

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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，投资者在做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。

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 6 月 19 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 6 月 19 日开始计算。

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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	69

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	69
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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§ 8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	71
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
10.8 其他重大事件	75
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合	
基金主代码	001244	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	240,800,541.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
下属分级基金的交易代码	001244	006104
报告期末下属分级基金的份额总额	205,200,573.48 份	35,599,968.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略如下： 1、股票投资策略 本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。 2、固定收益资产投资策略 本基金固定收益资产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。 3、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。 4、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。 5、其他金融衍生工具投资策略

	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等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
业绩比较基准	95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
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。

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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	021-38601799	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	贾波	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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 弄证大五道口广场 1 号楼 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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
和指标	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
本期已实现收益	-836,710.03	-26,424.91

本期利润	17,447,071.20	2,565,720.96
加权平均基金份额本期利润	0.0854	0.0911
本期加权平均净值利润率	5.83%	5.96%
本期基金份额净值增长率	6.07%	5.93%
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	94,431,054.21	18,681,805.63
期末可供分配基金份额利润	0.4602	0.5248
期末基金资产净值	299,631,627.69	54,281,773.70
期末基金份额净值	1.4602	1.5248
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	70.06%	61.72%

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。

4、本基金于 2018 年 6 月 19 日新增 C 类份额。

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

华泰柏瑞量化智慧混合 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	1.74%	0.85%	-0.77%	0.89%	2.51%	-0.04%
过去三个月	-1.66%	0.79%	-5.10%	0.78%	3.44%	0.01%
过去六个月	6.07%	0.78%	2.20%	0.75%	3.87%	0.03%
过去一年	-4.69%	0.92%	-6.65%	0.91%	1.96%	0.01%
过去三年	25.76%	1.13%	2.48%	1.13%	23.28%	0.00%
自基金合同生效起 至今	70.06%	1.41%	-42.43%	1.53%	112.49 %	-0.12%

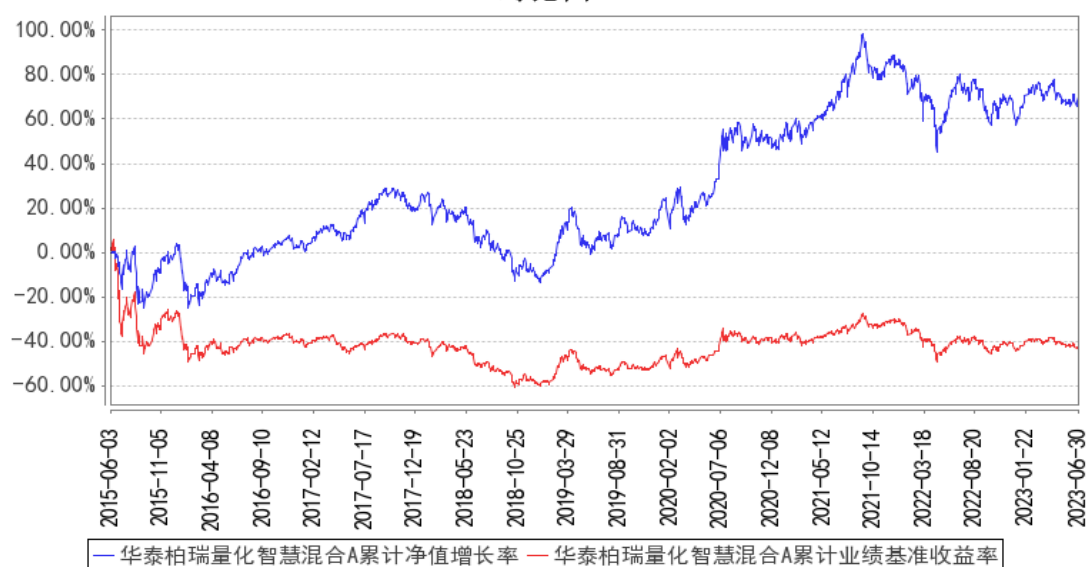
华泰柏瑞量化智慧混合 C

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
过去一个月	1.72%	0.85%	-0.77%	0.89%	2.49%	-0.04%
过去三个月	-1.72%	0.79%	-5.10%	0.78%	3.38%	0.01%
过去六个月	5.93%	0.78%	2.20%	0.75%	3.73%	0.03%
过去一年	-4.93%	0.92%	-6.65%	0.91%	1.72%	0.01%
过去三年	24.83%	1.13%	2.48%	1.13%	22.35%	0.00%
自基金合同生效起 至今	61.72%	1.26%	16.51%	1.29%	45.21%	-0.03%

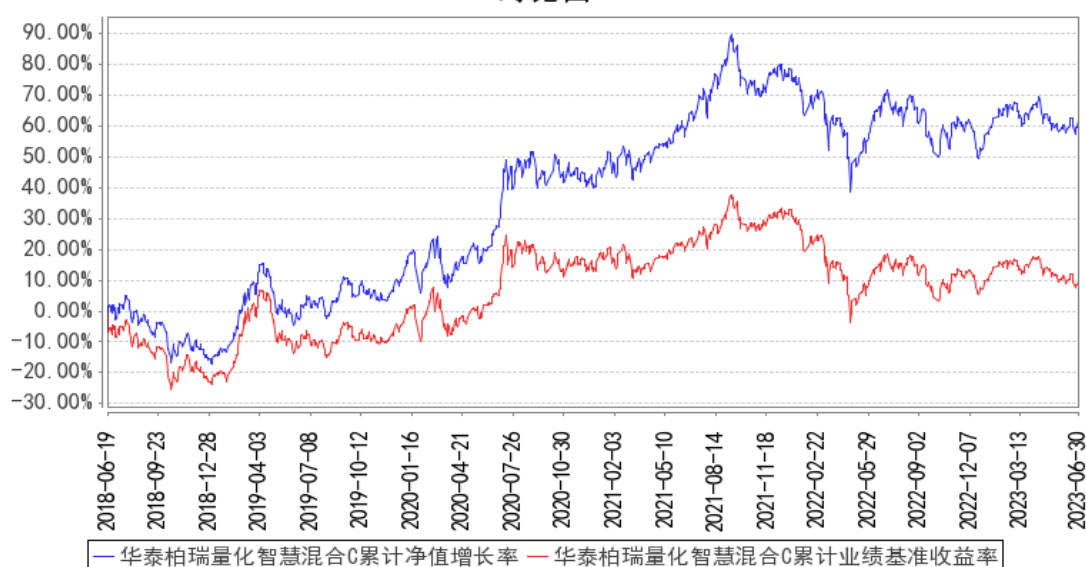
注：C 类份额业绩计算期间为 2018 年 6 月 19 日至 2023 年 6 月 30 日。

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

华泰柏瑞量化智慧混合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



华泰柏瑞量化智慧混合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：A类图示日期为2015年6月3日至2023年6月30日。C类图示日期为2018年6月19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		
笪篁	本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	-	9 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2020 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。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。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和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。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 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

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

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，A 股市场整体表现较弱，各主要股票指数在经历年初的上涨后，呈现了震荡下跌的走势。市场热点从疫后消费复苏到 AI、中特估等主题板块的轮动，再转向超跌板块的修复和可能的政策博弈。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别下跌 5.43% 和 0.75%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别下跌 5.61%、上涨 4.71%；中小市值指数中证 500 和中证 1000

分别上涨 2.29%和 5.10%。横向比较来看，中小市值与主题板块相对较强，大市值与顺周期行业下跌较多。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

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量化智慧混合 A 的基金份额净值为 1.4602 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.07%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%，截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 C 的基金份额净值为 1.5248 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.93%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2023 年上半年，在经历了一季度经济快速修复之后，随着二季度，尤其是 5 月份国内经济数据开始走弱，市场逐渐从对经济复苏的强一致预期状态切换到对国内经济复苏进度、外部经济衰退风险、产业政策发展方向等问题的分歧状态。行情结构先是延续去年年底疫后消费修复，到主题驱动的结构性情短期见顶，再调整转向政策博弈。A 股市场当前的整体估值水平已经很有吸引力，市场已经基本反映了对经济的悲观预期，投资人情绪可能已经处在恢复过程中，在这种情况下，估值修复本身也可以推动市场的上行。在不出现极端情况的前提下，我们对 2023 年的股票市场持乐观态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格会更加有利于华泰柏瑞量化模型获取超额收益。从因子表现来看，华泰柏瑞量化模型的估值因子表现依然较好，且趋势向上，同时我们的成长因子预期会继续表现良好；政策面和消息面或许会带来短期扰动，市场主线仍会回归到股票的基本面上；未来大小市值、各行业股票的表现将更加均衡；量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。尽管市场在这些方面的回归可能还会有一定的反复，但大方向上是比较确定的。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理偏低，或是很不错的买入风格均衡的量化基金的机会。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用量化选股策略，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

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	31,442,935.98	20,507,365.29
结算备付金		5,536,225.21	938,140.74
存出保证金		1,314,846.51	354,570.20
交易性金融资产	6.4.7.2	315,948,221.28	306,324,090.92
其中：股票投资		315,948,221.28	306,324,090.92
基金投资		—	—

债券投资		-	-
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		314,527.11	209,300.03
应收股利		-	-
应收申购款		185,921.58	65,066.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		354,742,677.67	328,398,533.49
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
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		56,454.35	163,810.90
应付管理人报酬		429,515.24	428,646.66
应付托管费		71,585.86	71,441.12
应付销售服务费		10,794.12	8,314.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	260,926.71	352,533.12
负债合计		829,276.28	1,024,746.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	240,800,541.55	236,594,275.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	113,112,859.84	90,779,511.65
净资产合计		353,913,401.39	327,373,787.33
负债和净资产总计		354,742,677.67	328,398,533.49

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 240,800,541.55 份，其中下属 A 类基金份额

净值 1.4602 元，基金份额总额 205,200,573.48 份；下属 C 类基金份额净值 1.5248 元，基金份额总额 35,599,968.07 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		23,135,131.58	-19,897,856.82
1. 利息收入		58,116.51	102,376.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	58,116.51	93,852.21
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		-	8,524.76
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,149,275.83	-12,822,483.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,566,254.25	-18,061,021.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	93,707.46
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	-124,860.21	-11,914.69
股利收益	6.4.7.19	4,840,390.29	5,156,745.54
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	20,875,927.10	-7,539,670.25
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	51,812.14	361,919.82
减：二、营业总支出		3,122,339.42	3,340,519.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,546,772.27	2,696,949.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	424,462.08	449,491.67

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	53,386.57	96,230.04
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	97,718.50	97,847.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,012,792.16	-23,238,376.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,012,792.16	-23,238,376.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,012,792.16	-23,238,376.13

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

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）	236,594,275.68	-	90,779,511.65	327,373,787.33
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）	236,594,275.68	-	90,779,511.65	327,373,787.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,206,265.87	-	22,333,348.19	26,539,614.06
（一）、综合收益总额	-	-	20,012,792.16	20,012,792.16
（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）	4,206,265.87	-	2,320,556.03	6,526,821.90

其中：1. 基金申购款	38,488,047.00	-	18,676,672.95	57,164,719.95
2. 基金赎回款	-34,281,781.13	-	-16,356,116.92	-50,637,898.05
（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）	240,800,541.55	-	113,112,859.84	353,913,401.39
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）	310,546,384.78	-	192,281,335.09	502,827,719.87
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）	310,546,384.78	-	192,281,335.09	502,827,719.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-64,445,349.57	-	-58,033,534.14	-122,478,883.71
（一）、综合收益总额	-	-	-23,238,376.13	-23,238,376.13
（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）	-64,445,349.57	-	-34,795,158.01	-99,240,507.58
其中：1. 基金申购款	59,128,015.58	-	26,641,014.16	85,769,029.74
2. 基金赎回款	-123,573,365.15	-	-61,436,172.17	-185,009,537.32
（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）	246,101,035.21	-	134,247,800.95	380,348,836.16

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

华泰柏瑞量化智慧灵活配置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”)证监基金字[2015]第 439 号《关于准予华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型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《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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 906,808,361.90 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 664 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 906,942,174.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 133,812.17 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，本基金自 2018 年 6 月 19 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，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

份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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，包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、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、货币市场工具、股指期货、权证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：股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0%-95%；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%。本基金的业绩比较基准为：95% X 中证 500 指数收益率+5% X 银行活期存款利率(税后)。

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》、《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型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	31,442,935.98
等于：本金	31,440,000.53
加：应计利息	2,935.45
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	31,442,935.98

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	315,479,676.41	—	315,948,221.28	468,544.87
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	315,479,676.41	-	315,948,221.28	468,544.87

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			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	10,788,732.00	-	-	
其中：股指期货投资	10,788,732.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	10,788,732.00	-	-	

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
IC2307	IC2307	9.00	10,783,440.00	-5,292.00
合计				-5,292.00
减：可抵销期货暂收款				-5,292.00
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。

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	131.53
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	174,014.73
其中：交易所市场	174,014.73
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	86,780.45
合计	260,926.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化智慧混合 A

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	210,303,880.62	210,303,880.62
本期申购	22,666,244.78	22,666,244.78
本期赎回（以“-”号填列）	-27,769,551.92	-27,769,551.92
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	205,200,573.48	205,200,573.48

华泰柏瑞量化智慧混合 C

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	26,290,395.06	26,290,395.06
本期申购	15,821,802.22	15,821,802.22
本期赎回（以“-”号填列）	-6,512,229.21	-6,512,229.21
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	35,599,968.07	35,599,968.07

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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

华泰柏瑞量化智慧混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,291,943.39	-42,064,181.46	79,227,761.93
本期利润	-836,710.03	18,283,781.23	17,447,071.20
本期基金份额交易产生的变动数	-2,772,865.62	529,086.70	-2,243,778.92
其中：基金申购款	12,708,243.16	-2,028,816.88	10,679,426.28
基金赎回款	-15,481,108.78	2,557,903.58	-12,923,205.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,682,367.74	-23,251,313.53	94,431,054.21

华泰柏瑞量化智慧混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	14,247,720.32	-2,695,970.60	11,551,749.72
本期利润	-26,424.91	2,592,145.87	2,565,720.96
本期基金份额交易产生的变动数	4,883,062.12	-318,727.17	4,564,334.95
其中：基金申购款	8,296,174.28	-298,927.61	7,997,246.67
基金赎回款	-3,413,112.16	-19,799.56	-3,432,911.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,104,357.53	-422,551.90	18,681,805.63

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	40,318.68
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	17,626.87
其他	170.96
合计	58,116.51

注：其他为结算保证金利息收入、直销申购款利息收入和期货备付金利息收入。

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	-2,566,254.25
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	-2,566,254.25

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	273,134,108.84
减：卖出股票成本总额	274,894,104.63
减：交易费用	806,258.46
买卖股票差价收入	-2,566,254.25

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

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。

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	-124,860.21

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	4,840,390.29
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	4,840,390.29

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	20,970,699.10
股票投资	20,970,699.10
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-94,772.00
权证投资	-
期货投资	-94,772.00
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	20,875,927.10

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	51,269.16
基金转换费收入	542.98
合计	51,812.14

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	1,938.05
合计	97,718.50

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

中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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	-	-	136,292,232.53	19.91

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	126,931.35	20.03	71,416.41	26.79

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	2,546,772.27	2,696,949.78
其中：支付销售机构的客户维护费	669,439.98	614,165.72

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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	424,462.08	449,491.67

注：支付基金托管人中国工商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：

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

6.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	35,679.32	35,679.32
合计	0.00	35,679.32	35,679.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	67,573.22	67,573.22
合计	0.00	67,573.22	67,573.22

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	31,442,935.98	40,318.68	26,851,718.82	40,136.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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
华泰联合证券有 限责任公司	301408.SZ	华人健康	网下申购	7,705	125,129.20
华泰联合证券有 限责任公司	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券有 限责任公司	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券有 限责任公司	603137.SH	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券有 限责任公司	688478.SH	晶升股份	网下申购	3,330	108,291.60
华泰联合证券有 限责任公司	688469.SH	中芯集成	网下申购	36,430	207,286.70
华泰联合证券有 限责任公司	688512.SH	慧智微	网下申购	5,082	106,315.44
华泰联合证券有 限责任公司	688472.SH	阿特斯	网下申购	12,242	135,886.20
华泰联合证券有 限责任公司	300804.SZ	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券有 限责任公司	688429.SH	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券有 限责任公司	601916.SH	浙商银行	网上配股	120,240	242,884.80
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
华泰联合证券有 限责任公司	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券有 限责任公司	301207	华兰疫苗	网下申购	2,299	130,767.12
华泰联合证券有 限责任公司	301256	华融化学	网下申购	15,785	127,069.25
华泰联合证券有 限责任公司	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券有 限责任公司	688046	药康生物	网下申购	9,514	214,350.42
华泰联合证券有 限责任公司	688209	英集芯	网下申购	5,730	138,837.90
华泰联合证券有	301153	中科江南	网下申购	3,526	118,755.68

限责任公司					
-------	--	--	--	--	--

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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	11.88	21.02	416	4,942.08	8,744.32	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康	2023 年 3 月	6 个月	新股	20.68	25.49	128	2,647.04	3,262.72	-

	口腔	月 29 日		锁定期内						
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.38	14.87	172	2,645.36	2,557.64	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

				期 内						
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,927	75,575.14	75,575.14	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定期内	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定期内	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	30.22	25.50	462	13,961.64	11,781.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	38.13	31.03	465	17,730.45	14,428.95	-
301292	海科	2023年6月	1个月内(含)	新股	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-

	新源	月 29 日		未上市						
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	29.60	71.42	300	8,880.00	21,426.00	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	5.00	8.96	2,422	12,110.00	21,701.12	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	25.25	19.69	510	12,877.50	10,041.90	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	32.34	31.86	348	11,254.32	11,087.28	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

				内						
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定期内	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定期内	39.06	39.36	205	8,007.30	8,068.80	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	76.80	107.95	182	13,977.60	19,646.90	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	14.81	13.73	706	10,455.86	9,693.38	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定期内	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	73.45	46.64	150	11,017.50	6,996.00	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定期内	17.55	16.75	559	9,810.45	9,363.25	-
301357	北	2023	6个月	新	50.00	48.39	184	9,200.00	8,903.76	-

	方 长 龙	年 4 月 11 日		股 锁 定 期 内						
301358	湖 南 裕 能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	23.77	42.89	432	10,268.64	18,528.48	-
301360	荣 旗 科 技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	71.88	92.60	131	9,416.28	12,130.60	-
301373	凌 玮 科 技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致 欧 科 技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	24.66	22.51	395	9,740.70	8,891.45	-
301382	蜂 助 手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	23.80	32.84	382	9,091.60	12,544.88	-
301386	未 来 电 器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	29.99	23.79	361	10,826.39	8,588.19	-
301397	溯 联 股	2023 年 6 月 15	6 个月	新 股 锁	53.27	40.20	236	12,571.72	9,487.20	-

	份	日		定期内						
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	43.99	51.57	273	12,009.27	14,078.61	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	16.24	16.95	771	12,521.04	13,068.45	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	19.99	16.90	446	8,915.54	7,537.40	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	2,498	144,034.68	144,034.68	-

301488	豪恩 汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩 汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股 未 上 市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信 金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	6.58	7.58	914	6,014.12	6,928.12	-
601065	江盐 集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	10.36	11.84	328	3,398.08	3,883.52	-
601133	柏诚 股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	11.66	12.26	289	3,369.74	3,543.14	-
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	120,240	242,884.80	317,433.60	-
603125	常青 科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 锁 定 期 内	25.98	24.53	99	2,572.02	2,428.47	-
603135	中重 科	2023 年 3 月 29	6 个月	新股 锁	17.80	17.89	308	5,482.40	5,510.12	-

	技	日		定期内						
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	36.15	38.13	311	11,242.65	11,858.43	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	18.06	1,938	38,488.68	35,000.28	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	14.16	16.21	689	9,756.24	11,168.69	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	12.10	12.07	878	10,623.80	10,597.46	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期	23.60	64.67	286	6,749.60	18,495.62	-

				内						
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	26.66	31.50	283	7,544.78	8,914.50	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	37.88	29.49	676	25,606.88	19,935.24	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	75.00	90.76	131	9,825.00	11,889.56	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	5.69	5.41	3,643	20,728.67	19,708.63	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	11.10	17.04	1,225	13,597.50	20,874.00	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	32.52	42.37	333	10,829.16	14,109.21	-
688479	友	2023	6 个月	新	33.99	29.49	219	7,443.81	6,458.31	-

	车科技	年 5 月 4 日		股 锁 定 期 内						
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	39.99	36.71	303	12,116.97	11,123.13	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	245.56	122.11	80	13,260.24	9,768.80	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	20.92	19.16	509	10,648.28	9,752.44	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	21.86	23.85	427	9,334.22	10,183.95	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	152.38	135.97	116	17,676.08	15,772.52	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新 股 锁	43.67	53.05	232	10,131.44	12,307.60	-

	工	日		定期内						
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定期内	21.17	23.50	417	8,827.89	9,799.50	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	12.68	22.31	601	7,620.68	13,408.31	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	125.80	118.03	82	10,315.60	9,678.46	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	26.74	40.68	355	9,492.70	14,441.40	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定期内	11.18	14.59	740	8,273.20	10,796.60	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	10.68	12.34	911	9,729.48	11,241.74	-

688623	双 元 科 技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	125.88	86.79	87	10,951.56	7,550.73	-
688629	华 丰 科 技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱 斯 信 息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	25.28	29.87	259	6,547.52	7,736.33	-

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，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，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工商银行，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：同)。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。

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
资产							
银行存款	31,442,935.98	-	-	-	-	-	31,442,935.98
结算备付金	5,536,225.21	-	-	-	-	-	5,536,225.21
存出保证金	1,314,846.51	-	-	-	-	-	1,314,846.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	315,948,221.28	315,948,221.28
应收申购款	-	-	-	-	-	185,921.58	185,921.58
应收清算款	-	-	-	-	-	314,527.11	314,527.11
资产总计	38,294,007.70	-	-	-	-	316,448,669.97	354,742,677.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	56,454.35	56,454.35

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	429,515.24	429,515.24
应付托管费	-	-	-	-	-	71,585.86	71,585.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,794.12	10,794.12
其他负债	-	-	-	-	-	260,926.71	260,926.71
负债总计	-	-	-	-	-	829,276.28	829,276.28
利率敏感度缺口	38,294,007.70	-	-	-	-	-315,619,393.69	353,913,401.39
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
资产							
银行存款	20,507,365.29	-	-	-	-	-	20,507,365.29
结算备付金	938,140.74	-	-	-	-	-	938,140.74
存出保证金	25,592.60	-	-	-	-	328,977.60	354,570.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-306,324,090.92	306,324,090.92
应收申购款	-	-	-	-	-	65,066.31	65,066.31
应收清算款	-	-	-	-	-	209,300.03	209,300.03
资产总计	21,471,098.63	-	-	-	-	-306,927,434.86	328,398,533.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	163,810.90	163,810.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	428,646.66	428,646.66
应付托管费	-	-	-	-	-	71,441.12	71,441.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,314.36	8,314.36
其他负债	-	-	-	-	-	352,533.12	352,533.12
负债总计	-	-	-	-	-	1,024,746.16	1,024,746.16
利率敏感度缺口	21,471,098.63	-	-	-	-	-305,902,688.70	327,373,787.33

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：同)，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。

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	315,948,221.28	89.27	306,324,090.92	93.57
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	315,948,221.28	89.27	306,324,090.92	93.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数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）
	中证 500 指数上升 5%	17,082,420.44	15,229,293.56
	中证 500 指数下降 5%	-17,082,420.44	-15,229,293.56

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	314,179,390.83	305,711,999.40
第二层次	906,917.92	—
第三层次	861,912.53	612,091.52
合计	315,948,221.28	306,324,090.92

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	315,948,221.28	89.06
	其中：股票	315,948,221.28	89.06
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	36,979,161.19	10.42
8	其他各项资产	1,815,295.20	0.51
9	合计	354,742,677.67	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	1,828,421.00	0.52
B	采矿业	17,953,587.50	5.07
C	制造业	193,538,805.72	54.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,740,403.57	3.03
E	建筑业	5,751,751.13	1.63
F	批发和零售业	13,165,195.36	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	4,562,292.20	1.29
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,841,136.16	5.89
J	金融业	28,729,401.57	8.12
K	房地产业	5,174,345.20	1.46
L	租赁和商务服务业	5,549,963.06	1.57
M	科学研究和技术服务业	2,142,424.68	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	2,197,957.98	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,000,348.00	0.28
Q	卫生和社会工作	440,393.75	0.12
R	文化、体育和娱乐业	2,331,794.40	0.66
S	综合	—	—
	合计	315,948,221.28	89.27

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	300308	中际旭创	38,000	5,603,100.00	1.58
2	600566	济川药业	92,100	2,674,584.00	0.76
3	000932	华菱钢铁	514,366	2,453,525.82	0.69
4	600732	爱旭股份	69,580	2,139,585.00	0.60
5	600582	天地科技	353,200	2,059,156.00	0.58
6	600967	内蒙一机	199,100	2,010,910.00	0.57
7	002155	湖南黄金	162,900	1,987,380.00	0.56
8	600489	中金黄金	190,700	1,969,931.00	0.56
9	300795	米奥会展	46,950	1,958,284.50	0.55
10	601137	博威合金	124,900	1,943,444.00	0.55
11	603444	吉比特	3,900	1,915,329.00	0.54
12	601699	潞安环能	113,300	1,849,056.00	0.52
13	601717	郑煤机	148,000	1,842,600.00	0.52
14	000933	神火股份	141,700	1,842,100.00	0.52
15	000728	国元证券	278,600	1,816,472.00	0.51
16	603129	春风动力	11,200	1,813,280.00	0.51
17	603688	石英股份	15,800	1,798,672.00	0.51
18	300390	天华新能	49,920	1,787,136.00	0.50
19	600901	江苏金租	429,240	1,772,761.20	0.50
20	688078	龙软科技	33,676	1,735,997.80	0.49
21	002244	滨江集团	195,800	1,726,956.00	0.49
22	688556	高测股份	32,480	1,725,987.20	0.49
23	002444	巨星科技	78,300	1,713,204.00	0.48
24	300354	东华测试	38,100	1,703,070.00	0.48
25	600285	羚锐制药	105,400	1,692,724.00	0.48
26	688006	杭可科技	55,267	1,683,985.49	0.48
27	300861	美畅股份	38,740	1,680,153.80	0.47
28	002422	科伦药业	56,100	1,665,048.00	0.47
29	600998	九州通	160,324	1,664,163.12	0.47
30	600066	宇通客车	111,800	1,647,932.00	0.47
31	300750	宁德时代	7,200	1,647,288.00	0.47
32	601601	中国太保	63,200	1,641,936.00	0.46
33	688390	固德威	9,800	1,635,228.00	0.46
34	601377	兴业证券	266,900	1,633,428.00	0.46
35	601211	国泰君安	116,600	1,631,234.00	0.46
36	600325	华发股份	163,200	1,607,520.00	0.45
37	002223	鱼跃医疗	44,500	1,601,555.00	0.45

38	603368	柳药集团	64,000	1,581,440.00	0.45
39	000923	河钢资源	114,900	1,551,150.00	0.44
40	300860	锋尚文化	27,900	1,546,776.00	0.44
41	000776	广发证券	104,500	1,537,195.00	0.43
42	300121	阳谷华泰	160,000	1,528,000.00	0.43
43	600060	海信视像	61,600	1,524,600.00	0.43
44	688501	青达环保	67,305	1,497,536.25	0.42
45	688516	奥特维	7,800	1,469,520.00	0.42
46	600782	新钢股份	394,100	1,462,111.00	0.41
47	000726	鲁 泰 A	212,700	1,454,868.00	0.41
48	600160	巨化股份	104,500	1,440,010.00	0.41
49	002829	星网宇达	32,700	1,436,511.00	0.41
50	688617	惠泰医疗	3,800	1,420,250.00	0.40
51	002978	安宁股份	44,200	1,419,262.00	0.40
52	000915	华特达因	39,900	1,408,071.00	0.40
53	600863	内蒙华电	338,900	1,406,435.00	0.40
54	601869	长飞光纤	37,500	1,387,875.00	0.39
55	000951	中国重汽	82,300	1,386,755.00	0.39
56	603920	世运电路	71,000	1,386,630.00	0.39
57	000967	盈峰环境	274,500	1,386,225.00	0.39
58	601916	浙商银行	521,040	1,375,545.60	0.39
59	600256	广汇能源	199,000	1,365,140.00	0.39
60	600755	厦门国贸	175,700	1,359,918.00	0.38
61	301179	泽宇智能	40,300	1,358,110.00	0.38
62	301039	中集车辆	101,510	1,342,977.30	0.38
63	600061	国投资本	187,500	1,335,000.00	0.38
64	601186	中国铁建	135,500	1,334,675.00	0.38
65	605009	豪悦护理	27,700	1,329,600.00	0.38
66	600985	淮北矿业	115,400	1,329,408.00	0.38
67	000690	宝新能源	189,000	1,326,780.00	0.37
68	605123	派克新材	12,200	1,325,530.00	0.37
69	300532	今天国际	64,200	1,319,952.00	0.37
70	001979	招商蛇口	101,200	1,318,636.00	0.37
71	002738	中矿资源	25,832	1,315,882.08	0.37
72	601668	中国建筑	228,700	1,312,738.00	0.37
73	600038	中直股份	32,400	1,290,168.00	0.36
74	603856	东宏股份	96,800	1,276,792.00	0.36
75	603383	顶点软件	22,900	1,269,118.00	0.36
76	600039	四川路桥	125,300	1,229,193.00	0.35
77	003000	劲仔食品	96,900	1,219,971.00	0.34
78	002475	立讯精密	37,500	1,216,875.00	0.34
79	600012	皖通高速	115,900	1,214,632.00	0.34
80	600837	海通证券	131,700	1,214,274.00	0.34

81	002384	东山精密	46,700	1,209,530.00	0.34
82	600312	平高电气	96,900	1,200,591.00	0.34
83	600483	福能股份	103,100	1,190,805.00	0.34
84	300856	科思股份	15,100	1,189,427.00	0.34
85	002463	沪电股份	56,700	1,187,298.00	0.34
86	688800	瑞可达	18,927	1,176,313.05	0.33
87	600050	中国联通	244,800	1,175,040.00	0.33
88	300839	博汇股份	87,500	1,162,875.00	0.33
89	601077	渝农商行	323,900	1,162,801.00	0.33
90	300073	当升科技	22,900	1,152,557.00	0.33
91	601958	金钼股份	103,100	1,149,565.00	0.32
92	300791	仙乐健康	38,800	1,126,752.00	0.32
93	000034	神州数码	42,300	1,124,757.00	0.32
94	000552	甘肃能化	337,600	1,124,208.00	0.32
95	600481	双良节能	80,300	1,122,594.00	0.32
96	600926	杭州银行	94,600	1,111,550.00	0.31
97	002984	森麒麟	35,200	1,107,392.00	0.31
98	301101	明月镜片	26,100	1,070,883.00	0.30
99	688239	航宇科技	15,293	1,069,745.35	0.30
100	002965	祥鑫科技	19,200	1,069,056.00	0.30
101	300570	太辰光	19,400	1,061,374.00	0.30
102	688318	财富趋势	10,600	1,059,682.00	0.30
103	600415	小商品城	124,100	1,058,573.00	0.30
104	000672	上峰水泥	115,177	1,051,566.01	0.30
105	601233	桐昆股份	78,200	1,036,150.00	0.29
106	002727	一心堂	39,000	1,029,600.00	0.29
107	300693	盛弘股份	27,690	1,022,314.80	0.29
108	688123	聚辰股份	18,980	1,019,605.60	0.29
109	002895	川恒股份	51,600	1,016,520.00	0.29
110	002937	兴瑞科技	41,000	1,008,600.00	0.28
111	601728	中国电信	179,000	1,007,770.00	0.28
112	301011	华立科技	43,000	1,007,490.00	0.28
113	600633	浙数文化	62,000	1,005,020.00	0.28
114	000921	海信家电	37,267	1,004,345.65	0.28
115	300616	尚品宅配	49,400	1,001,832.00	0.28
116	601899	紫金矿业	87,500	994,875.00	0.28
117	300775	三角防务	29,200	986,376.00	0.28
118	603529	爱玛科技	30,600	985,932.00	0.28
119	600808	马钢股份	382,700	983,539.00	0.28
120	600021	上海电力	91,300	983,301.00	0.28
121	000683	远兴能源	136,700	982,873.00	0.28
122	600362	江西铜业	51,700	981,266.00	0.28
123	688601	力芯微	20,814	980,339.40	0.28

124	600535	天士力	67,200	975,072.00	0.28
125	600057	厦门象屿	111,800	972,660.00	0.27
126	601555	东吴证券	140,100	972,294.00	0.27
127	688665	四方光电	10,424	970,682.88	0.27
128	002409	雅克科技	13,100	954,728.00	0.27
129	300622	博士眼镜	40,400	953,440.00	0.27
130	688088	虹软科技	22,257	951,486.75	0.27
131	000858	五 粮 液	5,800	948,706.00	0.27
132	002736	国信证券	108,500	947,205.00	0.27
133	600027	华电国际	140,900	942,621.00	0.27
134	002410	广联达	28,980	941,560.20	0.27
135	600761	安徽合力	47,200	940,696.00	0.27
136	000591	太阳能	136,700	926,826.00	0.26
137	002567	唐人神	137,300	913,045.00	0.26
138	601577	长沙银行	116,700	905,592.00	0.26
139	300226	上海钢联	27,940	905,256.00	0.26
140	300115	长盈精密	75,900	903,969.00	0.26
141	300349	金卡智能	64,700	898,036.00	0.25
142	300421	力星股份	75,120	896,932.80	0.25
143	002955	鸿合科技	37,900	892,545.00	0.25
144	000878	云南铜业	80,700	891,735.00	0.25
145	002938	鹏鼎控股	36,500	886,585.00	0.25
146	600109	国金证券	101,992	884,270.64	0.25
147	300037	新宙邦	17,000	882,130.00	0.25
148	000975	银泰黄金	75,300	881,010.00	0.25
149	000768	中航西飞	32,900	880,075.00	0.25
150	601966	玲珑轮胎	39,500	877,690.00	0.25
151	600741	华域汽车	47,100	869,466.00	0.25
152	688020	方邦股份	17,200	859,484.00	0.24
153	601567	三星医疗	67,400	851,262.00	0.24
154	603599	广信股份	31,400	850,312.00	0.24
155	000408	藏格矿业	37,600	848,632.00	0.24
156	000425	徐工机械	123,900	838,803.00	0.24
157	600438	通威股份	24,400	837,164.00	0.24
158	300761	立华股份	45,200	833,036.00	0.24
159	601006	大秦铁路	111,700	829,931.00	0.23
160	002389	航天彩虹	37,100	823,991.00	0.23
161	601336	新华保险	22,300	819,971.00	0.23
162	002446	盛路通信	85,400	807,030.00	0.23
163	300378	鼎捷软件	23,500	804,875.00	0.23
164	000739	普洛药业	45,100	800,074.00	0.23
165	000528	柳 工	101,100	798,690.00	0.23
166	300724	捷佳伟创	7,100	797,685.00	0.23

167	000166	申万宏源	171,500	792,330.00	0.22
168	601016	节能风电	215,530	790,995.10	0.22
169	002709	天赐材料	19,200	790,848.00	0.22
170	601318	中国平安	16,700	774,880.00	0.22
171	002993	奥海科技	22,800	773,376.00	0.22
172	603883	老百姓	25,800	770,130.00	0.22
173	300827	上能电气	21,298	767,792.90	0.22
174	600030	中信证券	38,070	753,024.60	0.21
175	688599	天合光能	17,175	731,826.75	0.21
176	002179	中航光电	16,000	725,600.00	0.21
177	603501	韦尔股份	7,400	725,496.00	0.20
178	002466	天齐锂业	10,300	720,073.00	0.20
179	688261	东微半导	5,135	718,232.45	0.20
180	002027	分众传媒	105,100	715,731.00	0.20
181	688002	睿创微纳	15,896	712,140.80	0.20
182	600409	三友化工	130,400	710,680.00	0.20
183	600642	申能股份	101,200	707,388.00	0.20
184	688518	联赢激光	25,370	706,808.20	0.20
185	688559	海目星	15,000	705,150.00	0.20
186	688630	芯碁微装	8,376	703,751.52	0.20
187	300122	智飞生物	15,900	702,780.00	0.20
188	603986	兆易创新	6,600	701,250.00	0.20
189	688037	芯源微	4,069	695,595.55	0.20
190	600096	云天化	40,700	694,749.00	0.20
191	603317	天味食品	47,460	693,390.60	0.20
192	603639	海利尔	38,500	689,920.00	0.19
193	002818	富森美	52,000	687,960.00	0.19
194	300910	瑞丰新材	13,490	678,547.00	0.19
195	003032	传智教育	46,400	676,048.00	0.19
196	603878	武进不锈	79,880	674,986.00	0.19
197	600999	招商证券	49,700	674,429.00	0.19
198	600546	山煤国际	46,400	671,408.00	0.19
199	000498	山东路桥	104,500	670,890.00	0.19
200	601168	西部矿业	63,700	669,487.00	0.19
201	002080	中材科技	32,400	664,848.00	0.19
202	300394	天孚通信	6,200	662,346.00	0.19
203	600875	东方电气	35,300	658,345.00	0.19
204	300782	卓胜微	6,800	657,084.00	0.19
205	605266	健之佳	7,800	653,874.00	0.18
206	603939	益丰药房	17,640	652,680.00	0.18
207	688095	福昕软件	5,080	642,010.40	0.18
208	002601	龙佰集团	38,700	638,550.00	0.18
209	300481	濮阳惠成	30,800	633,248.00	0.18

210	603185	弘元绿能	8,440	629,202.00	0.18
211	002600	领益智造	90,900	628,119.00	0.18
212	300700	岱勒新材	32,760	624,078.00	0.18
213	002756	永兴材料	9,880	618,586.80	0.17
214	000028	国药一致	14,170	617,953.70	0.17
215	300866	安克创新	7,000	612,500.00	0.17
216	002460	赣锋锂业	10,040	612,038.40	0.17
217	300592	华凯易佰	22,400	609,728.00	0.17
218	002371	北方华创	1,900	603,535.00	0.17
219	002100	天康生物	73,100	603,075.00	0.17
220	000543	皖能电力	89,100	588,060.00	0.17
221	688589	力合微	14,423	587,593.02	0.17
222	600398	海澜之家	84,700	582,736.00	0.16
223	603466	风语筑	41,800	581,020.00	0.16
224	601988	中国银行	148,100	579,071.00	0.16
225	603693	江苏新能	41,000	574,000.00	0.16
226	002299	圣农发展	29,600	566,840.00	0.16
227	300017	网宿科技	79,400	564,534.00	0.16
228	000807	云铝股份	44,200	562,666.00	0.16
229	003006	百亚股份	32,500	561,600.00	0.16
230	601618	中国中冶	140,100	556,197.00	0.16
231	600929	雪天盐业	69,200	549,448.00	0.16
232	000513	丽珠集团	13,900	540,849.00	0.15
233	600873	梅花生物	60,300	538,479.00	0.15
234	600909	华安证券	114,800	536,116.00	0.15
235	603127	昭衍新药	13,060	534,154.00	0.15
236	300628	亿联网络	15,100	529,557.00	0.15
237	002304	洋河股份	4,000	525,400.00	0.15
238	603233	大参林	18,720	524,347.20	0.15
239	600966	博汇纸业	88,200	522,144.00	0.15
240	603456	九洲药业	18,800	514,744.00	0.15
241	605117	德业股份	3,420	511,461.00	0.14
242	603979	金诚信	16,300	506,930.00	0.14
243	301257	普蕊斯	9,000	505,800.00	0.14
244	603035	常熟汽饰	25,800	501,294.00	0.14
245	601333	广深铁路	126,100	499,356.00	0.14
246	002283	天润工业	77,700	498,834.00	0.14
247	000001	平安银行	44,400	498,612.00	0.14
248	002532	天山铝业	82,100	491,779.00	0.14
249	600219	南山铝业	162,800	491,656.00	0.14
250	000400	许继电气	21,300	490,965.00	0.14
251	603517	绝味食品	13,200	490,380.00	0.14
252	688188	柏楚电子	2,600	490,256.00	0.14

253	688315	诺禾致源	18,271	485,095.05	0.14
254	000661	长春高新	3,500	477,050.00	0.13
255	002064	华峰化学	69,000	473,340.00	0.13
256	688625	呈和科技	11,894	466,125.86	0.13
257	688508	芯朋微	8,000	463,920.00	0.13
258	601229	上海银行	79,300	455,975.00	0.13
259	000898	鞍钢股份	162,300	451,194.00	0.13
260	688711	宏微科技	7,708	449,684.72	0.13
261	601231	环旭电子	30,000	448,800.00	0.13
262	600428	中远海特	70,400	443,520.00	0.13
263	601766	中国中车	67,600	439,400.00	0.12
264	002056	横店东磁	24,100	438,861.00	0.12
265	688408	中信博	5,200	438,516.00	0.12
266	002997	瑞鹄模具	14,700	437,031.00	0.12
267	600348	华阳股份	54,750	433,072.50	0.12
268	300842	帝科股份	4,700	429,768.00	0.12
269	002458	益生股份	34,700	428,545.00	0.12
270	300655	晶瑞电材	21,200	422,092.00	0.12
271	002085	万丰奥威	60,800	421,344.00	0.12
272	000703	恒逸石化	60,900	412,902.00	0.12
273	601658	邮储银行	84,200	411,738.00	0.12
274	002583	海能达	70,100	407,281.00	0.12
275	000822	山东海化	59,800	407,238.00	0.12
276	600718	东软集团	38,000	405,080.00	0.11
277	300595	欧普康视	13,400	404,546.00	0.11
278	301103	何氏眼科	9,600	402,816.00	0.11
279	002192	融捷股份	6,000	400,980.00	0.11
280	688289	圣湘生物	23,730	399,613.20	0.11
281	688676	金盘科技	13,185	399,373.65	0.11
282	688063	派能科技	2,000	396,500.00	0.11
283	300726	宏达电子	8,800	393,536.00	0.11
284	300389	艾比森	19,200	391,104.00	0.11
285	300457	赢合科技	22,000	388,520.00	0.11
286	000830	鲁西化工	36,700	387,552.00	0.11
287	300815	玉禾田	25,920	385,689.60	0.11
288	002545	东方铁塔	54,500	384,770.00	0.11
289	688100	威胜信息	12,831	382,492.11	0.11
290	601598	中国外运	81,800	381,188.00	0.11
291	300298	三诺生物	14,000	378,560.00	0.11
292	601328	交通银行	65,000	377,000.00	0.11
293	600026	中远海能	29,800	376,672.00	0.11
294	002517	恺英网络	23,500	369,890.00	0.10
295	600167	联美控股	52,900	368,713.00	0.10

296	600585	海螺水泥	15,500	367,970.00	0.10
297	601607	上海医药	16,400	367,524.00	0.10
298	000567	海德股份	28,435	364,536.70	0.10
299	688521	芯原股份	5,000	359,600.00	0.10
300	002139	拓邦股份	27,300	356,265.00	0.10
301	601838	成都银行	28,900	352,869.00	0.10
302	600958	东方证券	36,300	352,110.00	0.10
303	002459	晶澳科技	8,260	344,442.00	0.10
304	603889	新澳股份	45,640	342,756.40	0.10
305	000910	大亚圣象	43,500	339,735.00	0.10
306	300735	光弘科技	31,400	335,980.00	0.09
307	603489	八方股份	4,760	333,771.20	0.09
308	688621	阳光诺和	5,617	330,391.94	0.09
309	688517	金冠电气	14,963	328,587.48	0.09
310	601390	中国中铁	43,206	327,501.48	0.09
311	688112	鼎阳科技	6,200	327,236.00	0.09
312	300360	炬华科技	18,300	327,204.00	0.09
313	002607	中公教育	69,000	324,300.00	0.09
314	000002	万 科 A	22,600	316,852.00	0.09
315	600461	洪城环境	38,600	315,362.00	0.09
316	300474	景嘉微	3,500	314,965.00	0.09
317	603871	嘉友国际	20,020	314,514.20	0.09
318	000539	粤电力 A	42,600	310,980.00	0.09
319	002258	利尔化学	23,600	304,676.00	0.09
320	000708	中信特钢	19,100	302,544.00	0.09
321	002478	常宝股份	40,300	300,235.00	0.08
322	002518	科士达	7,500	300,075.00	0.08
323	600502	安徽建工	56,100	296,208.00	0.08
324	688618	三旺通信	4,288	290,383.36	0.08
325	002697	红旗连锁	49,500	289,080.00	0.08
326	600390	五矿资本	52,900	284,602.00	0.08
327	300009	安科生物	28,400	284,000.00	0.08
328	002053	云南能投	25,300	283,866.00	0.08
329	603225	新凤鸣	25,500	281,775.00	0.08
330	300224	正海磁材	21,800	280,348.00	0.08
331	688685	迈信林	13,226	279,862.16	0.08
332	603661	恒林股份	8,400	278,544.00	0.08
333	600637	东方明珠	35,300	276,046.00	0.08
334	002947	恒铭达	13,200	275,088.00	0.08
335	603369	今世缘	5,200	274,560.00	0.08
336	002897	意华股份	5,900	273,052.00	0.08
337	300871	回盛生物	16,300	268,624.00	0.08
338	601609	金田股份	41,100	266,739.00	0.08

339	002034	旺能环境	16,800	265,608.00	0.08
340	601969	海南矿业	39,500	259,910.00	0.07
341	600436	片仔癀	900	257,724.00	0.07
342	002273	水晶光电	21,100	251,934.00	0.07
343	000568	泸州老窖	1,200	251,484.00	0.07
344	002025	航天电器	3,900	248,820.00	0.07
345	300363	博腾股份	8,400	248,556.00	0.07
346	600888	新疆众和	31,000	245,520.00	0.07
347	300752	隆利科技	14,300	243,529.00	0.07
348	688077	大地熊	7,840	236,846.40	0.07
349	000999	华润三九	3,800	230,508.00	0.07
350	300384	三联虹普	13,300	225,967.00	0.06
351	603026	胜华新材	3,800	225,150.00	0.06
352	688722	同益中	12,125	224,797.50	0.06
353	688472	阿特斯	12,242	223,146.12	0.06
354	300433	蓝思科技	18,800	221,088.00	0.06
355	688578	艾力斯	8,115	218,699.25	0.06
356	600131	国网信通	10,700	216,033.00	0.06
357	603612	索通发展	12,100	209,693.00	0.06
358	002807	江阴银行	56,220	207,451.80	0.06
359	600064	南京高科	30,920	204,381.20	0.06
360	300101	振芯科技	10,300	199,717.00	0.06
361	605336	帅丰电器	11,500	197,800.00	0.06
362	002416	爱施德	26,800	197,784.00	0.06
363	603392	万泰生物	2,940	196,303.80	0.06
364	603676	卫信康	13,900	192,098.00	0.05
365	601288	农业银行	54,100	190,973.00	0.05
366	300502	新易盛	2,660	180,800.20	0.05
367	688032	禾迈股份	501	177,930.15	0.05
368	688196	卓越新能	3,778	174,732.50	0.05
369	600519	贵州茅台	100	169,100.00	0.05
370	603313	梦百合	16,600	166,498.00	0.05
371	600933	爱柯迪	7,100	165,359.00	0.05
372	603027	千禾味业	7,700	162,624.00	0.05
373	301399	英特科技	2,725	159,972.61	0.05
374	000935	四川双马	9,400	158,296.00	0.04
375	000893	亚钾国际	6,900	158,286.00	0.04
376	300232	洲明科技	17,200	157,208.00	0.04
377	605168	三人行	1,824	156,754.56	0.04
378	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.04
379	603535	嘉诚国际	9,500	154,280.00	0.04
380	002318	久立特材	9,000	153,270.00	0.04
381	600821	金开新能	22,000	151,580.00	0.04

382	688208	道通科技	5,000	151,550.00	0.04
383	688009	中国通号	25,800	149,640.00	0.04
384	000596	古井贡酒	600	148,428.00	0.04
385	002572	索菲亚	8,500	148,070.00	0.04
386	600019	宝钢股份	26,300	147,806.00	0.04
387	600380	健康元	11,503	146,203.13	0.04
388	301486	致尚科技	2,498	144,034.68	0.04
389	603096	新经典	6,940	141,298.40	0.04
390	600918	中泰证券	20,100	138,891.00	0.04
391	603128	华贸物流	14,000	127,540.00	0.04
392	603938	三孚股份	6,440	127,447.60	0.04
393	000902	新洋丰	12,300	126,444.00	0.04
394	688593	新相微	7,400	124,749.20	0.04
395	000100	TCL 科技	31,500	124,110.00	0.04
396	600995	南网储能	11,000	121,110.00	0.03
397	002563	森马服饰	19,000	118,180.00	0.03
398	600009	上海机场	2,600	118,092.00	0.03
399	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
400	688523	航天环宇	4,262	113,307.10	0.03
401	601319	中国人保	18,600	108,624.00	0.03
402	603212	赛伍技术	5,100	106,131.00	0.03
403	301305	朗坤环境	5,098	105,518.18	0.03
404	688552	航天南湖	4,163	104,535.84	0.03
405	300358	楚天科技	7,000	104,510.00	0.03
406	002483	润邦股份	18,000	104,400.00	0.03
407	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
408	300796	贝斯美	8,600	103,458.00	0.03
409	002240	盛新锂能	3,200	101,984.00	0.03
410	301332	德尔玛	7,056	100,434.88	0.03
411	002484	江海股份	4,700	100,063.00	0.03
412	301355	南王科技	5,589	98,897.25	0.03
413	600018	上港集团	18,400	96,600.00	0.03
414	603229	奥翔药业	4,600	96,508.00	0.03
415	300504	天邑股份	4,800	96,336.00	0.03
416	601222	林洋能源	11,300	92,547.00	0.03
417	688286	敏芯股份	1,400	88,172.00	0.02
418	603345	安井食品	600	88,080.00	0.02
419	300450	先导智能	2,400	86,808.00	0.02
420	002821	凯莱英	700	82,502.00	0.02
421	300888	稳健医疗	1,960	81,673.20	0.02
422	688623	双元科技	868	79,301.20	0.02
423	000012	南玻 A	13,000	77,480.00	0.02
424	603228	景旺电子	3,000	76,950.00	0.02

425	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
426	301202	朗威股份	2,927	75,575.14	0.02
427	688798	艾为电子	1,275	75,416.25	0.02
428	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
429	000488	晨鸣纸业	14,900	72,265.00	0.02
430	688120	华海清科	276	69,565.80	0.02
431	601928	凤凰传媒	5,500	62,700.00	0.02
432	000762	西藏矿业	2,100	62,223.00	0.02
433	603135	中重科技	3,074	61,936.52	0.02
434	002396	星网锐捷	2,700	60,993.00	0.02
435	600729	重庆百货	1,900	59,736.00	0.02
436	688386	泛亚微透	1,400	58,800.00	0.02
437	601108	财通证券	8,100	58,644.00	0.02
438	601881	中国银河	4,823	55,995.03	0.02
439	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.02
440	603259	药明康德	800	49,848.00	0.01
441	605369	拱东医疗	800	44,832.00	0.01
442	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
443	688249	晶合集成	1,938	35,000.28	0.01
444	000811	冰轮环境	2,200	34,672.00	0.01
445	688366	昊海生科	400	33,688.00	0.01
446	600557	康缘药业	1,200	32,952.00	0.01
447	002885	京泉华	1,500	32,760.00	0.01
448	002335	科华数据	900	32,355.00	0.01
449	002049	紫光国微	300	27,975.00	0.01
450	600521	华海药业	1,400	25,774.00	0.01
451	600963	岳阳林纸	3,200	23,584.00	0.01
452	000630	铜陵有色	8,100	23,409.00	0.01
453	002603	以岭药业	900	23,121.00	0.01
454	301301	川宁生物	2,422	21,701.12	0.01
455	301293	三博脑科	300	21,426.00	0.01
456	601012	隆基绿能	700	20,069.00	0.01
457	688443	智翔金泰	676	19,935.24	0.01
458	688469	中芯集成	3,643	19,708.63	0.01
459	301325	曼恩斯特	182	19,646.90	0.01
460	603609	禾丰股份	2,100	19,110.00	0.01
461	002605	姚记科技	400	18,572.00	0.01
462	301358	湖南裕能	432	18,528.48	0.01
463	688361	中科飞测	286	18,495.62	0.01
464	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
465	301267	华夏眼科	265	16,151.75	0.00
466	688531	日联科技	116	15,772.52	0.00
467	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00

468	688582	芯动联科	355	14,441.40	0.00
469	301291	明阳电气	465	14,428.95	0.00
470	002126	银轮股份	800	14,160.00	0.00
471	688478	晶升股份	333	14,109.21	0.00
472	688562	航天软件	601	13,408.31	0.00
473	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
474	301408	华人健康	771	13,068.45	0.00
475	301382	蜂助手	382	12,544.88	0.00
476	600170	上海建工	4,600	12,374.00	0.00
477	688543	国科军工	232	12,307.60	0.00
478	301360	荣旗科技	131	12,130.60	0.00
479	688458	美芯晟	131	11,889.56	0.00
480	688146	中船特气	311	11,858.43	0.00
481	301262	海看股份	462	11,781.00	0.00
482	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
483	688620	安凯微	911	11,241.74	0.00
484	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
485	688334	西高院	689	11,168.69	0.00
486	688484	南芯科技	303	11,123.13	0.00
487	301307	美利信	348	11,087.28	0.00
488	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
489	688352	顾中科技	878	10,597.46	0.00
490	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
491	688507	索辰科技	80	9,768.80	0.00
492	688512	慧智微	509	9,752.44	0.00
493	688581	安杰思	82	9,678.46	0.00
494	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
495	301397	溯联股份	236	9,487.20	0.00
496	605399	晨光新材	520	9,256.00	0.00
497	002050	三花智控	300	9,078.00	0.00
498	688433	华曙高科	283	8,914.50	0.00
499	301357	北方长龙	184	8,903.76	0.00
500	301376	致欧科技	395	8,891.45	0.00
501	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
502	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
503	001287	中电港	416	8,744.32	0.00
504	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
505	603232	格尔软件	600	8,724.00	0.00
506	301386	未来电器	361	8,588.19	0.00
507	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
508	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
509	301323	新莱福	205	8,068.80	0.00
510	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00

511	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
512	688631	莱斯信息	259	7,736.33	0.00
513	301439	泓淋电力	446	7,537.40	0.00
514	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
515	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
516	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
517	301345	涛涛车业	150	6,996.00	0.00
518	601061	中信金属	914	6,928.12	0.00
519	688479	友车科技	219	6,458.31	0.00
520	300982	苏文电能	100	6,056.00	0.00
521	300873	海晨股份	300	5,967.00	0.00
522	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
523	002929	润建股份	100	4,341.00	0.00
524	601065	江盐集团	328	3,883.52	0.00
525	601133	柏诚股份	289	3,543.14	0.00
526	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
527	001328	登康口腔	128	3,262.72	0.00
528	001360	南矿集团	172	2,557.64	0.00
529	603125	常青科技	99	2,428.47	0.00
530	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
531	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
532	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
533	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	002463	沪电股份	3,125,502.00	0.95
2	000932	华菱钢铁	2,602,288.00	0.79
3	688390	固德威	2,291,167.60	0.70
4	603688	石英股份	2,078,202.00	0.63
5	601137	博威合金	1,989,870.00	0.61
6	000672	上峰水泥	1,981,553.71	0.61
7	000923	河钢资源	1,927,092.00	0.59
8	300037	新宙邦	1,872,996.00	0.57
9	300795	米奥会展	1,821,734.00	0.56
10	600926	杭州银行	1,728,508.00	0.53
11	600153	建发股份	1,719,583.00	0.53
12	601377	兴业证券	1,698,522.00	0.52
13	000683	远兴能源	1,686,531.00	0.52
14	300750	宁德时代	1,671,532.54	0.51
15	601233	桐昆股份	1,663,684.00	0.51

16	688556	高测股份	1,660,967.15	0.51
17	300354	东华测试	1,656,707.00	0.51
18	688006	杭可科技	1,636,048.35	0.50
19	600755	厦门国贸	1,625,340.00	0.50
20	601699	潞安环能	1,598,210.00	0.49

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	300570	太辰光	3,484,267.00	1.06
2	002463	沪电股份	2,696,241.00	0.82
3	600153	建发股份	2,475,947.00	0.76
4	601881	中国银河	2,442,826.00	0.75
5	600060	海信视像	2,408,263.38	0.74
6	600499	科达制造	2,084,257.00	0.64
7	000629	钒钛股份	2,028,658.00	0.62
8	300916	朗特智能	1,970,015.00	0.60
9	002180	纳思达	1,911,004.00	0.58
10	300752	隆利科技	1,898,587.00	0.58
11	002649	博彦科技	1,890,690.00	0.58
12	601339	百隆东方	1,874,687.00	0.57
13	600380	健康元	1,816,881.80	0.55
14	601108	财通证券	1,807,780.00	0.55
15	601007	金陵饭店	1,765,495.00	0.54
16	603678	火炬电子	1,674,853.00	0.51
17	600383	金地集团	1,657,466.00	0.51
18	600901	江苏租赁	1,619,443.00	0.49
19	601577	长沙银行	1,600,654.00	0.49
20	605266	健之佳	1,597,653.40	0.49

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	263,547,535.89
卖出股票收入（成交）总额	273,134,108.84

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

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间基金遇到大额申赎时，我们有使用股指期货套保保持仓位。股指期货贴水时，我们选择保持一定比例的股指期货长仓，获取比较确定的超额收益。

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 投资组合报告附注

7.12.1 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

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,314,846.51
2	应收清算款	314,527.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	185,921.58
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,815,295.20

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

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（%）
华泰柏瑞量化智慧混合 A	148,506	1,381.77	76,102,700.22	37.09	129,097,873.26	62.91
华泰柏瑞量化智慧混合 C	1,681	21,177.85	29,457,089.79	82.74	6,142,878.28	17.26
合计	149,732	1,608.21	105,559,790.01	43.84	135,240,751.54	56.16

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）。

8.2 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	华泰柏瑞量化智慧混合 A	432,450.19	0.2107
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	61,992.60	0.1741
	合计	494,442.79	0.2053

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	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	华泰柏瑞量化智慧混合 A	10~50
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	0~10
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日 （2015 年 6 月 3 日） 基金份额总额	906,942,174.07	—
本报告期期初基金份额总额	210,303,880.62	26,290,395.06
本报告期基金总申购份额	22,666,244.78	15,821,802.22
减：本报告期基金总赎回份额	27,769,551.92	6,512,229.21
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	205,200,573.48	35,599,968.07

§ 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 (%)	
申万宏源	2	128,698,108.26	24.43	119,858.90	24.56	-
方正证券	2	106,917,940.61	20.30	98,503.92	20.18	-
上海证券	2	86,929,411.38	16.50	80,956.65	16.59	-
东兴证券	2	86,063,273.86	16.34	79,290.39	16.24	-
招商证券	2	57,446,528.79	10.91	53,498.07	10.96	-
广发证券	4	28,204,528.18	5.35	25,985.21	5.32	-
海通证券	1	25,171,429.28	4.78	23,190.87	4.75	-
东方证券	2	7,255,326.73	1.38	6,755.76	1.38	-
华宝证券	1	88,587.80	0.02	81.61	0.02	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：1、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。

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(%)
申万宏源	-	-	-	-	-	-

方正证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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 6 月 21 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	2023 年 6 月 16 日
5	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 6 月 3 日
6	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 5 月 9 日
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	2023 年 4 月 29 日
8	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
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 4 月 14 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	2023 年 4 月 11 日
11	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
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	2023 年 3 月 22 日

	公告		
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	2023 年 3 月 21 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 10 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	2023 年 2 月 23 日
16	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	20230101-20230630;	60,218,308.49	0.00	0.00	60,218,308.49	25.01

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