

华泰柏瑞战略新兴产业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 7 月 21 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 07 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。  
本报告期自 2025 年 04 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|             |                                                                                                                               |                   |
|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
| 基金简称        | 华泰柏瑞战略新兴产业混合                                                                                                                  |                   |
| 基金主代码       | 005409                                                                                                                        |                   |
| 基金运作方式      | 契约型开放式                                                                                                                        |                   |
| 基金合同生效日     | 2018 年 1 月 16 日                                                                                                               |                   |
| 报告期末基金份额总额  | 50,410,925.21 份                                                                                                               |                   |
| 投资目标        | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，把握战略新兴产业投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。                                                               |                   |
| 投资策略        | 本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，依据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握战略新兴产业的投资机会，保证整体投资业绩的持续性。                                        |                   |
| 业绩比较基准      | 本基金的业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。                                                                                    |                   |
| 风险收益特征      | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |                   |
| 基金管理人       | 华泰柏瑞基金管理有限公司                                                                                                                  |                   |
| 基金托管人       | 中国银行股份有限公司                                                                                                                    |                   |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞战略新兴产业混合<br>A                                                                                                             | 华泰柏瑞战略新兴产业混合<br>C |

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 005409          | 010032         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 49,337,430.33 份 | 1,073,494.88 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） |                |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
|                 | 华泰柏瑞战略新兴产业混合 A                      | 华泰柏瑞战略新兴产业混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | -2,708,037.98                       | -58,839.61     |
| 2. 本期利润         | -859,760.95                         | -17,655.92     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0172                             | -0.0166        |
| 4. 期末基金资产净值     | 80,808,379.45                       | 1,691,273.82   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.6379                              | 1.5755         |

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

华泰柏瑞战略新兴产业混合 A

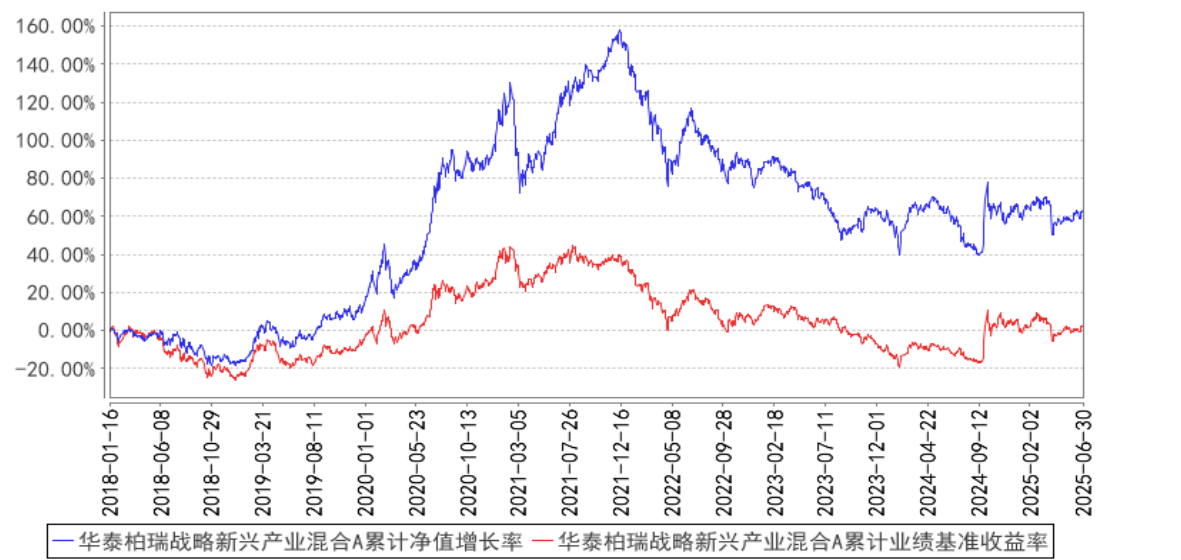
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④    |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | -1.00%  | 1.26%     | 0.20%      | 1.15%         | -1.20%  | 0.11%  |
| 过去六个月      | 0.01%   | 1.13%     | -1.04%     | 1.12%         | 1.05%   | 0.01%  |
| 过去一年       | 2.84%   | 1.39%     | 16.49%     | 1.46%         | -13.65% | -0.07% |
| 过去三年       | -24.51% | 1.13%     | -14.92%    | 1.13%         | -9.59%  | 0.00%  |
| 过去五年       | 5.43%   | 1.28%     | -5.63%     | 1.17%         | 11.06%  | 0.11%  |
| 自基金合同生效起至今 | 63.79%  | 1.30%     | 2.88%      | 1.20%         | 60.91%  | 0.10%  |

华泰柏瑞战略新兴产业混合 C

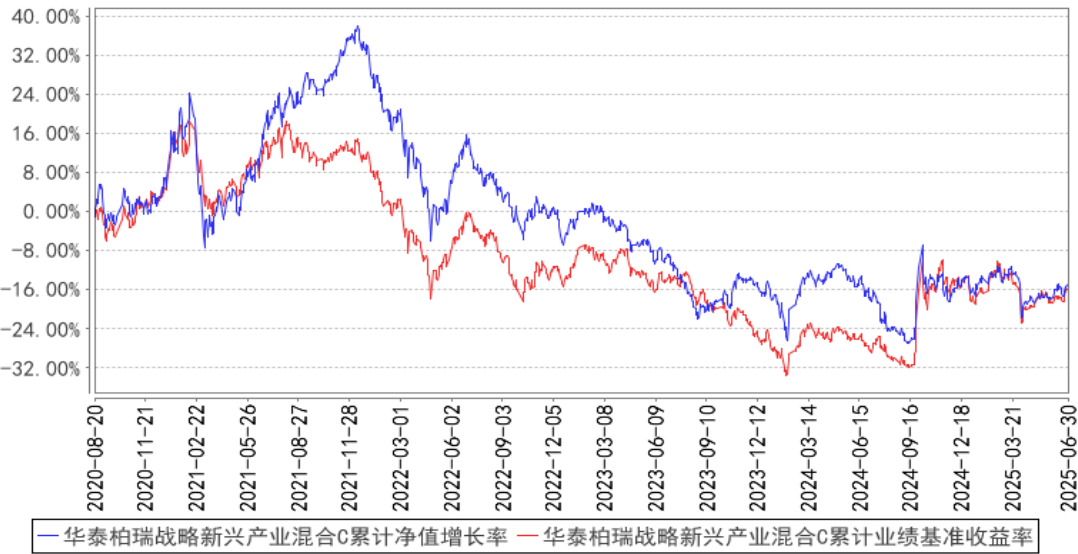
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④    |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | -1.20%  | 1.26%     | 0.20%      | 1.15%         | -1.40%  | 0.11%  |
| 过去六个月      | -0.39%  | 1.13%     | -1.04%     | 1.12%         | 0.65%   | 0.01%  |
| 过去一年       | 2.01%   | 1.39%     | 16.49%     | 1.46%         | -14.48% | -0.07% |
| 过去三年       | -26.31% | 1.13%     | -14.92%    | 1.13%         | -11.39% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | -14.80% | 1.25%     | -15.55%    | 1.15%         | 0.75%   | 0.10%  |

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

华泰柏瑞战略新兴产业混合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



华泰柏瑞战略新兴产业混合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 类份额图示日期为 2018 年 1 月 16 日至 2025 年 06 月 30 日，C 类份额图示日期为 2020 年 8 月 20 日至 2025 年 06 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                           | 任本基金的基金经理期限        |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|------------------------------|--------------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                              | 任职日期               | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 吴邦栋 | 投资二部<br>副总监、<br>本基金的<br>基金经理 | 2020 年 3 月 26<br>日 | —    | 15 年   | 上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级研究员兼基金经理助理。2018 年 3 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 8 月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 12 月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2022 年 1 月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月至 2023 年 11 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。2020 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                       |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 年 9 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月至 2023 年 10 月任华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 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 年二季度指数前低后高，期间关税一度冲击，此后又持续震荡上行创出年内新高。节奏上，从三月中下旬特朗普对等关税担忧升温开始，行情便持续震荡回调。至 4 月 2 日，对等关税

落地并大超预期，导致全球市场均出现大跌、风险偏好受到影响。但 4 月 8 日开始，随着美国股债汇“三杀”触发特朗普关税态度软化，关税博弈进入新阶段、影响由急转缓，全球资产又演绎出“风险计提”后的冲回，叠加国内决策层积极应对，交易主线迎来反转，A 股市场显著反弹、收复失地。5 月初，金融发布会一系列宽松举措集中落地、外交部表示同意与美方举行会谈，进一步提振市场情绪。直至 5 月 12 日中美发表联合声明，大幅下调前期加征关税。市场在大涨之后，亢奋情绪开始平复，行情也逐步转为震荡。期间中美经贸磋商机制首次会议在英国举行、伊以冲突爆发等多空因素交织，指数窄幅波动。直至近期，随着伊以同意全面停火、地缘冲突缓和，叠加国内经济数据整体好于预期，同时阅兵、促消费政策落地等事件催化，行情迎来快速上行，上证综指创出年内新高。整个二季度，沪深 300 涨 1.25%，中证 500 涨 0.98%，创业板指涨 2.34%。风格层面，一季度科技成长大涨过后，叠加不确定性持续扰动，二季度价值风格显著占优。另一方面，大小盘风格则随市场风险偏好和流动性交替轮动，整体较为均衡。

宏观经济方面，在消费拉动和外需韧性下，经济基本面延续韧性。具体来看，生产端，5 月规模以上工业增加值单月同比 5.8%，较前值的 6.1%有所回落，但仍高于预测的 5.7%，出口放缓所带来从需求向供给的传递可能是原因之一；消费端，5 月社会消费品零售总额出现跃升，单月同比 6.4%，高于预期的 4.9%，“两新”的政策红利仍在集中释放期；投资端，1-5 月全国固定资产投资累计同比 3.7%，略低于预期的 4.0%，主要是外部环境不确定性仍制约外向型行业投资信心，叠加地产降幅走阔。出口端，美元计价下，5 月出口同比 4.8%，前值为 8.1%。出口增速回落，对美出口仍有较快下行。尽管中美双方于 5 月 14 日前大幅下调对等关税。但考虑关税调整到出口调整也存在时滞，全月对美出口同比降幅仍走阔至 35%左右；二是需求前置和关税担忧缓解下，抢转口需求有所降温。物价方面，能源价格下行压制近期物价。5 月 CPI 同比-0.1%，与前值和前 4 个月表现持平，仍处于收缩区间。但核心通胀已连续三个月为正。5 月 PPI 同比-3.3%，较上月下行 0.6pct，主要受国际油价持续下行等输入性因素和国内煤炭等能源需求走弱影响。社融方面，5 月社融增加 2.3 万亿元，同比多增 2271 亿元，略高于市场平均预期。社融存量增速为 8.7%，与上月持平。整体来看，相比 4 月，5 月供给端已经有所改善，指向月初一揽子金融政策的积极影响。但由于需求端预期尚待进一步改善，叠加化债影响仍在，金融数据仍未明显起势。

政策层面，各项利好举措持续发力，助力经济企稳和市场信心修复。4 月初特朗普关税落地的动荡中，中央汇金提出类“平准基金”定位，监管层、官媒也集中表态呵护。4 月 25 日政治局会议强调稳就业、稳企业，加快推进存量政策落地，加力扩围“以旧换新”。5 月 7 日金融发布会，三部门协同发力，支持稳定和活跃资本市场。其中，央行宣布降准降息并优化结构性工具使用，证监会表示将大力推动中长期资金入市，抓紧印发和落实《推动公募基金高质量发展行动方案

案》，并将全力支持中央汇金公司发挥好类“平准基金”作用。6 月 24 日央行等六部门又出台《关于金融支持提振和扩大消费的指导意见》，引导金融机构从消费供给和需求两端强化金融服务，满足各类主体多样化融资需求，推动扩大高质量消费供给，助力释放消费增长潜能。而海外方面，4 月 2 日特朗普超预期的对等关税一度冲击全球，但 4 月 9 日又宣布关税暂停 90 天，带动市场风险偏好修复。另一方面，二季度美联储持续按兵不动，但近期美联储主席鲍威尔在出席国会参众两院的半年度货币政策听证会，尽管重申在经济数据未明朗前不会贸然降息，但已暗示政策调整窗口或在 9 月，而 7 月按兵不动旨在争取时间评估风险。与此同时多位美联储官员则释放了比鲍威尔更偏鸽派的信号，带动美联储降息预期升温。

行业层面，关税不确定性冲击下，4 月至 5 月下旬内需、红利方向表现出较强的超额收益，科技成长在短暂反弹后一则由于 AI 叙事退潮、二则由于风险偏好回落而继续回调。此后，随着多地传出“国补”暂停消息，叠加大涨后拥挤度上升，内需方向开始回调，内部向“新消费”缩圈。另一方面 5 月底 6 月初，随着中美关税谈判进一步推进、国内经济超预期韧性，风险偏好回升之下，科技、金融引领市场上行。

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

往后看，三季度初还需关注：1）关税谈判，根据特朗普政府在 4 月 9 日宣布的“90 天关税暂停”安排，该暂停将于 2025 年 7 月 9 日届满。中美 5 月 12 日联合声明中的对等关税暂停将在 2025 年 8 月中旬到期；2）债务上限，众议院通过《美丽大法案》，投资者已经基本确定美国的赤字不仅不会得到控制，还会进一步加剧；3）美债供给压力，日债利率上行等等。由于时间点在 7-8 月，虽然都较为明确，但也不排除在高位造成扰动。因此短期仍需警惕行情的潜在战术性调整。

但另一方面，近年宏观经济和政策托底，同时新动能持续显现、更多新的产业趋势逐渐形成，为市场提供更多结构性亮点，且增量资金依然源源不断，今年或仍是风险偏好系统性抬升的一年，需战略性保持多头思维。遇到行情拥挤、潜在风险扰动带来的短期战术性调整，可能恰是中期择机逢低布局的机会。再往后，伴随中美贸易谈判有望取得更大进展、美联储降息以及抗战胜利 80 周年纪念活动陆续展开，行情有望迎来基本面和风险偏好双改善，从而可能走出创新高之旅。

结构上，虽然当前指数已处年内高位，但从拥挤度、各行业股价分布来看，当前市场或依然有大量结构性机会可以积极挖掘：1）随着中报业绩预告陆续披露，7 月是全年最看业绩的月份之一。筛选二季度以来各行业盈利预期的调整变化，中报业绩有望改善的方向可能主要集中在部分出口链、涨价链、AI 和金融等领域；2）军工：“五年计划”交界节点的订单释放预期叠加八一、

阅兵、国庆临近下或密集催化；3）AI：修复至今，从拥挤度、滚动收益差、成交占比看，当前 AI 或依然是成长风格中位置偏低、值得配置的细分领域；4）资源品：旺季+涨价+降息预期共振，有望催化资源品行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞战略新兴产业混合 A 的基金份额净值为 1.6379 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%，截至本报告期末华泰柏瑞战略新兴产业混合 C 的基金份额净值为 1.5755 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.20%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%。

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              | 77,457,031.81 | 93.65        |
|    | 其中：股票             | 77,457,031.81 | 93.65        |
| 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      | 5,228,445.38  | 6.32         |
| 8  | 其他资产              | 20,808.42     | 0.03         |
| 9  | 合计                | 82,706,285.61 | 100.00       |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 1,546,630.72 元，占基金资产净值的比例为 1.87%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —            |
| B  | 采矿业              | 1,477,032.00  | 1.79         |
| C  | 制造业              | 66,632,135.79 | 80.77        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 669,984.00    | 0.81         |
| E  | 建筑业              | 3,462.00      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 1,087,953.00  | 1.32         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,263,465.00  | 1.53         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,640,525.00  | 3.20         |
| J  | 金融业              | 177,552.30    | 0.22         |
| K  | 房地产业             | 1,542.00      | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,523,982.00  | 1.85         |
| 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          | 12,384.00     | 0.02         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 420,384.00    | 0.51         |
| S  | 综合               | —             | —            |
|    | 合计               | 75,910,401.09 | 92.01        |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 10 能源   | —            | —            |
| 15 原材料  | —            | —            |
| 20 工业   | —            | —            |
| 25 可选消费 | 720,951.19   | 0.87         |
| 30 主要消费 | —            | —            |
| 35 医药卫生 | —            | —            |
| 40 金融   | —            | —            |
| 45 信息技术 | —            | —            |
| 50 通信服务 | 825,679.53   | 1.00         |
| 55 公用事业 | —            | —            |
| 60 房地产  | —            | —            |
| 合计      | 1,546,630.72 | 1.87         |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 13,100  | 3,304,082.00 | 4.00         |
| 2  | 000893 | 亚钾国际 | 79,300  | 2,390,102.00 | 2.90         |
| 3  | 002595 | 豪迈科技 | 40,200  | 2,380,644.00 | 2.89         |
| 4  | 300476 | 胜宏科技 | 15,100  | 2,029,138.00 | 2.46         |
| 5  | 688668 | 鼎通科技 | 27,441  | 1,713,964.86 | 2.08         |
| 6  | 002734 | 利民股份 | 89,000  | 1,628,700.00 | 1.97         |
| 7  | 688313 | 仕佳光子 | 40,911  | 1,556,663.55 | 1.89         |
| 8  | 300850 | 新强联  | 42,300  | 1,515,186.00 | 1.84         |
| 9  | 603766 | 隆鑫通用 | 117,500 | 1,499,300.00 | 1.82         |
| 10 | 601717 | 郑煤机  | 89,600  | 1,489,152.00 | 1.81         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，新强联（300850）在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，隆鑫通用（603766）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

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   | 10,212.39 |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | 10,341.36 |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | 254.67    |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 20,808.42 |

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产净<br>值比例 (%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|--------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 688313 | 仕佳光子 | 1,556,663.55       | 1.89              | 重大事项停牌       |

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                        | 华泰柏瑞战略新兴产业混<br>合 A | 华泰柏瑞战略新兴产业混<br>合 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 50,207,236.83      | 1,025,574.92       |
| 报告期期间基金总申购份额              | 52,848.25          | 65,430.18          |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 922,654.75         | 17,510.22          |
| 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               | 49,337,430.33      | 1,073,494.88       |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 7 月 21 日