

# 华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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

送出日期：2024 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	18
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>65</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	65
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	66
8.3 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 .....	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
8.6 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 .....	73
8.7 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 .....	73
8.8 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 .....	73
8.9 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 .....	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
9.3 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 .....	75
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	75
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>76</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>76</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	76
11.2 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 .....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
11.4 基金投资策略的改变 .....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	77
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
12.1 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 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>81</b>
13.1 备查文件目录 .....	81
13.2 存放地点 .....	81
13.3 查阅方式 .....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞品质成长混合	
基金主代码	011357	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,655,388,134.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C
下属分级基金的交易代码	011357	011358
报告期末下属分级基金的份额总额	2,514,964,579.63 份	140,423,555.36 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对行业及公司深入的研究分析，精选优质上市公司，在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	在分析宏观经济的基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，根据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握各类资产的投资机会，保证整体投资业绩的持续性。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+上证国债指数收益率*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市场基金、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。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	张姗
	联系电话	021-38601777	400-61-95555
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	400-61-95555
传真		021-38601799	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证	深圳市深南大道 7088 号招商银

	大五道口广场 1 号 17 层	行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C
本期已实现收益	-330,715,371.61	-18,446,864.34	-761,429,956.19	-39,421,528.46	-104,593,864.96	-7,300,616.93
本期利润	-220,714,172.26	-12,604,905.55	-765,763,634.65	-39,606,451.05	-320,800,750.91	-24,860,492.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0798	-0.0836	-0.2316	-0.2318	-0.0768	-0.1349
本期加权平均净值利润	-12.51%	-13.26%	-32.05%	-32.33%	-7.58%	-13.41%

率						
本期基金份额净值增长率	-13.27%	-13.70%	-25.59%	-25.96%	-12.79%	-13.15%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-1,099,524,065.93	-62,502,632.53	-1,069,355,740.59	-58,123,074.65	-468,024,007.13	-24,378,405.96
期末可供分配基金份额利润	-0.4372	-0.4451	-0.3511	-0.3570	-0.1279	-0.1315
期末基金资产净值	1,415,440,513.70	77,920,922.83	1,976,690,409.20	104,699,272.25	3,192,109,743.20	161,043,122.97
期末基金份额净值	0.5628	0.5549	0.6489	0.6430	0.8721	0.8685
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-43.72%	-44.51%	-35.11%	-35.70%	-12.79%	-13.15%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞品质成长混合 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
过去三个月	-5.51%	0.72%	-4.99%	0.64%	-0.52%	0.08%
过去六个月	-13.07%	0.76%	-8.25%	0.68%	-4.82%	0.08%
过去一年	-13.27%	1.03%	-7.99%	0.67%	-5.28%	0.36%
自基金合同生效起至今	-43.72%	1.31%	-25.20%	0.85%	-18.52%	0.46%

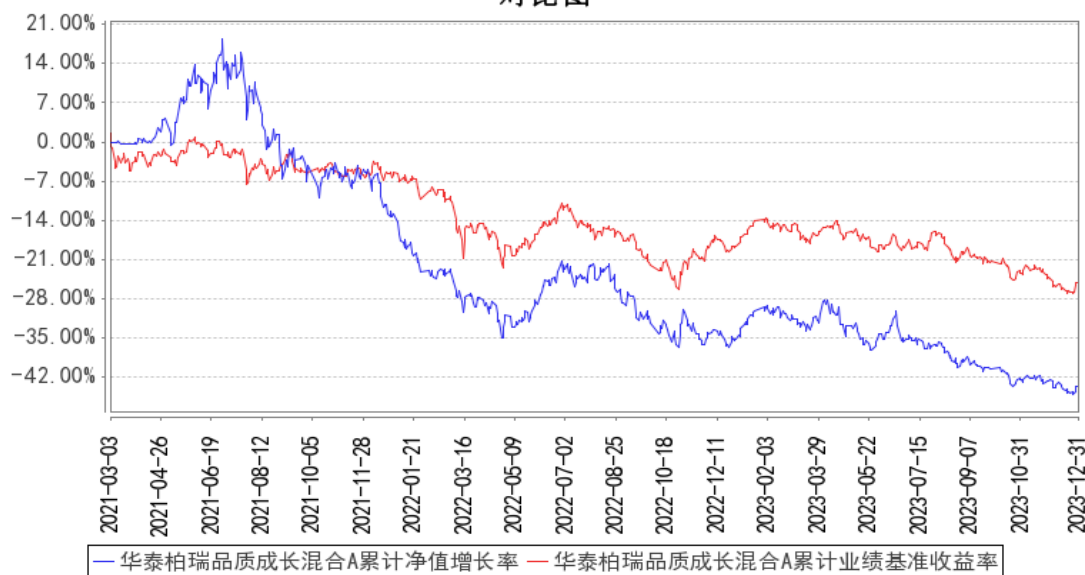
华泰柏瑞品质成长混合 C

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
过去三个月	-5.63%	0.72%	-4.99%	0.64%	-0.64%	0.08%
过去六个月	-13.28%	0.76%	-8.25%	0.68%	-5.03%	0.08%
过去一年	-13.70%	1.03%	-7.99%	0.67%	-5.71%	0.36%
自基金合同生效起至今	-44.51%	1.31%	-25.20%	0.85%	-19.31%	0.46%

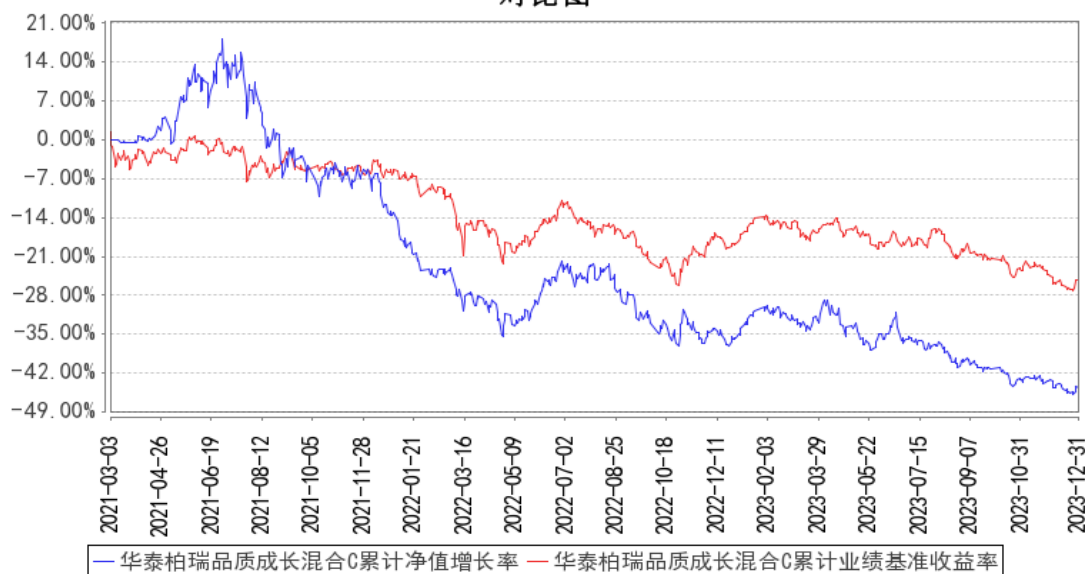


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞品质成长混合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



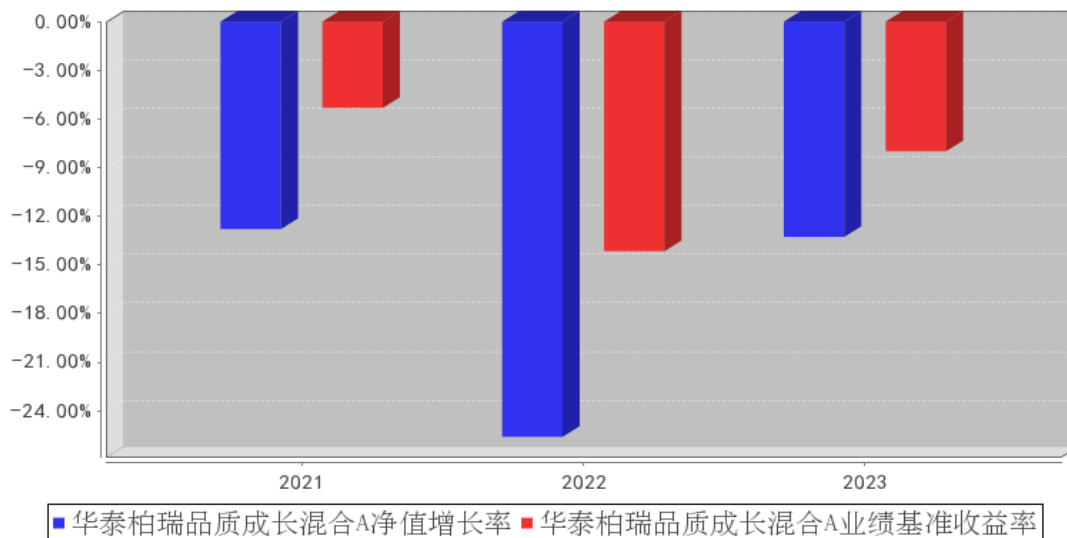
华泰柏瑞品质成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



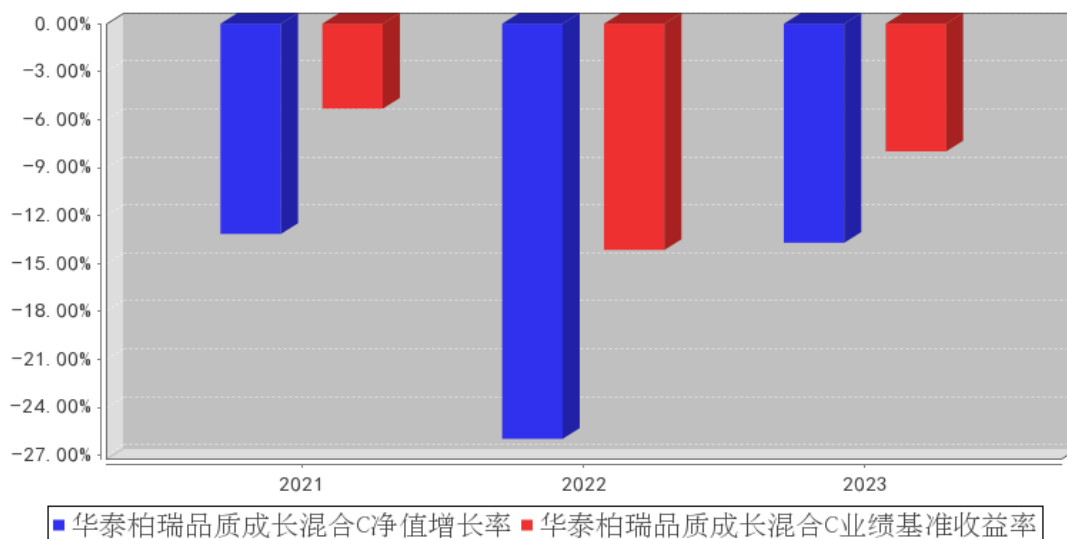
注：A类图示日期为2021年3月3日至2023年12月31日。C类图示日期为2021年3月3日至2023年12月31日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞品质成长混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华泰柏瑞品质成长混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为 2021 年 3 月 3 日，2021 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

## § 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)、华泰柏瑞瑞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、华泰柏瑞益享债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦合债券型证券投资基金、华泰柏瑞祥泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、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发起式联接基金、华泰柏瑞科技创新混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、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发起式联接基金(QDII)、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、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发起式联接基金。截至 2023 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 3801.46 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		
李飞	本基金的	2022 年	2023 年 8	8 年	中国科学技术大学金融工程专业硕士。曾

	基金经理助理	11月8日	月1日		担任广发证券股份有限公司研究员。2019年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究部研究员、高级研究员、基金经理助理。2023年8月起任华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金的基金经理。
姚晨飞	本基金的基金经理助理	2022年11月8日	2023年7月28日	9年	复旦大学金融专业硕士。曾任中国太平洋人寿保险总部管理培训生，天治基金管理有限公司研究部研究员。2016年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2021年12月至2023年7月任基金经理助理。
沈雪峰	总经理助理、本基金的基金经理	2021年3月3日	-	30年	上海财经大学经济学硕士。曾任安徽省国际信托投资公司投资银行部、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究员；华富基金管理有限公司投研部副总监、基金经理；华安基金管理有限公司基金经理；华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理、投资部总监、专户投资部总监，现任公司总经理助理。2020年6月起任华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年8月起任华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金的基金经理。2020年9月起任华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金的基金经理。2021年3月起任华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金的基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
沈雪峰	公募基金	4	2,896,285,827.60	2020年6月30日
	私募资产管理计划	4	1,483,778,523.26	2016年8月15日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	4,380,064,350.86	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩不直接与兼任基金经理薪酬激励挂钩，公司会根据实际情况对兼任基金经理的公募产品及所管理的私募资产管理计划分别进行考核，并依据考核结果对薪酬激励进行评定和调整。

## 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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

### 4.3.2 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中的公平交易模块，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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合投资交易行为加强管理、监控和分析，防范不公平交易。包括：原则上采取“多基金指令”下达投资指令，以实现“同时同价”，因产品策略、头寸变化等原因导致无法“同时同价”的，公司每日分析交易流水，并定期通过公平交易系统进行价差监控管理，以加强事后分析。

兼任的不同组合间原则上不得进行同日反向交易，遇到特殊情况需要提出申请。风险管理部每日对兼任组合间多个时间窗口下同向及反向交易价差进行监控，强化控制和监测。风险管理部定期对不同投资组合的公平交易情况进行监控和分析，相关投资组合经理对异常交易情况进行说明，风险管理部进行严格复核与独立评估，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，合规法律部对兼任公平交易制度以及其它交易相关规定的贯彻情况进行不定期监察稽核。

本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

#### 4.3.3 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 20 次，其中 4 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 16 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 年初，市场对于中国走出疫情之后的经济复苏充满期待，春季躁动从消费、出行等等顺周期板块开始，走出令人瞩目的“中特估”行情，之后 AI 引领的传媒行情如火如荼，将上半年行情推向高潮。然而，美国持续加息之后的降息预期迟迟未能兑现，美债高收益率继续对全球资金形成虹吸现象，国内利率、汇率面临压力较大，中国房地产市场危机爆发，金融系统反腐高压下银行、资本市场金融案件多发，外资持续流出 A 股市场，市场做空策略被更多关注，转融通融券、程序化交易等被更多讨论。随着经济数据走弱，股票市场持续疲弱，12 月市场创出年度新低，全年上证综指下跌 3.7%，消费者服务跌幅 41.9%、房地产板块下跌 25.7%、食品饮料和半导体、零售行业跌幅均高达 15%以上，市场普遍悲观情绪浓厚。本基金在年初积极参与市场反弹，曾在中特估和 AI、传媒板块行情中浮盈颇丰，但是最终两大板块深度调整，我们甚少遇到这样在基本面变化不大甚至估值较低的央企国企板块持续剧烈调整，未能及时兑现板块收益，长期投资在一年迅猛波动的市场里考验颇大。

##### 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品质成长混合 A 的基金份额净值为 0.5628 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.27%，同期业绩比较基准收益率为-7.99%，截至本报告期末华泰柏瑞品质成长混合



C 的基金份额净值为 0.5549 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.70%，同期业绩比较基准收益率为-7.99%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年的股市表现是略微极端的、令人难忘的，价值投资、长期投资遇到前所未有的挑战，近三年来白酒、医药等核心资产持续深度调整以及新能源等赛道风格持续下跌，令人深思。过去局部投资者的灵活的波段操作交易遇到了资金规模化、机构化的环境，且诸多的金融衍生品、程序化交易手段更多，市场不同投资者部分交易规则并不完全相同。信息不对称、部分投资机构自我约束减弱使得波段交易风格盛行。市场需要根据现实的状况进行相关规则、制度的梳理和完善，各方机构投资者需要进行投资反思，基金经理需要提高对市场格局变化的认知，提高投资管理能力，重塑价值投资。所谓物极必反，经过下跌洗礼的股票市场一定会重建信心，迎来新的格局，真正发挥其投融资功能，并给投资人带来回报。在市场风险偏好较低的市场环境下，经营稳定、低估值、高分红高股息板块会持续受到资金青睐，成为重要的投资方向之一。2023 年四季度，政府已经在利率政策、财政政策、房地产纾困、特别国债等方面积极动作，引领经济从高质量发展角度调整结构，提高科技竞争力，提高先进制造竞争力，在半导体、人工智能、机器人、先进装备等领域加大投资，随着库存周期的变动，经济复苏，2024 年的股票市场也会出现显著的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益分配后每基金份额净值不低于面值。本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职

责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22213 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞品质成长混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞品质成长混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞品</p>

	<p>质成长混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 ?</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞品质成长混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞品质成长混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞品质成长混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞品质成长混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞品质成长混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞品质成长混合基金不能持续经营。</p>

	(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	151,106,476.61	106,259,256.47
结算备付金		3,398,135.18	13,196,786.09
存出保证金		735,829.26	857,243.78
交易性金融资产	7.4.7.2	1,396,474,606.94	1,951,761,476.20
其中: 股票投资		1,396,474,606.94	1,948,418,088.65
基金投资		-	-
债券投资		-	3,343,387.55
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-3,257.80
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	21,201,598.50
应收股利		-	-
应收申购款		32,594.83	126,066.86
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,551,747,642.82	2,093,399,170.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		52,345,186.00	4,326,628.08
应付赎回款		1,719,388.08	1,232,277.04
应付管理人报酬		1,530,269.34	2,676,754.38
应付托管费		255,044.90	446,125.74
应付销售服务费		33,245.12	44,827.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	2,503,072.85	3,282,874.15
负债合计		58,386,206.29	12,009,488.65
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,655,388,134.99	3,208,868,496.69
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-1,162,026,698.46	-1,127,478,815.24
净资产合计		1,493,361,436.53	2,081,389,681.45
负债和净资产总计		1,551,747,642.82	2,093,399,170.10

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额为 2,655,388,134.99 份，其中华泰柏瑞品质成长 A 类基金份额净值 0.5628 元，基金份额 2,514,964,579.63 份；华泰柏瑞品质成长 C 类基金份额净值 0.5549 元，基金份额 140,423,555.36 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-201,866,224.02	-760,397,963.13
1. 利息收入		2,702,969.70	6,292,848.51
其中：存款利息收入	7.4.7.13	776,956.69	1,073,884.40
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		1,926,013.01	5,218,964.11
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-320,430,813.82	-762,530,848.88
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-343,637,949.59	-786,464,001.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	807,937.39	1,713,150.62
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	22,399,198.38	22,220,001.99
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）	7.4.7.20	115,843,158.14	-4,518,601.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	18,461.96	358,638.29
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>31,452,853.79</b>	<b>44,972,122.57</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	26,332,228.80	37,802,205.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,388,704.81	6,300,367.65
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	477,039.11	614,395.25
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1.98	2.51
8. 其他费用	7.4.7.23	254,879.09	255,151.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-233,319,077.81</b>	<b>-805,370,085.70</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-233,319,077.81</b>	<b>-805,370,085.70</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-233,319,077.81</b>	<b>-805,370,085.70</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	3,208,868,496.69	-	-1,127,478,815.24	2,081,389,681.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,208,868,496.69	-	-1,127,478,815.24	2,081,389,681.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-553,480,361.70	-	-34,547,883.22	-588,028,244.92
(一)、综合收益总额	-	-	-233,319,077.81	-233,319,077.81
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-553,480,361.70	-	198,771,194.59	-354,709,167.11
其中：1. 基金申购款	41,306,539.14	-	-14,682,080.84	26,624,458.30
2. 基金赎回款	-594,786,900.84	-	213,453,275.43	-381,333,625.41
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-



四、本期期末净资产	2,655,388,134.99	-	-1,162,026,698.46	1,493,361,436.53
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	3,845,555,279.26	-	-492,402,413.09	3,353,152,866.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,845,555,279.26	-	-492,402,413.09	3,353,152,866.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-636,686,782.57	-	-635,076,402.15	-1,271,763,184.72
(一)、综合收益总额	-	-	-805,370,085.70	-805,370,085.70
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-636,686,782.57	-	170,293,683.55	-466,393,099.02
其中：1. 基金申购款	129,711,321.85	-	-33,767,247.49	95,944,074.36
2. 基金赎回款	-766,398,104.42	-	204,060,931.04	-562,337,173.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,208,868,496.	-	-1,127,478,815	2,081,389,681.4

	69		.24	5
--	----	--	-----	---

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞品质成长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”)证监许可[2020]3713 号《关于准予华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金注册的批复》注册,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《华泰柏瑞品质成长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 5,116,470,452.50 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(2021)第 0242 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,116,470,532.58 份基金份额,其中认购资金利息折合 80.08 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、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。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、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基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞品质成长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,包括国内依法发行上市

通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、存托凭证、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、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、同业存单、货币市场工具、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。本基金持有的股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 60%-95%;投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终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中证 800 指数收益率 $\times$ 60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 20%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%。

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 2024 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产 / 负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代

缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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)本基金的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，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	151,106,476.61	106,259,256.47
等于：本金	151,089,483.73	106,247,166.64
加：应计利息	16,992.88	12,089.83
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	151,106,476.61	106,259,256.47

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,518,916,811.69	-	1,396,474,606.94	-122,442,204.75	
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	1,518,916,811.69	-	1,396,474,606.94	-122,442,204.75	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,186,704,441.84	-	1,948,418,088.65	-238,286,353.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,298,359.20	44,038.05	3,343,387.55	990.30
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,298,359.20	44,038.05	3,343,387.55	990.30
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,190,002,801.04	44,038.05	1,951,761,476.20	-238,285,362.89	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 7.4.7.3.3 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。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-3,257.80	-
银行间市场	-	-
合计	-3,257.80	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	51.30	1.07
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,283,021.55	3,062,873.08
其中：交易所市场	2,283,021.55	3,062,873.08
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
合计	2,503,072.85	3,282,874.15

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华泰柏瑞品质成长混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,046,046,149.79	3,046,046,149.79
本期申购	34,256,243.30	34,256,243.30
本期赎回（以“-”号填列）	-565,337,813.46	-565,337,813.46
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	2,514,964,579.63	2,514,964,579.63

##### 华泰柏瑞品质成长混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,822,346.90	162,822,346.90
本期申购	7,050,295.84	7,050,295.84
本期赎回（以“-”号填列）	-29,449,087.38	-29,449,087.38
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	140,423,555.36	140,423,555.36

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 华泰柏瑞品质成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-759,602,707.74	-309,753,032.85	-1,069,355,740.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-759,602,707.74	-309,753,032.85	-1,069,355,740.59
本期利润	-330,715,371.61	110,001,199.35	-220,714,172.26
本期基金份额交易产生的变动数	152,612,583.27	37,933,263.65	190,545,846.92
其中：基金申购款	-9,655,215.54	-2,435,369.87	-12,090,585.41
基金赎回款	162,267,798.81	40,368,633.52	202,636,432.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-937,705,496.08	-161,818,569.85	-1,099,524,065.93

##### 华泰柏瑞品质成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-41,638,931.05	-16,484,143.60	-58,123,074.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-41,638,931.05	-16,484,143.60	-58,123,074.65
本期利润	-18,446,864.34	5,841,958.79	-12,604,905.55
本期基金份额交易产生的变动数	6,608,471.81	1,616,875.86	8,225,347.67
其中：基金申购款	-2,056,490.59	-535,004.84	-2,591,495.43
基金赎回款	8,664,962.40	2,151,880.70	10,816,843.10
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-53,477,323.58	-9,025,308.95	-62,502,632.53
-----	----------------	---------------	----------------

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	555,180.80	629,819.78
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	207,768.69	419,969.52
其他	14,007.20	24,095.10
合计	776,956.69	1,073,884.40

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-343,637,949.59	-786,464,001.49
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	-343,637,949.59	-786,464,001.49

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	7,153,015,200.15	7,865,841,637.53
减：卖出股票成本总额	7,476,355,484.08	8,628,437,724.52
减：交易费用	20,297,665.66	23,867,914.50
买卖股票差价收入	-343,637,949.59	-786,464,001.49



#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	20,548.99	41,748.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	787,388.40	1,671,401.84
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	807,937.39	1,713,150.62

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,588,560.15	5,041,321.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,736,359.20	3,369,000.00
减：应计利息总额	64,603.57	714.25
减：交易费用	208.98	205.11
买卖债券差价收入	787,388.40	1,671,401.84

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	22,399,198.38	22,220,001.99
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	22,399,198.38	22,220,001.99

#### 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	115,843,158.14	-4,518,601.05
股票投资	115,844,148.44	-4,519,591.35
债券投资	-990.30	990.30
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
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	115,843,158.14	-4,518,601.05

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	17,511.37	287,190.48
基金转换费收入	950.59	71,447.81
合计	18,461.96	358,638.29

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
证券组合费	913.73	738.21
银行划款手续费	33,965.36	34,413.66
合计	254,879.09	255,151.87

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	7,364,536,238.40	52.83	7,776,902,811.78	49.61

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 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12月31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	6,840,571.35	52.71	396,795.83	17.38
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	7,174,887.77	49.50	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	26,332,228.80	37,802,205.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,826,752.78	15,606,073.89
应支付基金管理人的净管理费	15,505,476.02	22,196,131.40

注：自2022年1月1日至2023年8月25日，支付基金管理人华泰柏瑞基金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：

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

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月26日起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,388,704.81	6,300,367.65

注：自2022年1月1日至2023年8月25日，支付基金托管人招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：

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

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 26 日起，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	7,732.23	7,732.23
华泰证券股份有限公司	0.00	53,440.97	53,440.97
招商银行股份有限公司	0.00	124,670.49	124,670.49
合计	0.00	185,843.69	185,843.69
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	10,952.39	10,952.39
华泰证券股份有限公司	0.00	67,079.27	67,079.27
招商银行股份有限公司	0.00	160,877.30	160,877.30
合计	0.00	238,908.96	238,908.96

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 0.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人按照与基金管理人约定的时间从基金资产中一次性支取。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 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：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	招商银行	151,106,476.61	555,180.80	106,259,256.47

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 7.4.10.7 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12月31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	113066	平煤转债	网上配售	44,380	4,438,000.00

华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688602	康鹏科技	网下申购	10,653	92,254.98
华泰联合证券	301421	波长光电	网下申购	3,315	97,394.70
华泰联合证券	688693	锆威特	网下申购	1,773	72,391.59
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合证券	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
上年度可比期间					
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	301327	华宝新能	网下申购	2,417	574,037.50
华泰联合证券	688353	华盛锂电	网下申购	4,358	428,609.30
华泰联合证券	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合证券	688351	微电生理	网下申购	10,946	180,718.46
华泰联合证券	301339	通行宝	网下申购	9,127	171,405.06
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	2,927	166,487.76
华泰联合证券	688209	英集芯	网下申购	6,822	165,297.06
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
华泰联合证券	301290	东星医疗	网下申购	3,291	145,100.19
华泰联合证券	301277	新天地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合证券	688253	英诺特	网下申购	4,364	113,725.84
华泰联合证券	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合证券	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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



7.4.12.1.1 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
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股锁定期内	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定期内	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定期内	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股锁定期内	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股锁定期内	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股锁定期内	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期内	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股锁定期内	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股锁定期内	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定期内	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-

		日								
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股锁定期内	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定期内	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定期内	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定期内	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定期内	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定期内	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股锁定期内	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定期内	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股锁定期内	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股	2023年11月29日	6个月	新股锁定期内	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

	份	日								
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定期内	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期内	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定期内	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定期内	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定期内	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定期内	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定期内	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定期内	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股锁定期内	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-

	能	日								
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定期内	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定期内	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定期内	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定期内	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定期内	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定期内	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定期内	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股锁定期内	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定期内	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定期内	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科	2023年8月10日	6个月	新股锁定期内	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-

	技	日								
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定期内	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定期内	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股锁定期内	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期内	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期内	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定期内	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股锁定期内	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股锁定期内	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股锁定期内	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定期内	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生	2023年7月26日	6个月	新股锁定期内	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-

	科	日								
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定期内	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定期内	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股锁定期内	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定期内	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定期内	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定期内	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定期内	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定期内	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定期内	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定期内	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股	2023年9月21日	6个月	新股锁定期内	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-

	份	日								
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定期内	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定期内	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定期内	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定期内	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定期内	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定期内	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定期内	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定期内	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期内	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
873690.BJ	捷众科技	2023年12月27日	1个月	新股未上市	9.34	9.34	500	4,670.00	4,670.00	-

注：1、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新股中需要限售的部分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。

2、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。

3、基金作为特定投资者，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。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借的业务。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控



制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

#### 7.4.13.3.1 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时间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 7.4.12。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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
货币资金	151,106,476.61	-	-	-	-	-	151,106,476.61
结算备付金	3,398,135.18	-	-	-	-	-	3,398,135.18
存出保证金	735,829.26	-	-	-	-	-	735,829.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,396,474,606.94	1,396,474,606.94
应收申购款	-	-	-	-	-	32,594.83	32,594.83
资产总计	155,240,441.05	-	-	-	-	1,396,507,201.77	1,551,747,642.82
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,719,388.08	1,719,388.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,530,269.34	1,530,269.34
应付托管费	-	-	-	-	-	255,044.90	255,044.90
应付清算款	-	-	-	-	-	52,345,186.00	52,345,186.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	33,245.12	33,245.12
其他负债	-	-	-	-	-	2,503,072.85	2,503,072.85
负债总计	-	-	-	-	-	58,386,206.29	58,386,206.29
利率敏感度缺口	155,240,441.05	-	-	-	-	1,338,120,995.48	1,493,361,436.53
上年度末	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

2022年12月 31日	月	年	以上		
<b>资产</b>					
货币资金	106,259,256.47	-	-	-	106,259,256.47
结算备付金	13,196,786.09	-	-	-	13,196,786.09
存出保证金	857,243.78	-	-	-	857,243.78
交易性金融资产	-	-3,343,387.55	-	-1,948,418,088.65	1,951,761,476.20
买入返售金融资产	-3,257.80	-	-	-	-3,257.80
应收申购款	-	-	-	126,066.86	126,066.86
应收清算款	-	-	-	21,201,598.50	21,201,598.50
资产总计	120,310,028.54	-3,343,387.55	-	-1,969,745,754.01	2,093,399,170.10
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,232,277.04	1,232,277.04
应付管理人报酬	-	-	-	2,676,754.38	2,676,754.38
应付托管费	-	-	-	446,125.74	446,125.74
应付清算款	-	-	-	4,326,628.08	4,326,628.08
应付销售服务费	-	-	-	44,827.47	44,827.47
应交税费	-	-	-	1.79	1.79
其他负债	-	-	-	3,282,874.15	3,282,874.15
负债总计	-	-	-	12,009,488.65	12,009,488.65
利率敏感度缺口	120,310,028.54	-3,343,387.55	-	-1,957,736,265.36	2,081,389,681.45

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：0.16%），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）。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			合计
	美元 折合人民	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	

	币元			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	37,637,668.24	-	37,637,668.24
资产合计	-	37,637,668.24	-	37,637,668.24
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	37,637,668.24	-	37,637,668.24
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,581,447.84	-	4,581,447.84
资产合计	-	4,581,447.84	-	4,581,447.84
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,581,447.84	-	4,581,447.84

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	1,881,883.41	229,072.39
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,881,883.41	-229,072.39

### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	1,396,474,606.94	93.51	1,948,418,088.65	93.61
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	1,396,474,606.94	93.51	1,948,418,088.65	93.61

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	71,273,190.70	129,045,087.58
业绩比较基准下降5%	-71,273,190.70	-129,045,087.58	

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,395,551,616.71	1,944,752,476.29
第二层次	4,670.00	3,343,387.55
第三层次	918,320.23	3,665,612.36
合计	1,396,474,606.94	1,951,761,476.20

#### 7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	3,665,612.36	3,665,612.36
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,115,282.19	2,115,282.19
转出第三层次	-	6,067,307.20	6,067,307.20
当期利得或损失总额	-	1,204,732.88	1,204,732.88
其中：计入损益的利得或损失	-	1,204,732.88	1,204,732.88
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	918,320.23	918,320.23
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	134,976.77	134,976.77
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,177,355.50	5,177,355.50
转出第三层次	-	2,493,478.42	2,493,478.42
当期利得或损失总额	-	981,735.28	981,735.28
其中：计入损益的利得或损失	-	981,735.28	981,735.28
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,665,612.36	3,665,612.36
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	679,444.94	679,444.94

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。



7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	918,320.23	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	3,665,612.36	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891~2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 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)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

8.1 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	1,396,474,606.94	89.99
	其中：股票	1,396,474,606.94	89.99
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	154,504,611.79	9.96
8	其他各项资产	768,424.09	0.05
9	合计	1,551,747,642.82	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 37,637,668.24 元，占基金资产净值的比例为 2.52%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	-	-
B	采矿业	313,669,333.72	21.00
C	制造业	711,411,929.89	47.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,316,087.50	4.31
E	建筑业	8,520,130.64	0.57
F	批发和零售业	28,580,436.29	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	38,243,848.41	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,661,509.29	5.33
J	金融业	81,929,961.64	5.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	25,946,211.32	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	3,508,316.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,046,116.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,358,836,938.70	90.99

### 8.2.2 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	-	-
30 主要消费	-	-

35 医药卫生	37,637,668.24	2.52
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	37,637,668.24	2.52

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 8.3 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	600489	中金黄金	5,897,800	58,742,088.00	3.93
2	601088	中国神华	1,849,200	57,972,420.00	3.88
3	601899	紫金矿业	4,236,500	52,786,790.00	3.53
4	600547	山东黄金	2,061,708	47,151,261.96	3.16
5	300033	同花顺	300,072	47,072,294.64	3.15
6	002050	三花智控	1,561,700	45,913,980.00	3.07
7	603728	鸣志电器	687,600	45,278,460.00	3.03
8	300573	兴齐眼药	240,860	43,913,595.20	2.94
9	688017	绿的谐波	246,851	37,891,628.50	2.54
10	688333	铂力特	313,809	36,370,463.10	2.44
11	600085	同仁堂	673,200	36,150,840.00	2.42
12	601985	中国核电	4,700,017	35,250,127.50	2.36
13	000568	泸州老窖	191,900	34,430,698.00	2.31
14	002906	华阳集团	903,550	31,850,137.50	2.13
15	600011	华能国际	3,774,800	29,065,960.00	1.95
16	601398	工商银行	6,066,100	28,995,958.00	1.94
17	603259	药明康德	356,300	25,924,388.00	1.74
18	600519	贵州茅台	15,000	25,890,000.00	1.73
19	300496	中科创达	310,625	24,868,637.50	1.67
20	688279	峰岬科技	193,882	24,452,397.84	1.64
21	600436	片仔癀	100,020	24,203,839.80	1.62
22	601006	大秦铁路	2,942,000	21,211,820.00	1.42
23	000933	神火股份	1,147,700	19,281,360.00	1.29
24	300580	贝斯特	630,050	19,077,914.00	1.28
25	688048	长光华芯	300,028	18,802,754.76	1.26
26	600129	太极集团	386,600	17,961,436.00	1.20
27	603662	柯力传感	479,400	17,253,606.00	1.16
28	000963	华东医药	410,335	17,012,489.10	1.14
29	301117	佳缘科技	297,500	16,216,725.00	1.09
30	605128	上海沿浦	279,300	16,213,365.00	1.09
31	600062	华润双鹤	858,100	15,960,660.00	1.07

32	600938	中国海油	754,600	15,823,962.00	1.06
33	832982	锦波生物	60,000	15,676,200.00	1.05
34	02162	康诺亚-B	329,500	14,661,234.96	0.98
35	600188	兖矿能源	717,900	14,221,599.00	0.95
36	601699	潞安环能	648,200	14,202,062.00	0.95
37	601728	中国电信	2,500,000	13,525,000.00	0.91
38	300179	四方达	1,515,100	13,499,541.00	0.90
39	002867	周大生	880,400	13,364,472.00	0.89
40	001965	招商公路	1,316,700	12,864,159.00	0.86
41	601666	平煤股份	1,111,871	12,853,228.76	0.86
42	300308	中际旭创	110,000	12,420,100.00	0.83
43	002475	立讯精密	359,400	12,381,330.00	0.83
44	002675	东诚药业	675,200	12,376,416.00	0.83
45	000807	云铝股份	1,000,060	12,220,733.20	0.82
46	688160	步科股份	198,784	11,565,253.12	0.77
47	301029	怡合达	412,644	10,637,962.32	0.71
48	688322	奥比中光	280,027	10,523,414.66	0.70
49	002236	大华股份	500,000	9,225,000.00	0.62
50	601168	西部矿业	633,700	9,042,899.00	0.61
51	002327	富安娜	971,000	8,690,450.00	0.58
52	601390	中国中铁	1,500,023	8,520,130.64	0.57
53	02269	药明生物	316,000	8,476,419.39	0.57
54	000625	长安汽车	502,200	8,452,026.00	0.57
55	688320	禾川科技	205,770	8,436,570.00	0.56
56	600985	淮北矿业	500,000	8,315,000.00	0.56
57	01801	信达生物	202,500	7,845,033.26	0.53
58	300567	精测电子	82,416	7,221,289.92	0.48
59	000975	银泰黄金	472,100	7,081,500.00	0.47
60	600546	山煤国际	398,500	6,977,735.00	0.47
61	06160	百济神州	66,700	6,654,980.63	0.45
62	688523	航天环宇	239,538	6,424,409.16	0.43
63	300809	华辰装备	210,580	6,159,465.00	0.41
64	601988	中国银行	1,469,100	5,861,709.00	0.39
65	605319	无锡振华	251,608	5,792,016.16	0.39
66	600988	赤峰黄金	400,000	5,604,000.00	0.38
67	002011	盾安环境	393,900	5,416,125.00	0.36
68	301312	智立方	48,300	5,232,822.00	0.35
69	300762	上海瀚讯	344,200	5,190,536.00	0.35
70	300538	同益股份	227,800	4,553,722.00	0.30
71	600276	恒瑞医药	96,000	4,342,080.00	0.29
72	601918	新集能源	800,000	4,216,000.00	0.28
73	601919	中远海控	433,600	4,153,888.00	0.28
74	603099	长白山	234,200	3,508,316.00	0.23

75	688062	迈威生物	93,860	3,068,283.40	0.21
76	000516	国际医学	375,600	3,046,116.00	0.20
77	601717	郑煤机	235,800	2,982,870.00	0.20
78	002429	兆驰股份	529,100	2,952,378.00	0.20
79	000983	山西焦煤	293,600	2,900,768.00	0.19
80	601001	晋控煤业	223,500	2,755,755.00	0.18
81	688331	荣昌生物	44,285	2,748,327.10	0.18
82	688270	臻镭科技	22,705	1,552,567.90	0.10
83	688001	华兴源创	43,967	1,536,646.65	0.10
84	688336	三生国健	62,024	1,396,160.24	0.09
85	688177	百奥泰	31,831	1,312,710.44	0.09
86	300406	九强生物	37,000	706,700.00	0.05
87	002465	海格通信	50,000	642,500.00	0.04
88	300031	宝通科技	30,000	556,200.00	0.04
89	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
90	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
91	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
92	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
93	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
94	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
95	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
96	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
97	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
98	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
99	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
100	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
101	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
102	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
103	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
104	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
105	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
106	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
107	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
108	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
109	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
110	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
111	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
112	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
113	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
114	301360	荣旗科技	134	12,542.40	0.00
115	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
116	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
117	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00

118	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
119	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
120	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
121	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
122	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
123	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
124	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
125	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
126	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
127	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
128	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
129	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
130	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
131	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
132	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
133	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
134	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
135	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
136	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
137	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
138	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
139	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
140	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
141	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
142	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
143	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
144	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
145	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
146	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
147	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
148	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
149	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
150	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
151	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
152	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
153	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
154	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
155	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
156	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
157	873690	捷众科技	500	4,670.00	0.00
158	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
159	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
160	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00

161	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
162	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
163	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
164	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
165	601965	中国汽研	100	2,206.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601186	中国铁建	145,692,001.46	7.00
2	601398	工商银行	145,577,263.00	6.99
3	600519	贵州茅台	123,403,166.94	5.93
4	601088	中国神华	115,643,732.26	5.56
5	601390	中国中铁	115,393,199.22	5.54
6	601360	三六零	114,689,701.95	5.51
7	600547	山东黄金	99,606,759.12	4.79
8	688111	金山办公	97,797,186.09	4.70
9	002230	科大讯飞	96,462,393.44	4.63
10	001979	招商蛇口	95,835,435.00	4.60
11	601728	中国电信	94,620,742.60	4.55
12	600938	中国海油	88,583,582.40	4.26
13	601006	大秦铁路	83,688,309.21	4.02
14	600941	中国移动	83,282,061.15	4.00
15	601899	紫金矿业	80,642,867.08	3.87
16	002236	大华股份	80,394,430.48	3.86
17	300033	同花顺	77,071,625.50	3.70
18	600489	中金黄金	76,789,409.59	3.69
19	000568	泸州老窖	74,380,808.50	3.57
20	002050	三花智控	74,114,180.45	3.56
21	300308	中际旭创	67,216,048.10	3.23
22	002555	三七互娱	66,111,732.74	3.18
23	600085	同仁堂	65,274,975.80	3.14
24	000066	中国长城	64,316,680.11	3.09
25	002517	恺英网络	64,024,771.03	3.08
26	600050	中国联通	64,006,130.00	3.08
27	601985	中国核电	62,687,437.39	3.01
28	000963	华东医药	60,308,422.92	2.90
29	688017	绿的谐波	58,331,870.75	2.80
30	603728	鸣志电器	58,200,623.37	2.80
31	300573	兴齐眼药	57,395,695.96	2.76
32	603444	吉比特	57,319,762.75	2.75
33	000333	美的集团	53,696,065.50	2.58

34	600985	淮北矿业	50,475,052.40	2.43
35	300496	中科创达	45,183,948.09	2.17
36	000807	云铝股份	45,031,872.59	2.16
37	600886	国投电力	44,940,237.00	2.16
38	600028	中国石化	44,311,228.80	2.13
39	002912	中新赛克	42,975,799.08	2.06

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	207,448,159.70	9.97
2	688111	金山办公	126,405,956.90	6.07
3	601186	中国铁建	119,587,491.22	5.75
4	601398	工商银行	115,472,563.00	5.55
5	001979	招商蛇口	111,101,328.44	5.34
6	002230	科大讯飞	109,701,158.64	5.27
7	300896	爱美客	104,339,150.26	5.01
8	601360	三六零	98,593,823.78	4.74
9	601390	中国中铁	94,506,656.80	4.54
10	002517	恺英网络	85,635,183.28	4.11
11	600809	山西汾酒	77,847,477.12	3.74
12	002472	双环传动	77,658,952.94	3.73
13	600941	中国移动	76,654,570.48	3.68
14	600763	通策医疗	75,654,561.87	3.63
15	600938	中国海油	74,358,716.00	3.57
16	002126	银轮股份	71,306,525.68	3.43
17	300957	贝泰妮	71,020,910.79	3.41
18	601728	中国电信	68,848,354.90	3.31
19	002555	三七互娱	68,065,785.90	3.27
20	600536	中国软件	67,597,105.35	3.25
21	002236	大华股份	64,741,476.38	3.11
22	601006	大秦铁路	60,777,435.88	2.92
23	600050	中国联通	60,107,853.00	2.89
24	601088	中国神华	59,390,433.00	2.85
25	000333	美的集团	58,303,512.18	2.80
26	000066	中国长城	56,145,555.64	2.70
27	601318	中国平安	54,525,189.00	2.62
28	300015	爱尔眼科	53,507,599.68	2.57
29	000963	华东医药	51,974,582.27	2.50
30	601857	中国石油	50,448,843.25	2.42
31	603444	吉比特	49,238,481.20	2.37
32	600305	恒顺醋业	49,003,079.72	2.35



33	600612	老凤祥	47,601,295.90	2.29
34	600048	保利发展	47,554,509.00	2.28
35	600547	山东黄金	47,525,763.98	2.28
36	600886	国投电力	46,364,577.24	2.23
37	601689	拓普集团	46,232,127.28	2.22
38	300308	中际旭创	45,532,328.50	2.19
39	002912	中新赛克	45,300,141.18	2.18
40	600131	国网信通	45,216,186.37	2.17
41	300179	四方达	44,003,630.25	2.11
42	600985	淮北矿业	43,925,670.00	2.11
43	601601	中国太保	42,160,050.38	2.03

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	6,808,567,853.93
卖出股票收入（成交）总额	7,153,015,200.15

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	735,829.26
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,594.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	768,424.09

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
华泰柏瑞 品质成长 混合 A	37,557	66,963.94	6,994,213.86	0.28	2,507,970,365.77	99.72
华泰柏瑞 品质成长 混合 C	6,632	21,173.64	0.00	0.00	140,423,555.36	100.00
合计	43,690	60,777.94	6,994,213.86	0.26	2,648,393,921.13	99.74

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）。

### 9.2 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	华泰柏瑞品质成长混合 A	530,538.17	0.0211
	华泰柏瑞品质成长混合 C	289,385.57	0.2061
	合计	819,923.74	0.0309

### 9.3 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	华泰柏瑞品质成长混合 A	0
	华泰柏瑞品质成长混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞品质成长混合 A	10~50
	华泰柏瑞品质成长混合 C	0
	合计	10~50

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
沈雪峰	公募基金	>100
	私募资产管理计划	>100
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C
基金合同生效日 (2021 年 3 月 3 日) 基金份额总额	4,935,940,581.32	180,529,951.26
本报告期期初基金份额总额	3,046,046,149.79	162,822,346.90
本报告期基金总申购份额	34,256,243.30	7,050,295.84
减：本报告期基金总赎回份额	565,337,813.46	29,449,087.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,514,964,579.63	140,423,555.36

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

基金管理人重大人事变动：

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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 3 年

的审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 11 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	私募资产管理业务与投资顾问业务未能有效分离
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 (%)	
华泰证券	5	7,364,536,238.40	52.83	6,840,571.35	52.71	-
方正证券	4	2,134,433,581.82	15.31	1,994,305.03	15.37	-
中信建投	2	1,837,358,621.39	13.18	1,720,909.97	13.26	-
平安证券	2	1,124,179,325.74	8.06	1,040,119.35	8.01	-
上海证券	2	902,658,373.20	6.47	836,411.38	6.44	-
广发证券	2	577,735,285.89	4.14	546,480.36	4.21	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、本报告期内本基金新增华泰证券、方正证券、中信建投、上海证券、平安证券、广发证券、国金证券、银河证券、招商证券、中信证券的交易单元。

### 11.7.2 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(%)
华泰证券	5,223,520.75	100.00	8,232,000.00	47.76	-	-
方正证券	-	-	330,000.00	1.91	-	-
中信建投	-	-	1,785,000.00	10.36	-	-
平安证券	-	-	1,800,000.00	10.44	-	-
上海证券	-	-	4,940,000.00	28.66	-	-
广发证券	-	-	150,000.00	0.87	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 12 月 26 日
2	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 12 月 23 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与贵州省贵文文化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 12 月 16 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 12 月 13 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 12 月 01 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 11 月 08 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 20 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止尚智逢源(北京)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 19 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 09 月 07 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 26 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公	证监会规定报刊和网站	2023 年 08 月 22 日

	告		
14	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 08 月 17 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 08 月 11 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通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 08 月 08 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通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 08 月 05 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 07 月 12 日
19	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 06 月 27 日
20	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 06 月 16 日
21	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 05 月 09 日
22	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 04 月 29 日
23	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 04 月 19 日
24	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 04 月 14 日
25	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 04 月 11 日
26	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 03 月 30 日
27	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 03 月 22 日
28	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 03 月 21 日



	公告		
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 03 月 18 日
30	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 02 月 23 日
31	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 02 月 08 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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

2024 年 3 月 30 日