

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金

2025 年第 2 季度报告

2025 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 07 月 21 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞量化增强混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金于 2020 年 9 月 28 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 9 月 28 日开始计算。

本报告期自 2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞量化增强混合
基金主代码	000172
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 2 日
报告期末基金份额总额	905,789,992.74 份
投资目标	本基金为指数增强型混合投资基金，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8% 以内。
投资策略	本基金利用量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。 1、比较基准的标的指数：本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数

	2、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略：本基金利用定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。 (1) 多因子 alpha 模型——股票超额回报预测 (2) 风险估测模型——有效控制预期风险 (3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩 (4) 投资组合的优化 (5) 投资组合的调整 3、存托凭证投资策略 4、债券投资策略 5、金融衍生工具投资策略 6、融资融券和转融资转融券	
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+2.5%(指年收益率，评价时按期间折算)	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
下属分级基金的交易代码	000172	010234
报告期末下属分级基金的份额总额	793,407,583.60 份	112,382,409.14 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日）	
	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
1. 本期已实现收益	14,351,198.49	1,743,249.07
2. 本期利润	13,005,361.59	2,533,021.02
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0152	0.0212
4. 期末基金资产净值	1,114,182,316.19	151,970,398.10
5. 期末基金份额净值	1.404	1.352

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞量化增强混合 A

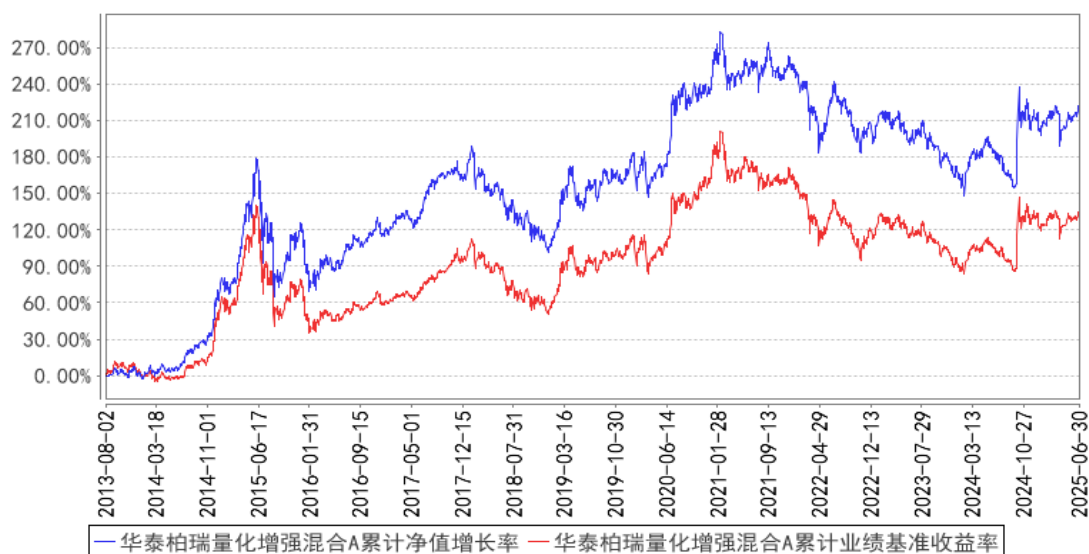
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.89%	1.11%	1.85%	1.04%	0.04%	0.07%
过去六个月	3.24%	1.01%	1.32%	0.96%	1.92%	0.05%
过去一年	14.61%	1.36%	16.00%	1.32%	-1.39%	0.04%
过去三年	-5.01%	1.06%	-4.48%	1.05%	-0.53%	0.01%
过去五年	11.54%	1.09%	8.04%	1.12%	3.50%	-0.03%
自基金合同生效起至今	221.30%	1.31%	133.54%	1.29%	87.76%	0.02%

华泰柏瑞量化增强混合 C

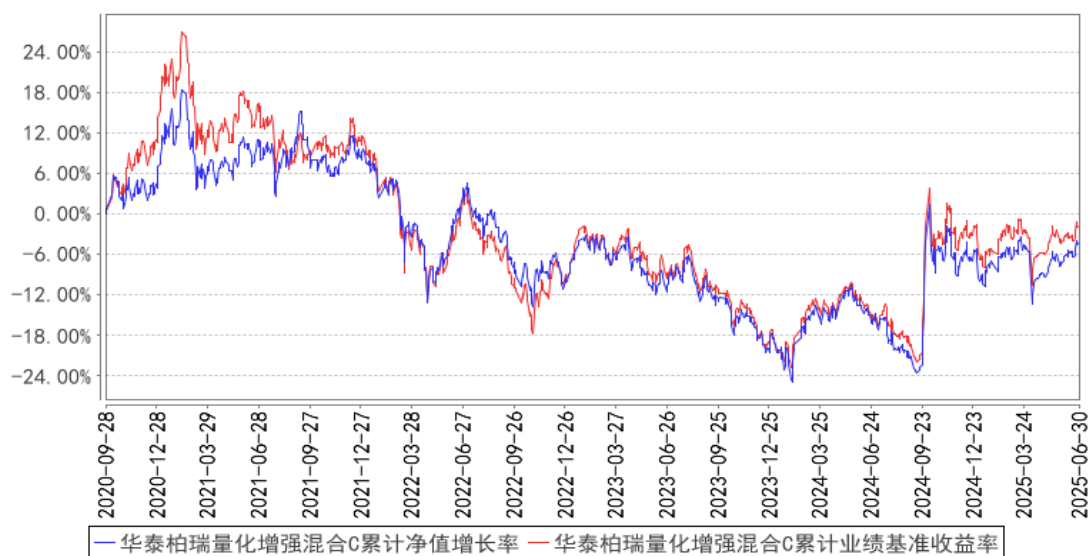
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.65%	1.11%	1.85%	1.04%	-0.20%	0.07%
过去六个月	2.81%	1.00%	1.32%	0.96%	1.49%	0.04%
过去一年	13.71%	1.36%	16.00%	1.32%	-2.29%	0.04%
过去三年	-7.35%	1.06%	-4.48%	1.05%	-2.87%	0.01%
自基金合同生效起至今	-4.13%	1.07%	-1.74%	1.09%	-2.39%	-0.02%

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

华泰柏瑞量化增强混合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



华泰柏瑞量化增强混合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2013年8月2日至2025年6月30日。C类图示日期为2020年9月28日至2025年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田汉卿	本基金的基金经理	2013年8月2日	2025年4月28日	23年	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

					月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月任公司副总经理，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 月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月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 月至 2025 年 4 月任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月至 2025 年 4 月任华泰柏瑞中证 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。
徐帅宇	本基金的基金经理	2022 年 8 月 5 日	-	8 年	美国密歇根大学量化金融与风险管理专业硕士。2017 年 4 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、基金经理助理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 1

					月起任华泰柏瑞红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理。
盛豪	量化与海外投资部总监、本基金的基金经理	2025 年 4 月 28 日	-	17 年	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。2015 年 10 月至 2024 年 9 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。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 月至 2024 年 10 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。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 月至 2023 年 9 月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 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基

					金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 04 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。
--	--	--	--	--	---

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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	7	3,093,076,125.93	2015 年 10 月 13 日
	私募资产管理计划	3	2,024,681,088.39	2024 年 11 月 8 日
	其他组合	-	-	-
	合计	10	5,117,757,214.32	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理人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 2 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年的二季度，A 股走势震荡上行，季初经历短暂关税冲击，之后整体延续反弹趋势。四月初市场从前期活跃的主题行情略有回落，临近重要关税节点，避险情绪升温。由于关税冲击，前期业绩预期较好的出口产业链股价剧烈调整。五到六月，股市活跃度维持在高位，主题行情持续到季末，市场主要宽基指数创出年内新高。二季度，A 股市场中以银行和保险为代表的高股息板块表现较好，同时军工和创新药产业链表现较为活跃，而周期和消费相关行业表现相对稳健。

本报告期，代表大市值公司的上证 50、沪深 300 分别上涨 1.74%和 1.25%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数上涨 2.62%；代表小市值公司的中证 1000 和中证 2000 指数同期涨幅分别为 2.08%和 7.62%。横向比较来看，股价弹性较大的中小市值公司以及高股息类上市公司，在二季度跑赢大市值上市公司。

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。由于我们采用相对严谨的风控措施，在风格和主题上的暴露相对较小，同时保持较高仓位运作，因而关税冲击以及之后的反弹行情中，超额收益受到的影响相对较小，超额收益波动较小。

展望未来几个季度，A 股市场面临的国内外不利因素或将逐步减小。2025 年二季度，得益于前期财政和货币政策的发力，国内经济韧性进一步加强。央行可能继续实行较为宽松的货币政策，政府和企业的融资成本有望进一步降低。同时财政有望发力，或将继续引导新增资金向科技和扩内需等方向。海外，短期美国的关税政策给全球经济发展带来不确定性，但中长期我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力。年初以来，一系列突破性的自主创新科技成果，以及国内经济在本次关税冲击中所展现的强大韧性，增强了市场对于中国经济的信心。在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的上升区间。

量化策略方面，在经历二季度普遍反弹和科技主题轮动行情后，随着财报期临近，我们认为市场或将更加关注基本面的边际变化。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的成长类因子和价值类因子近期表现较好，其趋势有望延续。短期主题轮动行情告一段落之后，市场主线或逐渐回归到股票的基本面上。同时，我们认为在后市当中，大小市值、各行业股票可能均有机会，量化投资全市场选股的优势有望得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值仍有吸引力，对于专注于捕捉基本面变化逻辑的量化投资，超额收益有望得到进一步提高，或是很不错的配置风格均衡的基本面量化基金的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞量化增强混合 A 的基金份额净值为 1.404 元，本报告期基金份额净

值增长率为 1.89%，同期业绩比较基准收益率为 1.85%，截至本报告期末华泰柏瑞量化增强混合 C 的基金份额净值为 1.352 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,165,788,296.32	91.59
	其中：股票	1,165,788,296.32	91.59
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	30,118,208.22	2.37
	其中：债券	30,118,208.22	2.37
	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	74,298,250.39	5.84
8	其他资产	2,569,154.30	0.20
9	合计	1,272,773,909.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,742,281.00	0.69
B	采矿业	76,703,848.31	6.06
C	制造业	535,205,763.75	42.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,147,289.20	3.64
E	建筑业	24,145,357.53	1.91
F	批发和零售业	2,825,646.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	37,857,334.00	2.99
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,368,200.48	4.93
J	金融业	324,109,252.85	25.60
K	房地产业	2,337,660.00	0.18
L	租赁和商务服务业	12,245,190.00	0.97
M	科学研究和技术服务业	19,808,467.20	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	3,221,736.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	2,901,758.00	0.23
Q	卫生和社会工作	7,168,512.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,165,788,296.32	92.07

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	138,451	34,920,111.22	2.76
2	600036	招商银行	702,156	32,264,068.20	2.55
3	600519	贵州茅台	18,880	26,611,737.60	2.10
4	601318	中国平安	426,756	23,676,422.88	1.87
5	601166	兴业银行	830,230	19,377,568.20	1.53
6	601899	紫金矿业	921,049	17,960,455.50	1.42
7	601138	工业富联	765,200	16,359,976.00	1.29
8	600030	中信证券	549,814	15,185,862.68	1.20
9	603259	药明康德	204,800	14,243,840.00	1.12
10	600900	长江电力	456,700	13,764,938.00	1.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,118,208.22	2.38
	其中：政策性金融债	30,118,208.22	2.38
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—

10	合计	30,118,208.22	2.38
----	----	---------------	------

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	250401	25 农发 01	300,000	30,118,208.22	2.38

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2507	沪深 300 股 指期货 2507	10	11,723,400.00	-71,100.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-71,100.00
股指期货投资本期收益（元）					-849,227.21
股指期货投资本期公允价值变动（元）					220,680.00

5.9.2 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。本报告期间因市场流动性较差或者股指期货贴水较大时，我们有使用股指期货套保调整或保持仓位。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券（600030）在报告编制日前一年内曾受到北京证券交易所的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,871,821.01
2	应收证券清算款	513,909.75
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	183,423.54
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,569,154.30

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
报告期期初基金份额总额	960,383,887.94	120,701,324.74
报告期期间基金总申购份额	13,310,605.05	12,613,707.01
减:报告期期间基金总赎回份额	180,286,909.39	20,932,622.61
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	793,407,583.60	112,382,409.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	993,006.99	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	993,006.99	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.11	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》

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

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

9.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 07 月 21 日