

# 华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金

## 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 04 月 22 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华泰柏瑞景气驱动混合   |
| 基金主代码      | 015970   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 9 月 28 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 56,192,782.84 份  |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金通过深入的基本面研究把握投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）A 股投资策略</p> <p>（2）港股投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收</p> |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略<br/>在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>5、衍生品投资策略<br/>(1) 股指期货投资策略<br/>(2) 国债期货投资策略<br/>(3) 股票期权投资策略</p> <p>6、融资业务的投资策略<br/>本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p> <p>7、存托凭证投资策略<br/>本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。<br/>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。</p> |
| 业绩比较基准          | 中证 800 指数收益率*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%+中债综合全价指数收益率*20%   |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。   |
| 基金管理人           | 华泰柏瑞基金管理有限公司   |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司   |
| 下属分级基金的基金简称     | 华泰柏瑞景气驱动混合 A      华泰柏瑞景气驱动混合 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 015970                              015971   |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 47,132,586.49 份                      9,060,196.35 份  |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |                                     |              |
|--------|-------------------------------------|--------------|
| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） |              |
|        | 华泰柏瑞景气驱动混合 A                        | 华泰柏瑞景气驱动混合 C |

|                 |               |              |
|-----------------|---------------|--------------|
| 1. 本期已实现收益      | 4,280,136.92  | 717,997.81   |
| 2. 本期利润         | 1,707,078.28  | 357,471.00   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0255        | 0.0289       |
| 4. 期末基金资产净值     | 47,561,200.11 | 9,117,793.81 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0091        | 1.0064       |

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞景气驱动混合 A

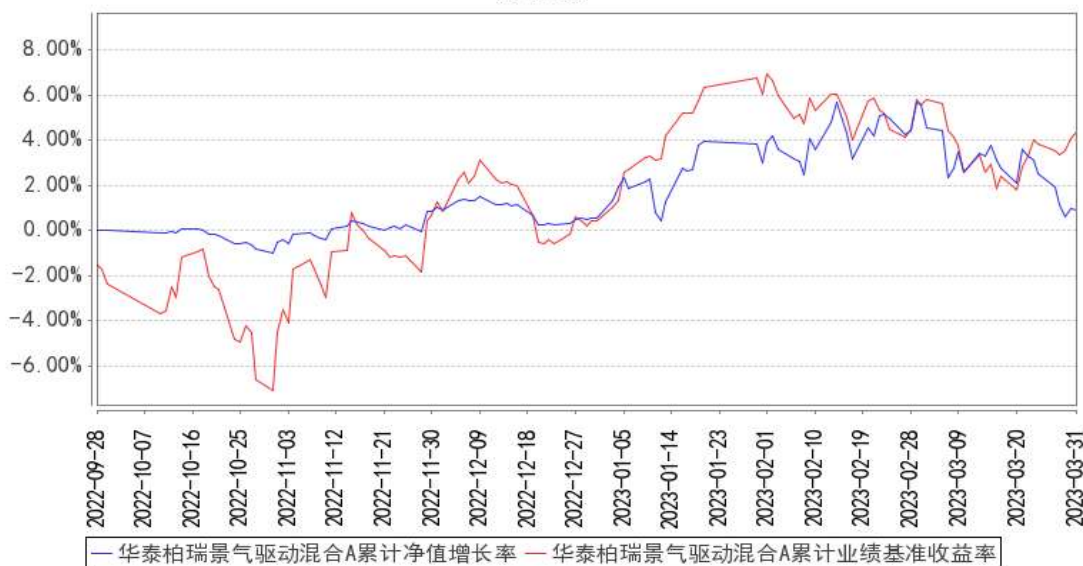
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.36%  | 0.76%         | 3.93%          | 0.64%                 | -3.57% | 0.12%  |
| 过去六个月          | 0.92%  | 0.55%         | 6.87%          | 0.83%                 | -5.95% | -0.28% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.91%  | 0.55%         | 4.37%          | 0.83%                 | -3.46% | -0.28% |

华泰柏瑞景气驱动混合 C

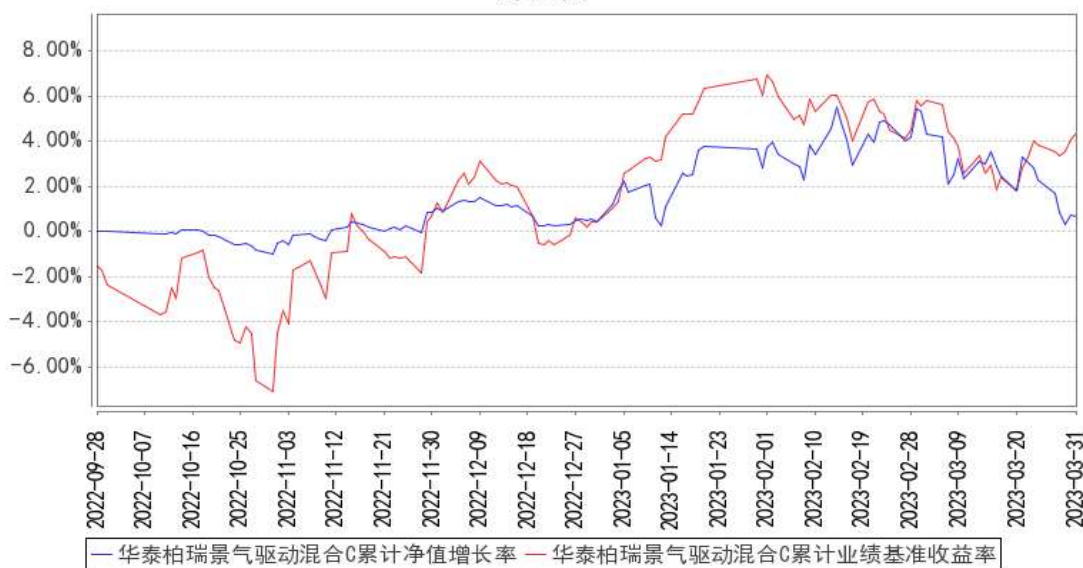
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.23%  | 0.76%         | 3.93%          | 0.64%                 | -3.70% | 0.12%  |
| 过去六个月          | 0.65%  | 0.55%         | 6.87%          | 0.83%                 | -6.22% | -0.28% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.64%  | 0.55%         | 4.37%          | 0.83%                 | -3.73% | -0.28% |

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

华泰柏瑞景气驱动混合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



华泰柏瑞景气驱动混合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、图示日期为 2022 年 9 月 28 日起至 2023 年 3 月 31 日。

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

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
|    |    | 任职日期        | 离任日期 |        |    |
|    |    |             |      |        |    |

|     |                              |                    |   |      |   |
|-----|------------------------------|--------------------|---|------|---|
| 吴邦栋 | 投资二部<br>副总监、<br>本基金的<br>基金经理 | 2022 年 9 月<br>28 日 | - | 12 年 | 上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级研究员兼基金经理助理。2018 年 3 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 8 月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。2018 年 4 月至 2020 年 12 月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 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。2020 年 3 月起任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 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 月起任华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金的基金经理。 |
|-----|------------------------------|--------------------|---|------|---|

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。 本报告

期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

行情回顾及运作分析：

2023 年一季度，A 股市场先经历了一波整体性修复的  $\beta$  行情，此后大盘转入震荡整固，但结构性机会依然丰富。首先，1 月市场显著修复，背后一方面是年初疫情峰值回落、防疫措施持续优化、居民生活加速正常化，叠加各项政策宽松措施进入到落地甚至实际生效阶段，带动国内经济复苏预期快速升温。另一方面外资大幅流入，1 月陆股通北上资金流入 1413 亿，创单月净流入规模历史新高，也成为年初市场的重要驱动。至 2 月，随着多项高频数据指向经济修复程度不一，导致市场对复苏强度出现分歧。同时外资流入放缓、市场阶段性重回存量博弈。大盘也由此开始陷入震荡，行业轮动加速并一度进入“电风扇”式极致轮动状态。3 月，市场延续震荡，但随着两会过后市场对于经济和政策预期的分歧逐渐弥合，行业轮动速度开始放缓，主线加速聚焦数字经济 TMT 等方向。整个一季度，中证 500 涨 8.11%，沪深 300 涨 4.63%，创业板指涨 2.25%。风格上小盘、成长相对占优。

宏观经济方面，整体沿着“需求快速复苏→生产快速跟进→需求修复趋缓、供需分化调整”的路径温和复苏。1 月需求快速回暖，但由于春节等因素生产未能跟进复苏。至 2 月，复工复产推进之下，生产快速跟进，生产上行快于需求。而 3 月，随着需求在高基数之上没有进一步加速，导致前期偏快的生产、库存都出现回落。具体分项上，PMI 连续 3 个月处于枯荣线上，但实际上 3 月有所回落。生产端，在 2022 年 11 月工业增加值季调环比负增长，12 月接近零增长的情况下，2023 年 1、2 月工业增加值季调环比仅分别增长 0.26%、0.12%，指向生产复苏动力仍弱。消费方面，1-2 月社消同比增长 3.5%，其中场景恢复带动服务消费复苏，但商品消费有所分化、整体仍处于弱复苏。投资方面，1-2 月固定资产投资增速同比回升至 5.5%，其中制造业、基建继续维持高位，而地产投资增速由两位数的负增长迅速收窄至 -5.7%，成为主要拉动。此外，随着政策宽松落地，1 月新增社融 5.98 万亿，其中信贷同比多增 7312 亿元。2 月作为传统信贷“小月”的情况下社融新增 3.16 万亿元，比上年同期多增 1.95 万亿元。连续呈现“总量高，结构好”的格局。

政策层面，海外硅谷银行破产等事件冲击下美联储加息显著回落，同时国内政策维持宽松并

进入增量部署窗口期。3月5日政府工作报告明确2023年“国内生产总值增长5%左右”等主要发展目标，并确定赤字率拟安排3%，专项债拟安排3.8万亿，基本符合预期。3月13日总理中外记者会进一步明晰新一届政府的施政目标与工作重点。3月24日国常会确定国务院2023年重点工作分工，同时延续和优化实施部分阶段性税费优惠政策，推动减负规模预计达4800多亿元。此外近期决策层对民营经济密集释放利好，也进一步稳定市场信心。新一届政府开始行动、实干之下，政策进入增量部署窗口期。另一方面，海外年初在经历衰退交易和紧缩交易的交替后，至3月中上旬随着硅谷银行事件爆发并持续发酵，尽管监管立即出手，但银行流动性仍快速陷入紧张状态。与此同时，美欧经济衰退预期进一步升温，加息预期走弱。美联储方面，尽管点阵图显示在3月加息25bp后年内仍有一次加息，但市场仍倾向于认为后续年内不再加息并将最快于三季度重启宽松。而欧央行方面，3月会议加息50bp，但在声明措辞中强调保护金融稳定性，未提及下次会议的加息步伐，为后续政策留下余地。

行业层面，对应市场先 $\beta$ 后 $\alpha$ 的行情变化，行业主线上也经历了“周期成长引领普涨→行业极致轮动→数字经济、中特估主线确认”的过程。首先，1月普涨中，受益于经济复苏预期快速升温以及市场风险偏好回暖，前期表现相对落后的以新能源车产业链，以及以信创、半导体等为代表的成长板块涨幅领先。至2月，由于对经济复苏强度和政策宽松出现分歧，市场进入行业快速轮动的状态。结构上受益chatgpt、AIGC技术进步驱动的“数字经济”领涨，“中特估”也表现靠前。3月，市场延续震荡，但随着两会过后市场对于经济和政策预期的分歧逐渐弥合，行业轮动速度开始放缓，主线加速聚焦数字经济TMT等方向。

本基金在报告期内继续保持行业及个股景气度选股的思路，整体来说行业配置上较为均衡，成长股比例略有增加，主要以消费以及TMT类的成长个股为主。

#### 市场展望和投资策略：

二季度，我们倾向于认为市场整体仍将以震荡为主、结构上以 $\alpha$ 行情为主：1) 首先指数层面，从股权风险溢价来看，上证综指已从去年底的极端值回落到当前接近均值水平。参考历史经验，若后续指数要实现进一步的突破，则需要看好经济复苏强度、或政策力度上的超预期，类似2005-2008年、2014-2015年和2020-2021年。这意味着在经济和政策宽松释放进一步的积极信号前，从指数位置而言，当前已修复到了一个相对正常、合理的位置。2) 3月以来，市场之所以向数字经济TMT等方向主线聚焦，一个重要原因是随着“两会”召开以及1、2月经济数据公布，市场对经济和政策预期的分歧逐渐弥合、共识逐渐形成——即经济温和复苏、政策温和宽松，市场缺乏整体性 $\beta$ ，只能在产业驱动和政策引领下面向未来找机会。而目前来看，至少二、三季度，这种宏观组合大概率将延续。3) 此外海外方面，加息周期末期紧缩预期上的反复、波



动仍将扰动。

结构上，建议关注：1) “数字经济”主线方向明确，重点关注半导体、运营商、信创、人工智能、金融科技等；2) “中特估”、“一带一路”下的建筑、能源产业链等；3) 业绩确定性强且拥挤度低的方向，如出行链、创新药等。

操作方面，1 季度财报期过后，选股的有效性将会大大增强，我们仍在保持仓位不变的情况下，坚持精选细分景气行业，自下而上挖掘个股，在组合方面剔除一些季报、年报低于预期的品种，加入一些现金流提前复苏，或季报增速超预期的个股。整体来说，在关注前面提到的宏观面几个不确定性因素的同时，综合考虑组合盈利增长和估值的匹配程度，对结构进一步优化。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类和 C 类份额净值分别为 1.0091 元和 1.0064 元，本期业绩收益率分别为 0.36% 和 0.23%，同期本基金的业绩比较基准收益率为 3.93%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 47,777,112.12 | 82.47        |
|    | 其中：股票             | 47,777,112.12 | 82.47        |
| 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      | 10,063,928.66 | 17.37        |
| 8  | 其他资产              | 88,739.26     | 0.15         |
| 9  | 合计                | 57,929,780.04 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 14,704.52 元，占期末净值比例为 0.03%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 61,286.40     | 0.11         |
| C  | 制造业              | 31,339,845.60 | 55.29        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,971,720.60  | 3.48         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 1,193,962.00  | 2.11         |
| 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  | 4,422,281.00  | 7.80         |
| J  | 金融业              | 1,983,904.00  | 3.50         |
| K  | 房地产业             | 5,139,531.00  | 9.07         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,649,877.00  | 2.91         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| 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               | -             | -            |
|    | 合计               | 47,762,407.60 | 84.27        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|-----------|--------------|
| 10 能源   | -         | -            |
| 15 原材料  | -         | -            |
| 20 工业   | -         | -            |
| 25 可选消费 | -         | -            |
| 30 主要消费 | 14,704.52 | 0.03         |
| 35 医药卫生 | -         | -            |
| 40 金融   | -         | -            |
| 45 信息技术 | -         | -            |
| 50 通信服务 | -         | -            |
| 55 公用事业 | -         | -            |
| 60 房地产  | -         | -            |
| 合计      | 14,704.52 | 0.03         |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 301198 | 喜悦智行 | 200,500 | 5,527,785.00 | 9.75         |
| 2  | 601512 | 中新集团 | 533,700 | 5,139,531.00 | 9.07         |
| 3  | 300122 | 智飞生物 | 62,600  | 5,128,818.00 | 9.05         |
| 4  | 603456 | 九洲药业 | 142,600 | 4,745,728.00 | 8.37         |
| 5  | 600433 | 冠豪高新 | 765,600 | 3,261,456.00 | 5.75         |
| 6  | 301208 | 中亦科技 | 33,600  | 2,100,000.00 | 3.71         |
| 7  | 600011 | 华能国际 | 229,300 | 1,965,101.00 | 3.47         |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 4,500   | 1,827,225.00 | 3.22         |
| 9  | 600079 | 人福医药 | 66,000  | 1,767,480.00 | 3.12         |
| 10 | 600436 | 片仔癀  | 6,200   | 1,763,156.00 | 3.11         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期末投资的前十名证券中，人福医药（600079）于 2023 年 2 月 7 日被上海证券交易所因公司未依法履行其他职责，对公司及其部分高管处以公开谴责的处罚。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前十名证券的其他发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 69,532.85 |
| 2  | 应收证券清算款 | 18,886.41 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 320.00    |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 88,739.26 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 华泰柏瑞景气驱动混合 A  | 华泰柏瑞景气驱动混合 C  |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 98,212,155.96 | 29,015,321.99 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 879,614.52    | 263,159.02    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 51,959,183.99 | 20,218,284.66 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 47,132,586.49 | 9,060,196.35  |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》

- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

## 9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 04 月 22 日