

华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华泰柏瑞研究精选 |
| 基金主代码 | 007968 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 11 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 436,969,671.16 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金通过深入的基本面研究把握投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置：本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。</p> <p>2、股票投资策略：本基金主要采用“自下而上”的深度基本面研究策略，主要从公司主营业务、公司商业模式、公司财务状况、公司治理结构情况、公司所处行业和公司估值方面进行深入研究从而精选个股。</p> <p>3、债券组合投资策略：本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略：在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置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</p> |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | 价值的资产支持证券进行配置。 5、股指期货投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。 6、融资业务的投资策略：本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 007968 | 010291 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 389,263,629.35 份 | 47,706,041.81 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C |
| 1. 本期已实现收益 | -37,019,492.39 | -3,959,799.67 |
| 2. 本期利润 | 27,176,913.47 | 4,541,904.67 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0683 | 0.1060 |
| 4. 期末基金资产净值 | 484,526,406.17 | 58,214,823.82 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.2447 | 1.2203 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞研究精选 A

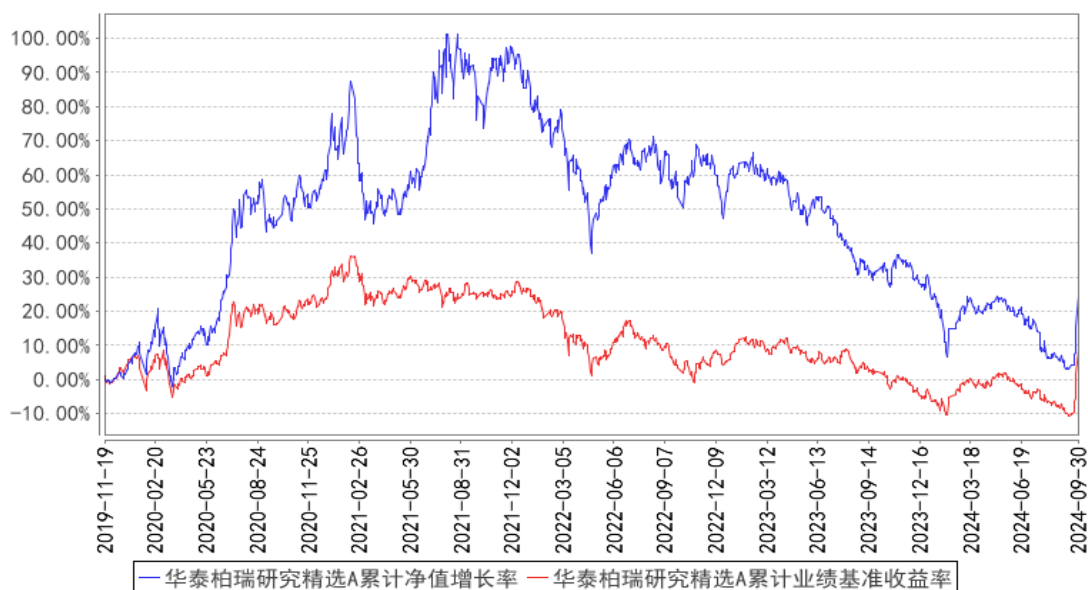
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 6.27% | 1.56% | 13.00% | 1.33% | -6.73% | 0.23% |
| 过去六个月 | 3.98% | 1.24% | 10.29% | 1.06% | -6.31% | 0.18% |
| 过去一年 | -5.45% | 1.21% | 6.34% | 0.95% | -11.79% | 0.26% |
| 过去三年 | -31.98% | 1.26% | -12.77% | 0.88% | -19.21% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.47% | 1.44% | 8.55% | 0.95% | 15.92% | 0.49% |

华泰柏瑞研究精选 C

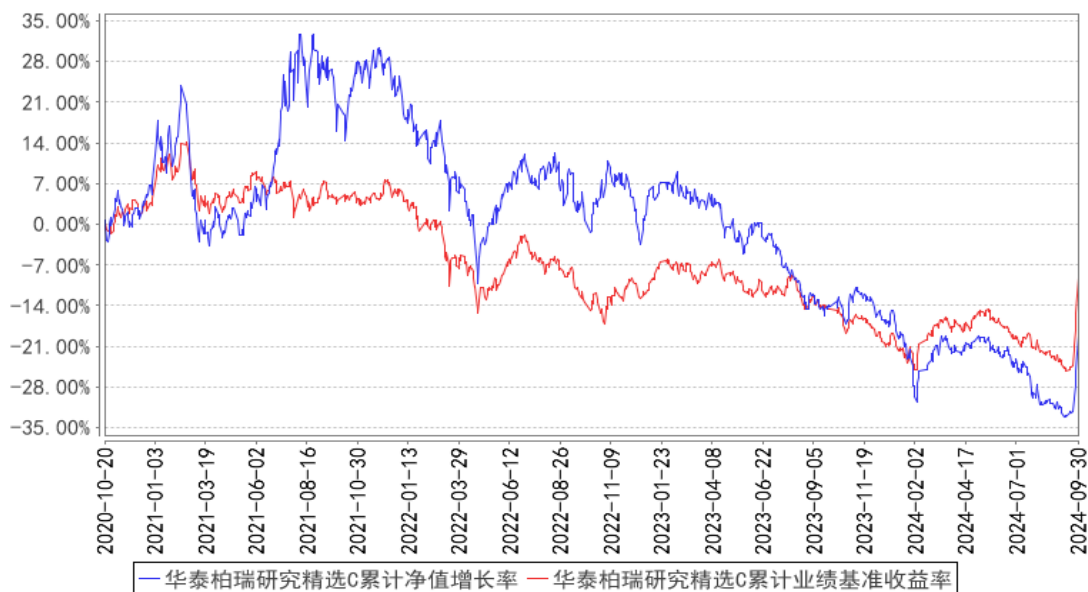
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 6.14% | 1.56% | 13.00% | 1.33% | -6.86% | 0.23% |
| 过去六个月 | 3.72% | 1.24% | 10.29% | 1.06% | -6.57% | 0.18% |
| 过去一年 | -5.91% | 1.21% | 6.34% | 0.95% | -12.25% | 0.26% |
| 过去三年 | -32.98% | 1.26% | -12.77% | 0.88% | -20.21% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | -19.17% | 1.41% | -9.15% | 0.89% | -10.02% | 0.52% |

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

华泰柏瑞研究精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞研究精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A 类图示日期为 2019 年 11 月 19 日至 2024 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2020 年 10 月 20 日至 2024 年 9 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--------------|----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴邦栋 | 投资二部副总监、本基金的 | 2023 年 6 月 9 日 | - | 14 年 | 上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月加入华泰 |

| | | | | |
|--|------|--|--|--|
| | 基金经理 | | | 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合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模

块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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

三季度市场多数时间延续回调，期间三中全会、7 月政治局会议也几次提振，但市场信心仍偏弱。基本面转弱的悲观预期之下，市场持续回调，上证综指也一度跌破 2700 点逼近低点。直至 9 月 24 日包括降准降息、降低存量房贷利率、统一房贷最低首付比例、创设两项新的结构性货币政策工具、支持企业并购重组等一系列金融政策组合拳落地，9 月 26 日政治局会议又进一步坚定市场信心，市场迎来快速上涨。整个三季度，沪深 300 涨 16.07%，中证 500 涨 16.19%，创业板指涨 29.21%。风格上，成长风格显著占优。

宏观经济方面，三季度宏观数据整体低位回落，经济增速下行压力凸显。具体来看，7-9 月，我国制造业 PMI 录得 49.4%、49.1%、49.8%，持续处于荣枯线下方。9 月景气度改善，一方面存在部分低基数原因，另一方面也有季节性处理的问题。同期公布的 9 月财新 PMI 为 49.3，低于前值的 50.4；BCI 指数为 46.0，低于前值的 48.6。生产端，8 月工业、服务业生产同步走弱，其中规模以上工业增加值同比增长 4.5%，略低于市场预期的 4.7%。消费端，8 月社零增速同比增长 2.1%，弱于 7 月份和二季度 2.7% 的增长表现，也明显低于市场预期。即使考虑 8 月核心通胀同比下行 0.1% 的影响，实际消费动能也较 7 月表现进一步走弱。投资端，1-8 月全国固定资产投资同比增长 3.4%，略低于市场预期的 3.5%。其中，制造业投资和设备工器具购置是固定资产投资的主要支撑。与此同时，8 月基建投资景气度回落，同比增速由前值的 10% 以上下行至 6% 左右。而房地产开发投资同比降幅边际收窄，但拖累仍强。出口端，8 月出口同比增 8.7%，表观增速创年内最高。物价方面，8 月 CPI 同比增长 0.6%，继续小幅回升。但 PPI 同比、环比增速均出现快速下滑。背后是内部市场需求不足叠加海外衰退交易升温，导致生产价格快速走弱。社融方面，8 月社融增加 3.03 万亿元，高于市场预期的 2.7 万亿元。其中，8 月实体信贷增加 1.04 万亿元，同比少增 2971 亿元。社融存量增速为 8.1%，较上月下降 0.1%。

政策层面，国内各项宽松举措密集落地。7 月三中全会、政治局会议连续定调积极，要求“宏

观政策要持续用力、更加给力”，并明确“加快专项债发行使用进度，用好超长期特别国债”。此后专项债发行明显提速，截至 10 月初发行进度从 6 月底的不到 40% 已提升至 90% 以上。9 月 24 日，人民银行联合金融监管总局、证监会出台了一系列金融支持经济高质量发展相关政策，包括：1) 利率方面，下调存款准备金率 0.5 个百分点，7 天期逆回购操作利率下调 0.2 个百分点，年内还将视市场流动性的状况，可能择机进一步下调存款准备金率 0.25-0.5 个百分点。2) 地产方面，推出降低存量房贷利率和统一房贷最低首付比例的增量政策的同时，又延长、优化了存量政策的部署。3) 资本市场方面，央行创设两项新的结构性货币政策工具，证监会也明确将引导长钱入市、活跃并购重组、鼓励回购，支持资本市场稳定发展。9 月 26 日，政治局会议在 7 月底刚召开过经济议题会议的情况下，超预期分析经济形势和部署经济工作，明确“抓住重点、主动作为”的政策新导向，并要求“加大财政货币政策逆周期调节力度”、“促进房地产市场止跌回稳”。而海外方面，此前 7 月中旬至 8 月初，美国衰退预期升温+日元套息交易逆转一度惊扰全球。此后美联储降息预期升温，直至 9 月美联储降息落地并超预期大幅降息 50bp，宽松交易加速演绎又带动市场修复。但近期美国非农就业、失业率等数据偏强，叠加美联储鹰派指引之下，市场对联储年内的降息预期大幅回调。美国总统大选选情依然焦灼，民主党临阵换帅，当前哈里斯在民调中小幅占优。整体来看，海外仍是多事之秋。

行业层面，此前由于经济预期偏弱、风险偏好收缩，行业快速轮动，市场缺乏共识，行情特征主要体现为高切低，赚钱效应较差。风险偏好收缩下，低波红利类龙头一度成为市场聚焦的方向。而到了 8 月底，随着银行、公用事业等方向拥挤度升至高位，资金又快速流出红利板块，转向中报业绩亮眼的电子、出口链等板块，以及此前表现落后的新能源、医药等方向。直至 9 月底，政策重磅加码，市场迎来反转，消费、地产链、成长方向显著修复，呈现出明显的跌深反弹特征。

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。

展望 2024 年四季度，市场逻辑已经反转，坚定多头思维。往后看，短期内，经历 9 月底 10 月初暴力的、逼空式的上涨后，阶段性市场或进入大波动、大分化的状态。但 10 月份的震荡更多是蓄势、大浪淘沙，建议积极应对上涨过程中的颠簸。

中长期，在反转逻辑的大框架下，市场将从逼空式反弹逐步进入到震荡但可持续的上升新阶段，因为资金动力仍源源不断：1) 随着中国股市回暖及经济企稳，海外资金有望兴起新一轮配置中国股市的热潮。2) 当前国内机构对于权益资产的配置比重仍处在历史较低水平，后续规模增长、仓位抬升有望带动增量入市。3) 国内居民财富向股市新一轮再配置的趋势才刚刚开始。近期市场大涨之下，投资者开户热情高涨。往后看，居民财富、产业资本以及理财资金等向中国股市再配

置的趋势下，中国资产或将有望迎来源源不断的增量资金浇灌。

结构上，短期市场 beta 式的修复中，关注跌深反弹的方向。中长期，要抓住政策导向的变化，把握并购重组和重视股东回报 2 个方向，重点关注科技和内需两大主线：1) 科技：新质生产力领域是长期促进经济动能切换和短期托底政策的发力结合点，后续并购重组将带来明显催化效应；2) 内需：本轮政策刺激更加重视需求侧，内需消费受益。并且从各行业估值角度来看，泛消费板块估值仍处在历史较低水平。

操作方面，我们仍在保持仓位不变的情况下，坚持精选细分景气行业，自下而上挖掘个股，加入一些现金流提前复苏，或季报增速超预期的个股。整体来说，在关注前面提到的宏观面几个不确定性因素的同时，综合考虑组合盈利增长和估值的匹配程度，对结构进一步优化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞研究精选 A 的基金份额净值为 1.2447 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.27%，同期业绩比较基准收益率为 13.00%，截至本报告期末华泰柏瑞研究精选 C 的基金份额净值为 1.2203 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.14%，同期业绩比较基准收益率为 13.00%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 479,565,635.94 | 88.14 |
| | 其中：股票 | 479,565,635.94 | 88.14 |
| 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 | 64,400,148.84 | 11.84 |
| 8 | 其他资产 | 149,324.42 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 544,115,109.20 | 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 | 507,528.00 | 0.09 |
| B | 采矿业 | 28,932,022.00 | 5.33 |
| C | 制造业 | 367,678,888.24 | 67.74 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,230,477.00 | 2.44 |
| E | 建筑业 | 618.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,275,161.00 | 3.18 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,923,671.02 | 3.67 |
| J | 金融业 | 15,539,004.00 | 2.86 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 8,244,920.00 | 1.52 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,326.68 | 0.00 |
| 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 | 8,215,020.00 | 1.51 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 479,565,635.94 | 88.36 |

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 | 67,467 | 16,994,262.63 | 3.13 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 98,500 | 15,253,710.00 | 2.81 |
| 3 | 002463 | 沪电股份 | 331,300 | 13,305,008.00 | 2.45 |
| 4 | 600066 | 宇通客车 | 427,300 | 11,259,355.00 | 2.07 |
| 5 | 603298 | 杭叉集团 | 482,992 | 10,500,246.08 | 1.93 |
| 6 | 300394 | 天孚通信 | 95,568 | 9,604,584.00 | 1.77 |
| 7 | 600660 | 福耀玻璃 | 158,107 | 9,201,827.40 | 1.70 |
| 8 | 603871 | 嘉友国际 | 390,400 | 8,858,176.00 | 1.63 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 9 | 601601 | 中国太保 | 223,900 | 8,754,490.00 | 1.61 |
| 10 | 603993 | 洛阳钼业 | 973,000 | 8,465,100.00 | 1.56 |

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 64,841.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 84,482.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 149,324.42 |

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞研究精选 A | 华泰柏瑞研究精选 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 413,599,963.80 | 36,498,060.81 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,938,898.30 | 12,594,110.87 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 26,275,232.75 | 1,386,129.87 |
| 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 | 389,263,629.35 | 47,706,041.81 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

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

2024 年 10 月 25 日