 |
| 62 | 601117 | 中国化学 | 66,100 | 524,834.00 | 0.05 |
| 63 | 300003 | 乐普医疗 | 22,800 | 523,716.00 | 0.05 |
| 64 | 603444 | 吉比特 | 1,600 | 500,544.00 | 0.05 |
| 65 | 002368 | 太极股份 | 17,400 | 489,462.00 | 0.04 |
| 66 | 300661 | 圣邦股份 | 2,800 | 483,280.00 | 0.04 |
| 67 | 000807 | 云铝股份 | 43,100 | 479,272.00 | 0.04 |
| 68 | 002912 | 中新赛克 | 14,100 | 446,124.00 | 0.04 |
| 69 | 300567 | 精测电子 | 8,600 | 431,720.00 | 0.04 |
| 70 | 002318 | 久立特材 | 25,500 | 424,320.00 | 0.04 |
| 71 | 300680 | 隆盛科技 | 17,000 | 420,920.00 | 0.04 |
| 72 | 300401 | 花园生物 | 26,300 | 378,457.00 | 0.03 |
| 73 | 688181 | 八亿时空 | 10,171 | 372,258.60 | 0.03 |
| 74 | 300986 | 志特新材 | 8,400 | 325,500.00 | 0.03 |
| 75 | 301080 | 百普赛斯 | 3,100 | 318,339.00 | 0.03 |
| 76 | 600021 | 上海电力 | 30,100 | 301,301.00 | 0.03 |
| 77 | 688381 | 帝奥微 | 7,362 | 279,608.76 | 0.03 |
| 78 | 688586 | 江航装备 | 15,113 | 246,341.90 | 0.02 |
| 79 | 600362 | 江西铜业 | 12,700 | 221,361.00 | 0.02 |
| 80 | 601168 | 西部矿业 | 21,400 | 218,280.00 | 0.02 |
| 81 | 000539 | 粤电力 A | 39,300 | 218,115.00 | 0.02 |
| 82 | 000977 | 浪潮信息 | 9,400 | 202,288.00 | 0.02 |
| 83 | 603619 | 中曼石油 | 11,000 | 197,230.00 | 0.02 |
| 84 | 600141 | 兴发集团 | 4,600 | 133,400.00 | 0.01 |
| 85 | 301283 | 聚胶股份 | 1,735 | 92,691.35 | 0.01 |
| 86 | 301269 | 华大九天 | 1,034 | 90,929.96 | 0.01 |
| 87 | 601808 | 中海油服 | 5,100 | 84,558.00 | 0.01 |
| 88 | 688252 | 天德钰 | 5,201 | 82,071.78 | 0.01 |
| 89 | 001301 | 尚太科技 | 1,164 | 68,722.56 | 0.01 |
| 90 | 301267 | 华厦眼科 | 962 | 63,684.40 | 0.01 |
| 91 | 300037 | 新宙邦 | 1,400 | 60,858.00 | 0.01 |
| 92 | 301231 | 荣信文化 | 2,744 | 57,404.12 | 0.01 |
| 93 | 301327 | 华宝新能 | 242 | 42,826.74 | 0.00 |
| 94 | 301239 | 普瑞眼科 | 575 | 40,066.00 | 0.00 |
| 95 | 301367 | 怡和嘉业 | 223 | 39,198.94 | 0.00 |
| 96 | 301175 | 中科环保 | 6,370 | 38,283.70 | 0.00 |
| 97 | 301165 | 锐捷网络 | 1,077 | 34,043.97 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 98 | 301301 | 川宁生物 | 3,574 | 26,912.22 | 0.00 |
| 99 | 000859 | 国风新材 | 4,400 | 23,408.00 | 0.00 |
| 100 | 301349 | 信德新材 | 180 | 18,633.60 | 0.00 |
| 101 | 301363 | 美好医疗 | 445 | 16,843.25 | 0.00 |
| 102 | 301296 | 新巨丰 | 1,042 | 15,525.80 | 0.00 |
| 103 | 301328 | 维峰电子 | 191 | 14,699.36 | 0.00 |
| 104 | 301139 | 元道通信 | 566 | 14,325.46 | 0.00 |
| 105 | 301339 | 通行宝 | 913 | 14,233.67 | 0.00 |
| 106 | 301311 | 昆船智能 | 832 | 13,195.52 | 0.00 |
| 107 | 301297 | 富乐德 | 1,015 | 13,184.85 | 0.00 |
| 108 | 301230 | 泓博医药 | 269 | 12,998.08 | 0.00 |
| 109 | 301396 | 宏景科技 | 396 | 12,632.40 | 0.00 |
| 110 | 301290 | 东星医疗 | 330 | 11,592.90 | 0.00 |
| 111 | 301277 | 新天地 | 439 | 11,317.42 | 0.00 |
| 112 | 301361 | 众智科技 | 517 | 10,836.32 | 0.00 |
| 113 | 301306 | 西测测试 | 255 | 10,783.95 | 0.00 |
| 114 | 603681 | 永冠新材 | 500 | 10,690.00 | 0.00 |
| 115 | 301058 | 中粮科工 | 700 | 10,465.00 | 0.00 |
| 116 | 301265 | 华新环保 | 819 | 9,336.60 | 0.00 |
| 117 | 301176 | 逸豪新材 | 544 | 9,188.16 | 0.00 |
| 118 | 301227 | 森鹰窗业 | 284 | 8,375.16 | 0.00 |
| 119 | 301326 | 捷邦科技 | 227 | 8,312.74 | 0.00 |
| 120 | 301161 | 唯万密封 | 346 | 7,518.58 | 0.00 |
| 121 | 301313 | 凡拓数创 | 247 | 7,197.58 | 0.00 |
| 122 | 301285 | 鸿日达 | 561 | 7,068.60 | 0.00 |
| 123 | 301359 | 东南电子 | 328 | 6,527.20 | 0.00 |
| 124 | 301388 | 欣灵电气 | 292 | 6,307.20 | 0.00 |
| 125 | 301319 | 唯特偶 | 115 | 6,126.05 | 0.00 |
| 126 | 301309 | 万得凯 | 228 | 5,576.88 | 0.00 |
| 127 | 301233 | 盛帮股份 | 158 | 5,419.40 | 0.00 |
| 128 | 301316 | 慧博云通 | 359 | 5,140.88 | 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 | 002155 | 湖南黄金 | 34,130,785.05 | 3.69 |
| 2 | 600489 | 中金黄金 | 26,824,947.00 | 2.90 |
| 3 | 600048 | 保利发展 | 20,535,803.10 | 2.22 |
| 4 | 600547 | 山东黄金 | 16,679,479.00 | 1.80 |
| 5 | 001979 | 招商蛇口 | 14,561,409.80 | 1.57 |
| 6 | 601975 | 招商南油 | 14,303,460.75 | 1.55 |
| 7 | 000975 | 银泰黄金 | 12,950,397.00 | 1.40 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 8 | 601669 | 中国电建 | 10,389,378.00 | 1.12 |
| 9 | 002353 | 杰瑞股份 | 10,106,425.00 | 1.09 |
| 10 | 600938 | 中国海油 | 9,764,378.00 | 1.06 |
| 11 | 000932 | 华菱钢铁 | 9,258,065.00 | 1.00 |
| 12 | 601872 | 招商轮船 | 8,919,954.40 | 0.96 |
| 13 | 601717 | 郑煤机 | 8,442,722.00 | 0.91 |
| 14 | 601985 | 中国核电 | 8,120,780.00 | 0.88 |
| 15 | 000937 | 冀中能源 | 7,871,092.00 | 0.85 |
| 16 | 300447 | 全信股份 | 7,356,708.00 | 0.80 |
| 17 | 002371 | 北方华创 | 7,010,417.00 | 0.76 |
| 18 | 600383 | 金地集团 | 6,837,932.00 | 0.74 |
| 19 | 600150 | 中国船舶 | 6,582,458.00 | 0.71 |
| 20 | 002318 | 久立特材 | 6,340,626.00 | 0.69 |

注：不考虑相关交易费用。

### 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 | 000975 | 银泰黄金 | 28,188,212.80 | 3.05 |
| 2 | 600048 | 保利发展 | 19,826,488.48 | 2.14 |
| 3 | 601975 | 招商南油 | 19,242,251.52 | 2.08 |
| 4 | 601872 | 招商轮船 | 17,832,174.88 | 1.93 |
| 5 | 002155 | 湖南黄金 | 17,602,594.68 | 1.90 |
| 6 | 600547 | 山东黄金 | 17,585,130.00 | 1.90 |
| 7 | 600150 | 中国船舶 | 13,962,968.00 | 1.51 |
| 8 | 600489 | 中金黄金 | 12,269,267.00 | 1.33 |
| 9 | 301073 | 君亭酒店 | 12,179,269.00 | 1.32 |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 11,278,988.04 | 1.22 |
| 11 | 603916 | 苏博特 | 11,139,944.60 | 1.20 |
| 12 | 600938 | 中国海油 | 10,272,207.38 | 1.11 |
| 13 | 601717 | 郑煤机 | 10,267,013.81 | 1.11 |
| 14 | 600029 | 南方航空 | 9,215,486.78 | 1.00 |
| 15 | 601857 | 中国石油 | 9,133,948.00 | 0.99 |
| 16 | 002318 | 久立特材 | 9,039,449.89 | 0.98 |
| 17 | 603035 | 常熟汽饰 | 8,943,473.80 | 0.97 |
| 18 | 601111 | 中国国航 | 8,842,642.84 | 0.96 |
| 19 | 000937 | 冀中能源 | 8,714,340.93 | 0.94 |
| 20 | 600348 | 华阳股份 | 8,691,921.80 | 0.94 |

注：不考虑相关交易费用。

### 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 | 656,178,986.73 |

| | |
|---|---|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 659,575,834.42 |

注：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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,037,633,621.36 | 93.44 |
| | 其中：政策性金融债 | 877,576,136.97 | 79.03 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 81,516,201.65 | 7.34 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,119,149,823.01 | 100.79 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 092218005 | 22 农发清发 05 | 2,000,000 | 199,729,315.07 | 17.99 |
| 2 | 092218003 | 22 农发清发 03 | 1,400,000 | 141,689,358.90 | 12.76 |
| 3 | 220303 | 22 进出 03 | 1,000,000 | 101,473,424.66 | 9.14 |
| 4 | 210218 | 21 国开 18 | 1,000,000 | 100,951,452.05 | 9.09 |
| 5 | 220308 | 22 进出 08 | 1,000,000 | 99,959,863.01 | 9.00 |

## 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

注：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

注：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

注：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

注：报告期内，因美联储加息、海外经济下行等因素影响，存在一定风险，为力争获取个股收益， 对冲系统性风险，本基金进行了股指期货空单套保。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，21 国开 18 的发行主体国家开发银行于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银保监罚决字（2022）8 号），因监管标准化数据（EAST)系统数据治理及数据报送存在违规行为，公开罚款 440 万元。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

报告期内基金投资的其他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。

### 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

### 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 | 105,860.48 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 32,689.75 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 138,550.23 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 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。

## §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（%） |
| 华泰柏瑞恒利混合 A | 316 | 1,784,384.58 | 558,913,049.93 | 99.12 | 4,952,476.55 | 0.88 |
| 华泰柏瑞恒利混合 C | 1,081 | 460,723.43 | 490,959,452.08 | 98.58 | 7,082,574.72 | 1.42 |
| 合计 | 1,377 | 771,174.69 | 1,049,872,502.01 | 98.87 | 12,035,051.27 | 1.13 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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 | 华泰柏瑞恒利混合 A | 0.00 | 0.0000 |
| | 华泰柏瑞恒利混合 C | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 0.00 | 0.0000 |

### 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 | 华泰柏瑞恒利混合 A | 0 |
| | 华泰柏瑞恒利混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华泰柏瑞恒利混合 A | 0 |
| | 华泰柏瑞恒利混合 C | 0 |

| | | |
|---|---|---|
| | 合计 | 0 |

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞恒利混合 A | 华泰柏瑞恒利混合 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2021 年 9 月 14 日）基金份额总额 | 170,011,448.81 | 70,012,500.09 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 786,934,530.55 | 131,921,838.17 |
| 本报告期基金总申购份额 | 371,919,381.36 | 729,328,977.68 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 594,988,385.43 | 363,208,789.05 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 563,865,526.48 | 498,042,026.80 |

# §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

基金管理人的重大人事变动：

2022 年 3 月 15 日，公司股东会书面决定 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司第六届董事会董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

2022 年 11 月 18 日，公司进行董事会、监事会换届选举，股东会批准贾波先生、陆春光先生、韩勇先生、Kirk Chester SWEENEY 先生、杨智雅女士担任公司第七届董事会董事，陆桢女士、李晗女士、田中荣治先生、孙茂竹先生担任公司第七届董事会独立董事，刘晓冰先生、卞时珍女士、柳军先生、刘声先生担任公司第七届监事会监事。文光伟先生、李亦宜女士不再担任公司独立董事。

2022 年 12 月 12 日，经公司董事会批准裴晓思先生担任公司副总经理，周俊梁先生担任公司财务总监。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 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、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内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

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 90,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 年的审计服务。

## 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

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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(%) | |
| 安信证券 | 1 | 707,618,599.43 | 55.35 | 149,516.31 | 22.21 | - |
| 华泰证券 | 2 | 570,882,600.40 | 44.65 | 523,777.81 | 77.79 | - |

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为，未受监管机构重大处罚；

3）资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；

4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需

要，并能为基金提供全面的信息服务；

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

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

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

## 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 | | 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(%) |
| 安信证券 | 20,691,572.34 | 99.98 | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 4,744.66 | 0.02 | - | - | - | - |

## 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 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 12 月 13 日 |
| 2 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 12 月 1 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 11 月 23 日 |
| 4 | 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 11 月 10 日 |
| 5 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 11 月 3 日 |
| 6 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申赎旗下公募基金免除相 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 10 月 10 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 关费用的公告 | | |
| 7 | 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 9 月 30 日 |
| 8 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海中欧财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 9 月 28 日 |
| 9 | 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 9 月 9 日 |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 9 月 4 日 |
| 11 | 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 8 月 24 日 |
| 12 | 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 8 月 14 日 |
| 13 | 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 7 月 22 日 |
| 14 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司、乾道基金销售有限公司销售机构办理相关销售业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 7 月 20 日 |
| 15 | 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 7 月 17 日 |
| 16 | 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可转换公司债券的关联交易的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 7 月 7 日 |
| 17 | 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 7 月 7 日 |
| 18 | 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 5 月 28 日 |
| 19 | 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 5 月 26 日 |
| 20 | 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 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 5 月 11 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 券的公告 | | |
| 21 | 华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 3 月 2 日 |
| 22 | 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 |
| 23 | 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 |

# §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 | 20220606-20220607; | 165,195,152.69 | 185,594,468.30 | 165,072,141.72 | 185,717,479.27 | 17.49 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。 | | | | | | |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 注：无。 |

# §13 备查文件目录

## 13.1 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

## 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

## 13.3 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**

**2023 年 3 月 31 日**