

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  
2023 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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、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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 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	49

7.7	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	49
7.8	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	50
7.9	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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	市场中性策略执行情况	50
7.13	投资组合报告附注	50
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>51</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3	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	52
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	52
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>52</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>52</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	52
10.2	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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	57
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>58</b>
11.1	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	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>59</b>
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	华泰柏瑞量化绝对收益混合
基金主代码	001073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 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
报告期末基金份额总额	41,118,561.94 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
投资策略	在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。
业绩比较基准	三个月银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	021-60637228
传真	021-38601799	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	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
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 上海证大五道口广场 1 号 17 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,709,417.43
本期利润	3,412,407.34
加权平均基金份额本期利润	0.0311
本期加权平均净值利润率	2.99%
本期基金份额净值增长率	2.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,024,799.82
期末可供分配基金份额利润	0.0249
期末基金资产净值	42,143,361.76
期末基金份额净值	1.0249
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	25.48%

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

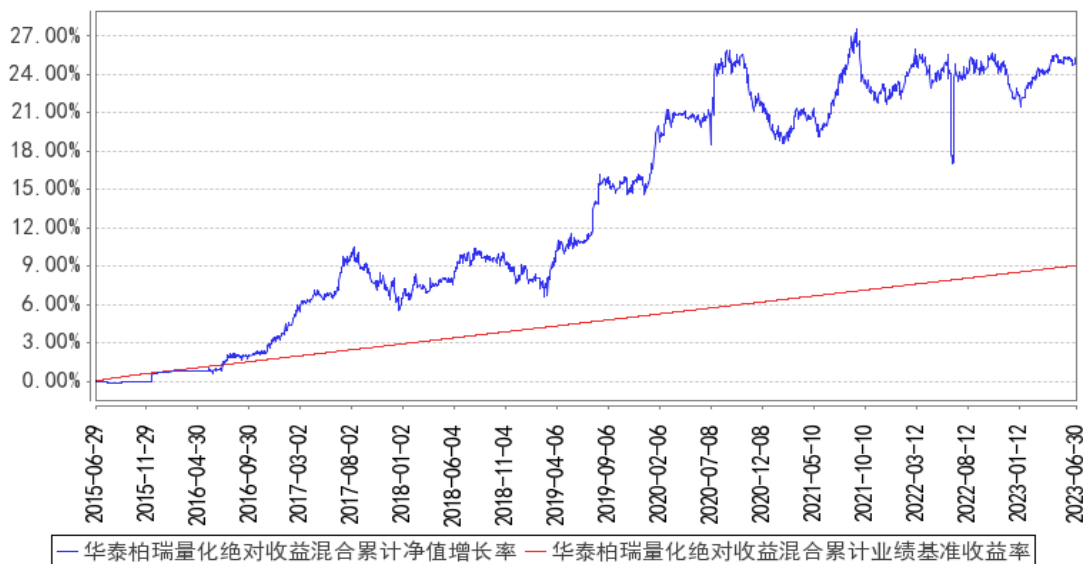
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.12%	0.13%	0.09%	0.00%	0.03%	0.13%
过去三个月	1.06%	0.16%	0.28%	0.00%	0.78%	0.16%
过去六个月	2.78%	0.19%	0.55%	0.00%	2.23%	0.19%
过去一年	1.89%	0.23%	1.12%	0.00%	0.77%	0.23%
过去三年	3.53%	0.31%	3.35%	0.00%	0.18%	0.31%

自基金合同生效起至今	25.48%	0.26%	9.06%	0.00%	16.42%	0.26%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

### 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

华泰柏瑞量化绝对收益混合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：图示日期为 2015 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日。

## § 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)、华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳斯达克 100

交易型开放式指数证券投资基金（QDII），华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金，华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金，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发起式联接基金，华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金，华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金，华泰柏瑞致远混合型证券投资基金，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发起式联接基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 3,348.66 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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2015 年 6 月 29 日	-	21 年	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2021 年 11 月任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任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的基金经理。2016 年 5 月起任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的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞

					<p>中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。</p>
盛豪	<p>量化与海外投资部总监、本基金的基金经理</p>	<p>2021 年 9 月 17 日</p>	-	15 年	<p>英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。现任量化与海外投资部总监。2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月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。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 11 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金和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的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞</p>

					上证 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------

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。任职日期和离任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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
盛豪	公募基金	8	2,360,798,212.05	2015年10月13日
	私募资产管理计划	1	11,919,305.16	2022年12月13日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	2,372,717,517.21	-

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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 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

2023 年上半年度，市场经历了疫后基本面修复、到政策与经济增长预期转弱、到经济基本面转弱市场信心不足这几个阶段。在这种宏观背景下，A 股市场整体呈现震荡格局，市场轮动速度显著加快。另一方面，主题行业愈演愈烈，上半年 TMT 和中特估指数分别上涨 25.75% 和 25.04%，而顺周期行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别下跌 5.43% 和 0.75%，成长性个股占比较高的创业板指下跌 5.61%，中小市值指数国证 2000、中证 1000 和中证 500 收获正收益，分别涨 7.08%、5.10% 和 2.29%。横向比较来看，中小市值与价值板块相对较强，成长板块下跌较多。

本报告期初，股指期货 IF 基差升水跟随市场情绪回升而大幅走阔，其后随着市场情绪降温而回归平水，二季度基差实际波动较小，IF 基差主要跟随成分股分红预期和分红的实施而波动。

报告期内，本基金继续采用完全对冲的中性策略，通过量化选股模型构建跟踪沪深 300 指数的增强股票组合，同时利用沪深 300 股指期货合约进行对冲，以获得绝对收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0249 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.78%，业绩比较基准收益率为 0.55%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

量化对冲策略的对冲成本方面，目前股指期货 IF 合约已经基本处于升水状态，长期来看，除非市场上关于对冲的供需环境发生长远性改变，我们认为股指期货基差将在一个合理区间范围运行，不会太久地脱离锚定水平，未来量化对冲策略的对冲成本有望维持较低。后续我们会衡量模型的预期超额收益以及未来基差走势，来决定对冲仓位水平，我们的策略不依赖于短线基差套利，但基差若有大的波动机会也将尽力把握。

量化对冲策略的超额收益方面，上半年估值和成长因子均表现稳健，我们预期未来的市场风格可能会更加有利于华泰柏瑞量化模型获取超额收益。政策面和消息面的扰动始终影响较短，市场主线是会回归到股票的基本面上，有利于基于基本面的量化模型发挥选股实力。未来大小市值、各行业股票的表现可能更加均衡，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用完全对冲的量化策略，在坚持控制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的绝对收益。

## 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 25%。本基金于 2023 年 3 月 24 日进行了本年度的第一次利润分配，每 10 份基金份额获得 0.5200 元红利。

#### 4.8 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

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	2,913,311.75	1,345,464.26
结算备付金		2,967,873.79	6,941,165.11
存出保证金		3,881,044.72	13,484,210.20
交易性金融资产	6.4.7.2	32,578,947.60	112,450,220.71
其中：股票投资		32,578,947.60	112,435,111.81
基金投资		-	-
债券投资		-	15,108.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		204,429.14	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		42,545,607.00	134,221,060.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		86,535.42	191,541.82
应付托管费		14,422.58	31,923.63
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		19,254.71	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	282,032.53	380,770.24
负债合计		402,245.24	604,235.69
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	41,118,561.94	127,469,518.12
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,024,799.82	6,147,306.47
净资产合计		42,143,361.76	133,616,824.59
负债和净资产总计		42,545,607.00	134,221,060.28

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0249 元，基金份额总额 41,118,561.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,505,725.32	1,982,015.13
1. 利息收入		81,768.65	294,058.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	81,768.65	284,556.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	9,502.45
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,720,633.70	11,126,821.40
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,895,393.90	-7,922,964.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9,243.87	17,453.72
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	553,167.13	17,409,759.29
股利收益	6.4.7.19	612,349.20	1,622,572.54
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）	6.4.7.20	6,121,824.77	-9,515,568.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-



5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	22, 765. 60	76, 703. 88
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1, 093, 317. 98</b>	<b>1, 685, 472. 26</b>
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	852, 391. 24	1, 281, 380. 82
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	142, 065. 27	213, 563. 45
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		2, 063. 00	91, 030. 09
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	96, 798. 47	99, 497. 90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3, 412, 407. 34</b>	<b>296, 542. 87</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3, 412, 407. 34</b>	<b>296, 542. 87</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3, 412, 407. 34</b>	<b>296, 542. 87</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	127, 469, 518. 12	-	6, 147, 306. 47	133, 616, 824. 59
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）	127, 469, 518. 12	-	6, 147, 306. 47	133, 616, 824. 59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-86, 350, 956. 18	-	-5, 122, 506. 65	-91, 473, 462. 83
（一）、综合收益总额	-	-	3, 412, 407. 34	3, 412, 407. 34

(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)	-86,350,956.18	-	-2,835,387.23	-89,186,343.41
其中:1.基金申购款	520,281.29	-	9,176.11	529,457.40
2.基金赎回款	-86,871,237.47	-	-2,844,563.34	-89,715,800.81
(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)	-	-	-5,699,526.76	-5,699,526.76
(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)	41,118,561.94	-	1,024,799.82	42,143,361.76
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30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)	117,667,755.57	-	27,142,441.79	144,810,197.36
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)	117,667,755.57	-	27,142,441.79	144,810,197.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	41,973,449.18	-	-9,172,041.97	32,801,407.21
(一)、综合收益总额	-	-	296,542.87	296,542.87
(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)	41,973,449.18	-	9,903,154.66	51,876,603.84
其中:1.基金申购款	114,897,601.91	-	25,461,086.61	140,358,688.52

2. 基金赎回款	-72,924,152.73	-	-15,557,931.95	-88,482,084.68
(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)	-	-	-19,371,739.50	-19,371,739.50
(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)	159,641,204.75	-	17,970,399.82	177,611,604.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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(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[2015]42号《关于准予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注册的批复》核准,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《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式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 496,894,780.21 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(2015)第 801 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2015 年 6 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 496,952,339.78 份基金份额,其中认购资金利息折合 57,559.57 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。发起资金认购部分为 10,002,400.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《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基金合同》和《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招募说明书》的有关规定，本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、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、银行存款等固定收益类资产和现金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。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：三个月银行定期存款税后收益率。

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 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 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》、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,913,311.75
等于：本金	2,913,037.04
加：应计利息	274.71
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	2,913,311.75

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	34,581,978.10	-	32,578,947.60	-2,003,030.50
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	34,581,978.10	-	32,578,947.60	-2,003,030.50

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	-32,845,380.00	-	-	
其中：股指期 货投资	-32,845,380.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	-32,845,380.00	-	-	

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2307	沪深300股指 期货 2307	-28.00	-32,175,360.00	670,020.00

合计				670,020.00
减：可抵销期货 暂收款				670,020.00
净额				0.00

#### 6.4.7.3.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 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。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 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。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。



#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	195,252.08
其中：交易所市场	195,252.08
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	282,032.53

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,469,518.12	127,469,518.12
本期申购	520,281.29	520,281.29
本期赎回（以“-”号填列）	-86,871,237.47	-86,871,237.47
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	41,118,561.94	41,118,561.94

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《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基金合同》和《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招募说明书》的有关规定，本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未有其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,015,623.53	-15,868,317.06	6,147,306.47
本期利润	-2,709,417.43	6,121,824.77	3,412,407.34
本期基金份额交易产生的变动数	-8,754,791.18	5,919,403.95	-2,835,387.23
其中：基金申购款	47,983.68	-38,807.57	9,176.11
基金赎回款	-8,802,774.86	5,958,211.52	-2,844,563.34
本期已分配利润	-5,699,526.76	-	-5,699,526.76
本期末	4,851,888.16	-3,827,088.34	1,024,799.82

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	22,893.12
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	58,744.69
其他	130.84
合计	81,768.65

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,895,393.90
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	-2,895,393.90

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	131,987,758.98
减：卖出股票成本总额	134,572,694.24
减：交易费用	310,458.64
买卖股票差价收入	-2,895,393.90

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	7.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,236.38
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	9,243.87

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	46,247.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	37,000.00
减：应计利息总额	9.59
减：交易费用	1.86
买卖债券差价收入	9,236.38

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	553,167.13

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	612,349.20
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	612,349.20

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	7,582,373.57
股票投资	7,585,480.37
债券投资	-3,106.80
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-1,460,548.80
权证投资	-
期货投资	-1,460,548.80
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	6,121,824.77

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	22,708.18
基金转换费收入	57.42
合计	22,765.60

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 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

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 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	9,000.00
银行划款手续费	1,018.02
合计	96,798.47

#### 6.4.7.24 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，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东的子公司

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	-	-	37,530,146.02	15.47

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30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 (%)
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	34,815.21	15.81	-	-

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	852,391.24	1,281,380.82
其中：支付销售机构的客户维护费	80,688.51	83,305.36

注：支付基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.50% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	142,065.27	213,563.45

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

##### 6.4.10.4.2 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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
基金合同生效日（2015年6月29日）持有的基金份额	10,002,400.00	10,002,400.00
报告期初持有的基金份额	18,752,966.66	18,752,966.66
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	18,752,966.66	18,752,966.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.6071%	11.7470%

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,913,311.75	22,893.12	8,907,753.76	19,676.23



注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	601916.SH	浙商银行	网上配股	14,970	30239.4
华泰联合证券	118031.SH	天 23 转债	网上配售	160	16,000.00
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	688046	药康生物	网下申购	5,680	127,970.40
华泰联合证券	688209	英集芯	网下申购	3,411	82,648.53

#### 6.4.10.8 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须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份 基金份 额分 红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 3 月 24 日	-	2023 年 3 月 24 日	0.5200	5,371,950.29	327,576.47	5,699,526.76	-
合计	-	-	-	0.5200	5,371,950.29	327,576.47	5,699,526.76	-

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
601061	中 信	2023 年 3 月	6 个月	新 股 锁 定	6.58	7.58	349	2,296.42	2,645.42	-

	金属	30 日		期内						
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	10.36	11.84	123	1,274.28	1,456.32	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	11.66	12.26	107	1,247.62	1,311.82	-
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	配股流通受限	2.02	2.64	14,970	30,239.40	39,520.80	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	25.98	24.53	38	987.24	932.14	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	17.80	17.89	118	2,100.40	2,111.02	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	26.66	31.50	105	2,799.30	3,307.50	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	39.99	36.71	115	4,598.85	4,221.65	-
688486	龙迅股份	2023 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	64.76	105.13	666	43,130.16	70,016.58	-
688502	茂莱光学	2023 年 2 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	69.72	178.59	514	35,836.08	91,795.26	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	35.00	51.23	73	2,555.00	3,739.79	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行

股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、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。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截止本报告期末，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余额 0 元，无债券作为质押。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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、债券投资和股指期货投资等。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，将风险控制可在承受的范围内。

#### 6.4.13.2 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中国建设银行，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 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (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 0.01%)。

#### 6.4.13.3 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于约定开放日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于开放期内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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，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 6.4.12。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 2023 年 6 月 30 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。

于开放期内，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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30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
<b>资产</b>							
银行存款	2,913,311.75	-	-	-	-	-	2,913,311.75
结算备付金	2,967,873.79	-	-	-	-	-	2,967,873.79
存出保证金	3,881,044.72	-	-	-	-	-	3,881,044.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	32,578,947.60	32,578,947.60
应收清算款	-	-	-	-	-	204,429.14	204,429.14
<b>资产总计</b>	<b>9,762,230.26</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>32,783,376.74</b>	<b>42,545,607.00</b>
<b>负债</b>							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	86,535.42	86,535.42
应付托管费	-	-	-	-	-	14,422.58	14,422.58
应交税费	-	-	-	-	-	19,254.71	19,254.71
其他负债	-	-	-	-	-	282,032.53	282,032.53
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>402,245.24</b>	<b>402,245.24</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>9,762,230.26</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>32,381,131.50</b>	<b>42,143,361.76</b>
上年度末 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
<b>资产</b>							
银行存款	1,345,464.26	-	-	-	-	-	1,345,464.26
结算备付金	6,941,165.11	-	-	-	-	-	6,941,165.11
存出保证金	21,434.20	-	-	-	-	13,462,776.00	13,484,210.20
交易性金融资产	-	-	-	-	15,108.90	112,435,111.81	112,450,220.71
<b>资产总计</b>	<b>8,308,063.57</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15,108.90</b>	<b>125,897,887.81</b>	<b>134,221,060.28</b>
<b>负债</b>							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	191,541.82	191,541.82
应付托管费	-	-	-	-	-	31,923.63	31,923.63

其他负债	-	-	-	-	380,770.24	380,770.24
负债总计	-	-	-	-	604,235.69	604,235.69
利率敏感度缺口	8,308,063.57	-	-	-15,108.90	125,293,652.12	133,616,824.59

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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的股票，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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	32,578,947.60	77.31	112,435,111.81	84.15
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	32,578,947.60	77.31	112,435,111.81	84.15

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除三个月银行定期存款收益率(税后)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	三个月银行定期存款收益率(税后)上升 5%	106,167.20	232,827.28
三个月银行定期存款收益率(税后)下降 5%	-106,167.20	-232,827.28	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	32,357,889.30	112,251,685.19
第二层次	39,520.80	-
第三层次	181,537.50	198,535.52
合计	32,578,947.60	112,450,220.71



#### 6.4.14.2.2 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	32,578,947.60	76.57
	其中：股票	32,578,947.60	76.57
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	5,881,185.54	13.82
8	其他各项资产	4,085,473.86	9.60
9	合计	42,545,607.00	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	238,900.00	0.57
B	采矿业	1,462,020.55	3.47
C	制造业	17,859,633.27	42.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	920,425.00	2.18
E	建筑业	1,080,905.02	2.56
F	批发和零售业	782,736.56	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	432,511.20	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,799,754.46	4.27
J	金融业	6,987,071.54	16.58
K	房地产业	625,485.00	1.48
L	租赁和商务服务业	207,312.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	182,193.00	0.43
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	32,578,947.60	77.31

### 7.2.2 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。

## 7.3 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	600519	贵州茅台	730	1,234,430.00	2.93
2	300750	宁德时代	5,040	1,153,101.60	2.74
3	601318	中国平安	18,067	838,308.80	1.99
4	000333	美的集团	10,600	624,552.00	1.48
5	600036	招商银行	16,277	533,234.52	1.27
6	000858	五粮液	2,800	457,996.00	1.09
7	002594	比亚迪	1,500	387,405.00	0.92
8	601138	工业富联	14,200	357,840.00	0.85
9	601166	兴业银行	22,800	356,820.00	0.85

10	601668	中国建筑	61,200	351,288.00	0.83
11	000001	平安银行	30,900	347,007.00	0.82
12	000651	格力电器	9,200	335,892.00	0.80
13	601328	交通银行	57,600	334,080.00	0.79
14	300059	东方财富	23,100	328,020.00	0.78
15	600919	江苏银行	43,900	322,665.00	0.77
16	601899	紫金矿业	27,400	311,538.00	0.74
17	601288	农业银行	86,600	305,698.00	0.73
18	600438	通威股份	8,600	295,066.00	0.70
19	600050	中国联通	61,300	294,240.00	0.70
20	600276	恒瑞医药	6,000	287,400.00	0.68
21	601699	潞安环能	17,600	287,232.00	0.68
22	601601	中国太保	10,900	283,182.00	0.67
23	600309	万华化学	3,200	281,088.00	0.67
24	601211	国泰君安	19,400	271,406.00	0.64
25	600039	四川路桥	27,020	265,066.20	0.63
26	002459	晶澳科技	6,120	255,204.00	0.61
27	603369	今世缘	4,800	253,440.00	0.60
28	002475	立讯精密	7,700	249,865.00	0.59
29	688599	天合光能	5,808	247,478.88	0.59
30	002466	天齐锂业	3,500	244,685.00	0.58
31	600732	爱旭股份	7,840	241,080.00	0.57
32	000100	TCL 科技	60,630	238,882.20	0.57
33	601186	中国铁建	24,200	238,370.00	0.57
34	601728	中国电信	41,000	230,830.00	0.55
35	000568	泸州老窖	1,100	230,527.00	0.55
36	000776	广发证券	15,400	226,534.00	0.54
37	601818	光大银行	73,100	224,417.00	0.53
38	002304	洋河股份	1,700	223,295.00	0.53
39	000596	古井贡酒	900	222,642.00	0.53
40	601658	邮储银行	45,500	222,495.00	0.53
41	002371	北方华创	700	222,355.00	0.53
42	600809	山西汾酒	1,200	222,084.00	0.53
43	002410	广联达	6,800	220,932.00	0.52
44	600089	特变电工	9,872	220,046.88	0.52
45	300450	先导智能	5,900	213,403.00	0.51
46	600741	华域汽车	11,500	212,290.00	0.50
47	600585	海螺水泥	8,900	211,286.00	0.50
48	002384	东山精密	8,100	209,790.00	0.50
49	300308	中际旭创	1,400	206,430.00	0.49
50	600570	恒生电子	4,500	199,305.00	0.47
51	300122	智飞生物	4,500	198,900.00	0.47
52	605117	德业股份	1,300	194,415.00	0.46

53	601390	中国中铁	24,900	188,742.00	0.45
54	601398	工商银行	39,000	187,980.00	0.45
55	600030	中信证券	9,410	186,129.80	0.44
56	600483	福能股份	15,800	182,490.00	0.43
57	000768	中航西飞	6,800	181,900.00	0.43
58	600566	济川药业	6,200	180,048.00	0.43
59	603939	益丰药房	4,820	178,340.00	0.42
60	000408	藏格矿业	7,900	178,303.00	0.42
61	601336	新华保险	4,848	178,260.96	0.42
62	601766	中国中车	27,300	177,450.00	0.42
63	300861	美畅股份	4,000	173,480.00	0.41
64	601916	浙商银行	64,870	171,256.80	0.41
65	002600	领益智造	24,700	170,677.00	0.40
66	002444	巨星科技	7,800	170,664.00	0.40
67	601988	中国银行	43,000	168,130.00	0.40
68	600019	宝钢股份	29,700	166,914.00	0.40
69	600863	内蒙华电	39,500	163,925.00	0.39
70	300628	亿联网络	4,660	163,426.20	0.39
71	605123	派克新材	1,500	162,975.00	0.39
72	603129	春风动力	1,000	161,900.00	0.38
73	601012	隆基绿能	5,629	161,383.43	0.38
74	601319	中国人保	27,300	159,432.00	0.38
75	000923	河钢资源	11,800	159,300.00	0.38
76	002938	鹏鼎控股	6,500	157,885.00	0.37
77	600000	浦发银行	21,744	157,426.56	0.37
78	301039	中集车辆	11,700	154,791.00	0.37
79	601998	中信银行	25,700	153,686.00	0.36
80	688006	杭可科技	4,973	151,527.31	0.36
81	002244	滨江集团	17,000	149,940.00	0.36
82	300866	安克创新	1,700	148,750.00	0.35
83	603688	石英股份	1,300	147,992.00	0.35
84	601717	郑煤机	11,700	145,665.00	0.35
85	000933	神火股份	11,200	145,600.00	0.35
86	603185	弘元绿能	1,900	141,645.00	0.34
87	688318	财富趋势	1,400	139,958.00	0.33
88	002727	一心堂	5,300	139,920.00	0.33
89	600489	中金黄金	13,200	136,356.00	0.32
90	002736	国信证券	15,600	136,188.00	0.32
91	000876	新希望	11,600	135,488.00	0.32
92	600346	恒力石化	9,300	133,269.00	0.32
93	002027	分众传媒	19,200	130,752.00	0.31
94	600999	招商证券	9,630	130,679.10	0.31
95	688036	传音控股	878	129,066.00	0.31

96	600026	中远海能	10,200	128,928.00	0.31
97	001979	招商蛇口	9,800	127,694.00	0.30
98	601137	博威合金	8,200	127,592.00	0.30
99	600383	金地集团	17,500	126,175.00	0.30
100	002422	科伦药业	4,200	124,656.00	0.30
101	688002	睿创微纳	2,779	124,499.20	0.30
102	600428	中远海特	19,600	123,480.00	0.29
103	600985	淮北矿业	10,500	120,960.00	0.29
104	300760	迈瑞医疗	400	119,920.00	0.28
105	601857	中国石油	16,000	119,520.00	0.28
106	688063	派能科技	600	118,950.00	0.28
107	002223	鱼跃医疗	3,300	118,767.00	0.28
108	603259	药明康德	1,900	118,389.00	0.28
109	002714	牧原股份	2,800	118,020.00	0.28
110	600755	厦门国贸	14,800	114,552.00	0.27
111	600958	东方证券	11,700	113,490.00	0.27
112	600929	雪天盐业	14,200	112,748.00	0.27
113	000338	潍柴动力	9,000	112,140.00	0.27
114	000528	柳 工	14,000	110,600.00	0.26
115	000063	中兴通讯	2,400	109,296.00	0.26
116	601872	招商轮船	18,700	108,273.00	0.26
117	600256	广汇能源	15,700	107,702.00	0.26
118	688390	固德威	640	106,790.40	0.25
119	601869	长飞光纤	2,820	104,368.20	0.25
120	002929	润建股份	2,400	104,184.00	0.25
121	688556	高测股份	1,960	104,154.40	0.25
122	300349	金卡智能	7,400	102,712.00	0.24
123	000002	万 科 A	7,300	102,346.00	0.24
124	600021	上海电力	9,300	100,161.00	0.24
125	000951	中国重汽	5,700	96,045.00	0.23
126	601169	北京银行	20,600	95,378.00	0.23
127	603368	柳药集团	3,800	93,898.00	0.22
128	600941	中国移动	1,000	93,300.00	0.22
129	688502	茂莱光学	514	91,795.26	0.22
130	603233	大参林	3,240	90,752.40	0.22
131	002555	三七互娱	2,600	90,688.00	0.22
132	600795	国电电力	23,600	90,388.00	0.21
133	002299	圣农发展	4,700	90,005.00	0.21
134	300033	同花顺	500	87,640.00	0.21
135	688516	奥特维	465	87,606.00	0.21
136	600061	国投资本	12,300	87,576.00	0.21
137	600436	片仔癀	300	85,908.00	0.20
138	688630	芯碁微装	960	80,659.20	0.19

139	000725	京东方 A	19,700	80,573.00	0.19
140	300454	深信服	700	79,275.00	0.19
141	000539	粤电力 A	10,600	77,380.00	0.18
142	600057	厦门象屿	8,800	76,560.00	0.18
143	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	0.18
144	603456	九洲药业	2,700	73,926.00	0.18
145	603345	安井食品	500	73,400.00	0.17
146	000552	甘肃能化	22,000	73,260.00	0.17
147	601958	金钼股份	6,500	72,475.00	0.17
148	601155	新城控股	5,000	72,050.00	0.17
149	000728	国元证券	11,000	71,720.00	0.17
150	600582	天地科技	12,300	71,709.00	0.17
151	688111	金山办公	151	71,305.22	0.17
152	603317	天味食品	4,860	71,004.60	0.17
153	688303	大全能源	1,749	70,747.05	0.17
154	300910	瑞丰新材	1,400	70,420.00	0.17
155	688486	龙迅股份	666	70,016.58	0.17
156	600901	江苏金租	16,800	69,384.00	0.16
157	000932	华菱钢铁	14,469	69,017.13	0.16
158	603392	万泰生物	1,020	68,105.40	0.16
159	000739	普洛药业	3,800	67,412.00	0.16
160	603228	景旺电子	2,600	66,690.00	0.16
161	600031	三一重工	3,900	64,857.00	0.15
162	002179	中航光电	1,420	64,397.00	0.15
163	603127	昭衍新药	1,560	63,804.00	0.15
164	002258	利尔化学	4,900	63,259.00	0.15
165	600900	长江电力	2,800	61,768.00	0.15
166	002821	凯莱英	520	61,287.20	0.15
167	000034	神州数码	2,300	61,157.00	0.15
168	688012	中微公司	390	61,015.50	0.14
169	603383	顶点软件	1,100	60,962.00	0.14
170	002756	永兴材料	970	60,731.70	0.14
171	002493	荣盛石化	5,100	59,364.00	0.14
172	600690	海尔智家	2,500	58,700.00	0.14
173	601607	上海医药	2,600	58,266.00	0.14
174	601377	兴业证券	9,500	58,140.00	0.14
175	601619	嘉泽新能	12,700	57,785.00	0.14
176	000166	申万宏源	12,400	57,288.00	0.14
177	300316	晶盛机电	800	56,720.00	0.13
178	600837	海通证券	6,100	56,242.00	0.13
179	000690	宝新能源	7,600	53,352.00	0.13
180	600066	宇通客车	3,500	51,590.00	0.12
181	300827	上能电气	1,429	51,515.45	0.12

182	000301	东方盛虹	4,200	49,644.00	0.12
183	688188	柏楚电子	254	47,894.24	0.11
184	600325	华发股份	4,800	47,280.00	0.11
185	688408	中信博	560	47,224.80	0.11
186	600096	云天化	2,700	46,089.00	0.11
187	300896	爱美客	100	44,495.00	0.11
188	300775	三角防务	1,300	43,914.00	0.10
189	002460	赣锋锂业	720	43,891.20	0.10
190	000921	海信家电	1,600	43,120.00	0.10
191	600998	九州通	4,023	41,758.74	0.10
192	000591	太阳能	6,100	41,358.00	0.10
193	600481	双良节能	2,900	40,542.00	0.10
194	300433	蓝思科技	3,200	37,632.00	0.09
195	600132	重庆啤酒	400	36,864.00	0.09
196	601577	长沙银行	4,700	36,472.00	0.09
197	601618	中国中冶	9,100	36,127.00	0.09
198	002829	星网宇达	800	35,144.00	0.08
199	000729	燕京啤酒	2,700	33,669.00	0.08
200	002120	韵达股份	3,500	33,460.00	0.08
201	300634	彩讯股份	1,200	31,680.00	0.08
202	600886	国投电力	2,500	31,625.00	0.08
203	600025	华能水电	4,400	31,372.00	0.07
204	002458	益生股份	2,500	30,875.00	0.07
205	002155	湖南黄金	2,300	28,060.00	0.07
206	000425	徐工机械	3,700	25,049.00	0.06
207	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.06
208	300274	阳光电源	200	23,326.00	0.06
209	688223	晶科能源	1,659	23,325.54	0.06
210	600362	江西铜业	1,200	22,776.00	0.05
211	600131	国网信通	1,100	22,209.00	0.05
212	601919	中远海控	2,343	22,024.20	0.05
213	000975	银泰黄金	1,800	21,060.00	0.05
214	601985	中国核电	2,700	19,035.00	0.05
215	002049	紫光国微	200	18,650.00	0.04
216	603305	旭升集团	600	16,722.00	0.04
217	601006	大秦铁路	2,200	16,346.00	0.04
218	603599	广信股份	600	16,248.00	0.04
219	601229	上海银行	2,700	15,525.00	0.04
220	002603	以岭药业	600	15,414.00	0.04
221	002142	宁波银行	600	15,180.00	0.04
222	600989	宝丰能源	1,200	15,132.00	0.04
223	601567	三星医疗	1,100	13,893.00	0.03
224	300724	捷佳伟创	100	11,235.00	0.03

225	688009	中国通号	1,800	10,440.00	0.02
226	300532	今天国际	500	10,280.00	0.02
227	600642	申能股份	1,400	9,786.00	0.02
228	000708	中信特钢	600	9,504.00	0.02
229	688187	时代电气	209	8,748.74	0.02
230	688123	聚辰股份	140	7,520.80	0.02
231	002180	纳思达	200	6,850.00	0.02
232	688484	南芯科技	115	4,221.65	0.01
233	300121	阳谷华泰	400	3,820.00	0.01
234	688535	华海诚科	73	3,739.79	0.01
235	688433	华曙高科	105	3,307.50	0.01
236	601061	中信金属	349	2,645.42	0.01
237	603135	中重科技	118	2,111.02	0.01
238	603529	爱玛科技	50	1,611.00	0.00
239	601065	江盐集团	123	1,456.32	0.00
240	600546	山煤国际	100	1,447.00	0.00
241	601133	柏诚股份	107	1,311.82	0.00
242	603125	常青科技	38	932.14	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	601318	中国平安	1,359,118.00	1.02
2	300059	东方财富	1,189,502.00	0.89
3	688390	固德威	907,537.20	0.68
4	600519	贵州茅台	883,414.00	0.66
5	300274	阳光电源	870,442.00	0.65
6	000858	五粮液	797,354.00	0.60
7	002714	牧原股份	664,742.00	0.50
8	600039	四川路桥	660,695.00	0.49
9	600276	恒瑞医药	655,371.20	0.49
10	002459	晶澳科技	640,301.00	0.48
11	601888	中国中免	597,023.00	0.45
12	002463	沪电股份	586,682.00	0.44
13	688599	天合光能	570,207.56	0.43
14	000932	华菱钢铁	545,007.00	0.41
15	000776	广发证券	526,175.00	0.39
16	300750	宁德时代	518,135.00	0.39
17	600732	爱旭股份	498,167.00	0.37
18	603688	石英股份	490,601.00	0.37
19	600309	万华化学	479,148.00	0.36
20	300558	贝达药业	463,989.00	0.35



注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	600519	贵州茅台	4,338,459.00	3.25
2	300750	宁德时代	2,484,048.40	1.86
3	601318	中国平安	2,396,552.00	1.79
4	601166	兴业银行	2,053,332.00	1.54
5	600036	招商银行	1,824,040.00	1.37
6	601601	中国太保	1,451,023.00	1.09
7	000568	泸州老窖	1,396,270.00	1.04
8	601012	隆基绿能	1,151,342.00	0.86
9	000001	平安银行	1,150,084.00	0.86
10	601728	中国电信	1,043,836.00	0.78
11	000792	盐湖股份	1,028,730.00	0.77
12	601668	中国建筑	1,026,015.00	0.77
13	600050	中国联通	1,020,822.00	0.76
14	600438	通威股份	1,020,103.00	0.76
15	002304	洋河股份	989,446.00	0.74
16	600060	海信视像	989,173.00	0.74
17	000858	五粮液	960,910.00	0.72
18	002594	比亚迪	936,041.00	0.70
19	300308	中际旭创	935,431.00	0.70
20	600919	江苏银行	930,840.00	0.70

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	47,131,049.66
卖出股票收入（成交）总额	131,987,758.98

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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。

## 7.8 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投资。

## 7.9 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。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金继续采用完全对冲策略，通过量化选股模型构建跟踪沪深 300 指数的增强股票组合，同时利用沪深 300 股指期货合约进行对冲，以获得绝对收益。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 32,578,947.60 元，占基金资产净值的比例为 77.31%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 32,175,360.00 元，占基金资产净值的比例为 76.35%，空头合约市值占股票资产的比例为 98.76%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -1,994,686.46 元，公允价值变动损益为 6,124,931.57 元。

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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，招商银行（600036）于 2022 年 8 月 31 日收到中国人民银行下发的银罚决字[2022]1 号，因违反国库管理规定，违反征信管理规定，违反清算管理规定，违反支付结算管理规定，违反账户管理规定，违反银行结算账户业务规定，未按规定履行客户身份识别义务，未按规定报送大额交易或者可疑交易报告，其他违规行为，对招商银行处以没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 万元的处罚。同时银保监会于 2022 年 9 月 9 日下发银保监罚决字[2022]48 号，罚款 460 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。

本基金本报告期末投资的前十名证券中，兴业银行（601166）于 2022 年 9 月 9 日及 2022 年 9 月 28 日受到银保监会的处罚，因违反审慎经营规则及存款业务违规，违规办理同业业务，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，故分别罚款 150 万元和 450 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前十名其他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。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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	3,881,044.72
2	应收清算款	204,429.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,085,473.86

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 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。

### 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
992	41,450.16	22,752,966.66	55.34	18,365,595.28	44.66

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	146,213.71	0.3556

### 8.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	18,752,966.66	45.61	10,002,400.00	24.33	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	18,752,966.66	45.61	10,002,400.00	24.33	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 29 日）基金份额总额	496,952,339.78
本报告期期初基金份额总额	127,469,518.12
本报告期基金总申购份额	520,281.29
减：本报告期基金总赎回份额	86,871,237.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,118,561.94

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

2023 年 4 月 18 日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 (%)	
中泰证券	2	51,363,267.66	28.80	47,653.71	29.25	-
东北证券	2	27,206,033.22	15.25	25,338.69	15.56	-
天风证券	2	24,828,934.19	13.92	23,316.58	14.31	-
招商证券	4	21,264,291.89	11.92	19,590.59	12.03	-
国盛证券	2	11,904,144.13	6.67	8,705.25	5.34	-
中信建投	3	9,502,298.00	5.33	8,352.28	5.13	-
民生证券	4	9,104,599.58	5.11	8,388.36	5.15	-
华宝证券	2	8,194,108.38	4.59	7,630.95	4.68	-
南京证券	2	5,869,024.73	3.29	5,465.66	3.36	-
东方财富证券	2	3,674,405.83	2.06	3,421.90	2.10	-

粤开证券	1	2,986,694.00	1.67	2,751.77	1.69	-
世纪证券	2	2,444,321.32	1.37	2,277.70	1.40	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

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，新增了山西证券、世纪证券、金元证券、东海证券、东莞证券、银泰证券的交易单元。

10.7.2 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 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	16,560.03	35.81	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	11,021.40	23.83	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

南京证 券	18,666.40	40.36	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-



华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
银泰证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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旗下基金参与浙商银行股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 28 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 27 日
3	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对冲策略执行情况公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 9 日
4	关于华泰柏瑞量化绝对收益策略定期	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 5 日

	开放混合型发起式证券投资基金第三十二个开放期开放申购赎回及转换业务的公告		
5	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	2023 年 4 月 19 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 30 日
7	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分红公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 23 日
8	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	2023 年 3 月 22 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	2023 年 3 月 21 日
10	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对冲策略执行情况公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 9 日
11	关于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第三十一个开放期开放申购赎回及转换业务的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 8 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可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 15 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与博时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	2023 年 2 月 08 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20230612-20230630;	18,752,966.66	0.00	0.00	18,752,966.66	45.61
	2	20230101-20230609;	64,224,802.35	0.00	64,224,802.35	0.00	0.00
个人	1	20230612-20230630;	9,417,027.69	0.00	0.00	9,417,027.69	22.90

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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 8 月 31 日