

# 华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 21 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 20 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 4 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金于 2020 年 10 月 20 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 10 月 20 日开始计算。

## §2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞研究精选
基金主代码	007968
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 19 日
报告期末基金份额总额	544,600,167.91 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：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。</p> <p>2、股票投资策略：本基金主要采用“自下而上”的深度基本面研究策略，主要从公司主营业务、公司商业模式、公司财务状况、公司治理结构情况、公司所处行业和公司估值方面进行深入研究从而精选个股。</p> <p>3、债券组合投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略：在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置</p>

	<p>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、股指期货投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。</p> <p>6、融资业务的投资策略：本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p>	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%。	
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货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞研究精选 A	华泰柏瑞研究精选 C
下属分级基金的交易代码	007968	010291
报告期末下属分级基金的份额总额	507,884,485.30 份	36,715,682.61 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 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	华泰柏瑞研究精选 A	华泰柏瑞研究精选 C
1. 本期已实现收益	-33,837,007.45	-2,809,709.54
2. 本期利润	-40,829,113.34	-3,954,401.86
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0780	-0.0933
4. 期末基金资产净值	764,866,139.81	54,546,562.89
5. 期末基金份额净值	1.5060	1.4856

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

华泰柏瑞研究精选 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.91%	1.05%	-4.02%	0.64%	-0.89%	0.41%
过去六个月	-3.01%	1.01%	0.31%	0.64%	-3.32%	0.37%
过去一年	-11.03%	1.16%	-9.68%	0.76%	-1.35%	0.40%
过去三年	15.25%	1.54%	-2.53%	0.93%	17.78%	0.61%
自基金合同生效起至今	50.60%	1.53%	5.58%	0.97%	45.02%	0.56%

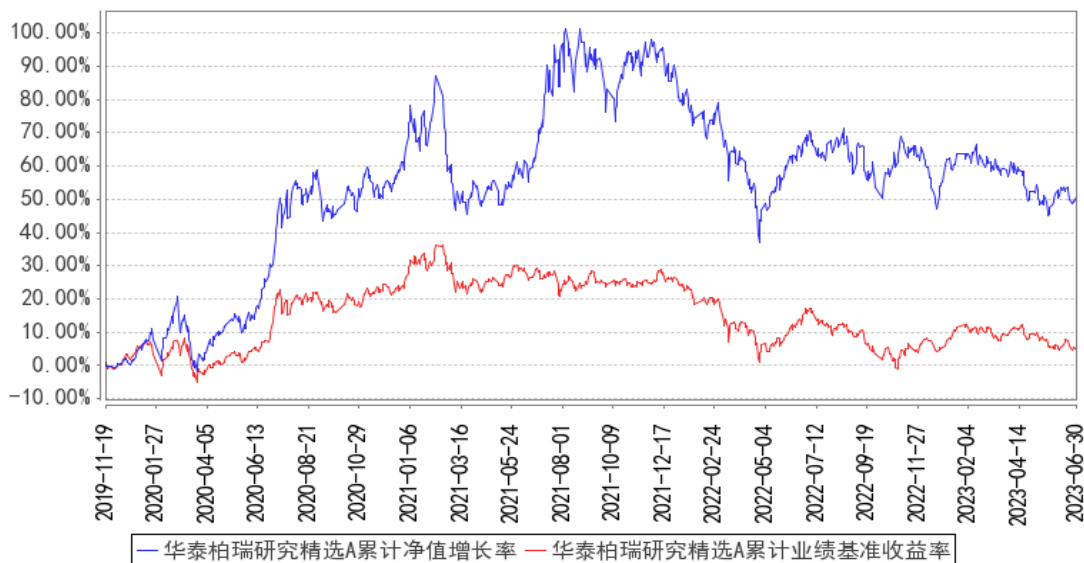
华泰柏瑞研究精选 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.03%	1.05%	-4.02%	0.64%	-1.01%	0.41%
过去六个月	-3.26%	1.01%	0.31%	0.64%	-3.57%	0.37%
过去一年	-11.48%	1.16%	-9.68%	0.76%	-1.80%	0.40%
自基金合同生效起至今	-1.60%	1.52%	-11.63%	0.88%	10.03%	0.64%

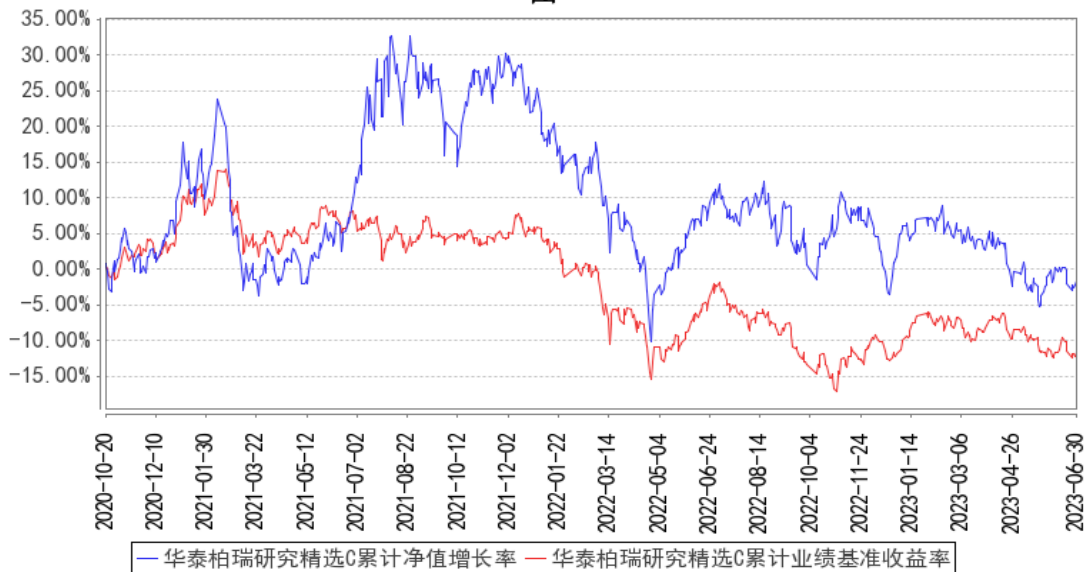
注：本基金于 2020 年 10 月 20 日新增 C 类份额。

### 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

华泰柏瑞研究精选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



华泰柏瑞研究精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A 类份额图示日期为 2019 年 11 月 19 日至 2023 年 6 月 30 日。C 类份额图示日期为 2020 年 10 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。

## §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	投资二部副总监、本基金的	2023 年 6 月 9 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

	基金经理			<p>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。2023 年 6 月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、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的基金经理。</p>
张慧	总经理助理、主动权益投资总监、本基金的基金经理	2019 年 11 月 19 日	2023 年 6 月 9 日	<p>16 年</p> <p>经济学硕士。2007 年 7 月至 2010 年 6 月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理、投资部副总监、投资研究部副总监、投资研究部总监、主动权益投资总监，2021 年 12 月起任公司总经理助理。2013 年 9 月至 2018 年 5 月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014 年 5 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月至 2020 年 8 月任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基</p>

					金经理。2020 年 6 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 5 次，其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 4 次为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年二季度，随着市场对于经济的预期转弱，市场整体呈现震荡转跌走势。节奏上，4 月上旬 TMT 延续 3 月以来的涨势，顺周期方向也温和上涨，带动指数上行。至 4 月中旬，经济数据超预期之下，市场短暂迎来经济预期的上修，风格转向大盘、价值。而到了 4 月下旬，TMT 大跌

拖累市场情绪，除传媒外所有行业均出现回调。至 5 月，市场进一步震荡大跌，主要原因在于阶段性主线动能减弱、资金存量博弈甚至出现缩量、市场缺乏合力的混沌窗口，遭遇经济数据回落、人民币贬值等因素，导致风险偏好收缩。直至 6 月，市场开始低位震荡。其中，6 月初随着市场持续博弈政策放松预期，带动指数开始企稳。至 6 月中旬，包括降息、促消费等政策边际宽松措施开始从预期成为现实，进一步稳定市场信心。但 6 月下旬，海外央行货币紧缩的尾部风险、人民币贬值压力以及国际各类地缘风险等外部风险再度冲击风险偏好，指数再度回调。整个二季度，沪深 300 跌 5.15%，中证 500 跌 5.38%，创业板指跌 7.69%。风格上大盘、价值相对占优。

宏观经济方面，整体呈现年初脉冲式修复后增长斜率逐渐放缓、回归中枢的特征。其中，4 月经济数据承压特征明显。至 5 月复苏动能依然偏弱，但复苏动能放缓的斜率未见加速。而 6 月，随着稳增长政策加码支撑，经济下行压力最大的时候可能在逐渐过去，并呈现出初步的筑底迹象。具体分项上，4 月以来 PMI 连续三个月处于枯荣线以下，但 6 月制造业 PMI 环比回升 0.2 个百分点至 49.0%。生产端，2022 年底以来工业增加值始终处于弱于季节性的状态，4 月甚至在没有外部冲击的情况下出现环比负增长。但 5 月这一情况已改变，工业增加值环比季调回到中枢水平。而且工业增加值环比的明显反弹并未带来产销率的恶化。消费方面，1-5 月社零消费累计同比增速为 9.3%，较上月回升 0.8%。但 5 月当月同比增速却出现回落，主因可能是低基数效应的边际减弱。往后看，基数因素或继续拖累消费增速读数回落。投资方面，4 月固定资产投资同比出现放缓，从环比来看，三大投资环比均低于季节性。但 5 月这一情况也发生改变，基建、制造业投资环比超出季节性规律，同比增速企稳。但地产方面，5 月各项同比指标同步回落，地产回暖趋势暂缓。此外，5 月新增社融 1.56 万亿元，新增信贷、政府债券、企业债券、非标等各大社融主要分项均出现不同程度的萎缩，货币供需两端均出现一定回落。偏低的社融数据或加大了后续政策呵护的概率。

政策层面，5 月以来随着经济压力逐步显现，各项政策宽松措施已在逐步落地。6 月 13 日央行超预期宣布 OMO 降息 10bp，6 月 15 日 MLF 如期降息，6 月 20 日 LPR 降息也已落地。6 月 16 日国常会又明确指出“针对经济形势的变化，必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好”，并研究出台推动经济持续回升向好的一批政策措施。同日，发改委也在新闻发布会上表示将从 6 方面发力推动经济动能复苏。6 月 30 日央行二季度货币政策例会又重提“加大逆周期调节力度”，并要求“克服困难、乘势而上”、“切实支持扩大内需”。往后看，经济压力下政策呵护有望持续落地。另一方面，美国中小银行问题基本平息，6 月 FOMC 会议也如期暂停加息，但美国需求韧性仍强、核心通胀回落缓慢之下，导致美债利率整体居高不下、货币环境难以系统性转松。最新点阵图指向年内或仍有两次加息，市场也预计年内美联储可



能不降息。与此同时，欧洲通胀问题仍然严重，欧央行在 5、6 月份连续加息 25bp 后，近期仍在持续向市场传达“利率会在限制性水平维持足够长时间”的信号，以确保不会引发市场对货币政策快速转向的预期，从而使得此前的紧缩效应能够充分传导至经济体。

行业层面，本季度数字经济与中特估主线交替轮动，成为决定市场超额收益方向的核心线索。首先，4 月上旬 TMT 延续 3 月以来的涨势，至 4 月中旬，随着数字经济拥挤度升至高位，叠加经济预期短暂上修，中特估、顺周期领跑，TMT 震荡回调。此后 4 月下旬，TMT 大跌拖累市场情绪，除传媒外所有行业均出现回调。进入 5 月，市场经济悲观预期升温，“中特估”方向显著回调拖累市场表现，而前期大幅调整的 TMT 反而逆市企稳。直至 5 月底，政策宽松预期升温下金融、地产链等方向有所反弹，数字经济更开始演绎新一轮行情。行至 6 月中旬，随着各项宽松政策落地、经济悲观预期修正下，新能源、汽车等前期落后板块迎来补涨。但 6 月下旬，海外央行货币紧缩的尾部风险、人民币贬值压力以及国际各类地缘风险等外部风险再度冲击风险偏好，导致市场回调、TMT 领跌。

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，主要以消费以及高端制造类的成长个股为主。

三季度至少 7、8 月份，我们认为对于市场整体可保持乐观，有望迎来年内又一个难得的机遇：1) 首先指数层面，从股权风险溢价来看，上证综指在经历 5 月以来的调整后目前已重新逼近三年滚动平均+1 倍标准差的相对较高水平。结构上，当前大部分板块包括消费、顺周期、高端制造等位置都已较低，TMT 也明显回调。因此市场或已具备修复的空间。2) 其次，市场对于国内经济体感最差的时间或也在逐渐过去。二季度预期和库存的波动放大了需求不足的担忧，并导致市场大幅回调。但三季度，市场对经济的预期有望较二季度明显改善，由此整体的市场情绪也有望逐步恢复。3) 当前各项政策宽松措施已在逐步落地。往后看，至少到月底重要会议前，市场一直可以有政策上的期待。4) 市场对于外部风险或在脱敏、钝化。与此同时，近期人民币汇率压力也已在缓解，对 7 月 FOMC 会议加息的预期纳入也接近充分，后续直到 9 月会议前都将处于空窗阶段。

结构上，后续会关注：1) “数字经济”主线明确，仍是中长期市场战略性聚焦的方向，可能会调整布局；2) “中特估”经济悲观预期修复和政策呵护预期升温下，可能再次迎来投资机会；3) 除了“数字经济”和“中特估”两大主线外，阶段性 beta 修复窗口，包括军工新能源为代表的科技制造、中报绩优的消费股，以及一些顺周期板块，或也都有低位修复机会。

操作方面，中报财报期过后，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报告低于预期的品种，加入一些现金流提前复苏，或中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

截至本报告期末华泰柏瑞研究精选 A 的基金份额净值为 1.5060 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.91%，同期业绩比较基准收益率为-4.02%，截至本报告期末华泰柏瑞研究精选 C 的基金份额净值为 1.4856 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.03%，同期业绩比较基准收益率为-4.02%。

#### 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	597,848,164.30	72.22
	其中：股票	597,848,164.30	72.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	42,855,512.44	5.18
	其中：债券	42,855,512.44	5.18
	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	186,566,284.54	22.54
8	其他资产	566,638.29	0.07
9	合计	827,836,599.57	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	445,841,408.01	54.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00

E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	48,366,793.37	5.90
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	59,890,474.92	7.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,541,493.47	3.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,123,421.48	2.09
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	597,848,164.30	72.96

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603456	九洲药业	2,262,413	61,944,867.94	7.56
2	300723	一品红	1,137,450	33,327,285.00	4.07
3	603309	维力医疗	1,881,320	29,104,020.40	3.55
4	002929	润建股份	658,700	28,594,167.00	3.49
5	000989	九芝堂	1,927,888	26,681,969.92	3.26
6	002912	中新赛克	604,318	26,596,035.18	3.25
7	601512	中新集团	2,791,823	26,047,708.59	3.18
8	600566	济川药业	869,800	25,258,992.00	3.08
9	300408	三环集团	857,846	25,177,780.10	3.07
10	605266	健之佳	298,702	25,040,188.66	3.06

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	42,855,512.44	5.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,855,512.44	5.23

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	236,000	24,024,302.14	2.93
2	019638	20 国债 09	184,000	18,831,210.30	2.30

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	404,444.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	162,193.64
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	566,638.29

#### 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	华泰柏瑞研究精选 A	华泰柏瑞研究精选 C
报告期期初基金份额总额	535,334,570.90	48,737,095.56
报告期期间基金总申购份额	6,779,060.09	498,778.11
减：报告期期间基金总赎回份额	34,229,145.69	12,520,191.06
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	507,884,485.30	36,715,682.61

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 7 月 21 日