

华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化优选混合
基金主代码	000877
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 17 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	536,426,296.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、股票投资策略：本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>2、固定收益资产投资策略：本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略：在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>4、权证投资策略：权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>5、其他金融衍生工具投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。</p>
业绩比较基准	95%*沪深 300 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	王小飞
	联系电话	021-38601777	021-60637103
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	021-60637228
传真		021-38601799	021-60635778
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		贾波	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-27,172,375.30
本期利润	19,133,763.98
加权平均基金份额本期利润	0.0357
本期加权平均净值利润率	2.69%
本期基金份额净值增长率	2.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	177,570,985.44
期末可供分配基金份额利润	0.3310
期末基金资产净值	713,997,282.43
期末基金份额净值	1.3310
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	95.58%

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。

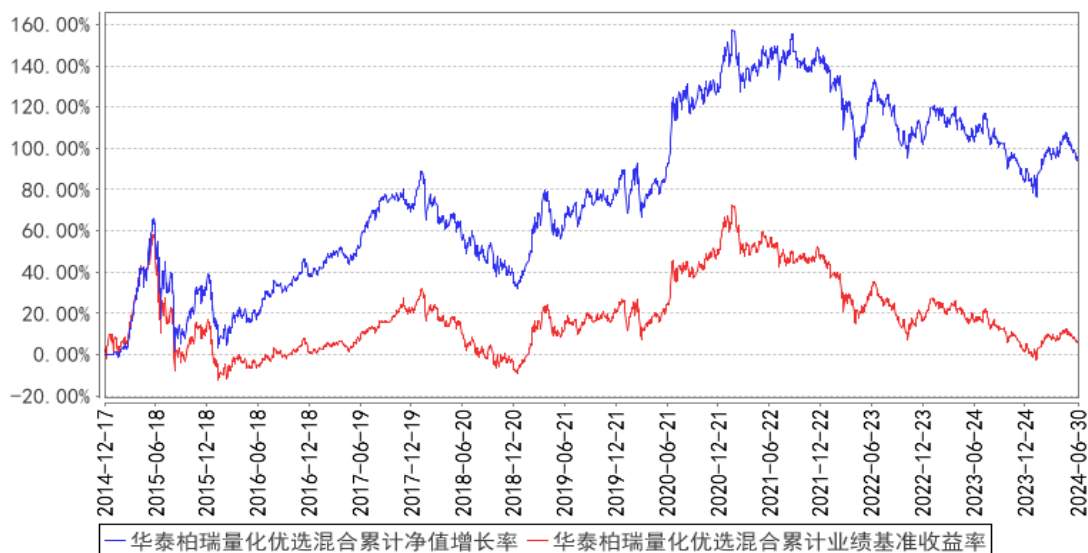
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.11%	0.62%	-3.14%	0.46%	0.03%	0.16%
过去三个月	-0.71%	0.80%	-2.03%	0.72%	1.32%	0.08%
过去六个月	2.88%	0.95%	0.88%	0.85%	2.00%	0.10%
过去一年	-5.89%	0.86%	-9.38%	0.83%	3.49%	0.03%
过去三年	-21.37%	0.94%	-32.19%	0.99%	10.82%	-0.05%
自基金合同生效起至今	95.58%	1.31%	5.85%	1.31%	89.73%	0.00%

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

华泰柏瑞量化优选混合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：图示日期为 2014 年 12 月 17 日至 2024 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下管理 156 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

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		
雷文渊	本基金的基金经理	2022 年 8 月 5 日	-	6 年	复旦大学数学学院本科、金融专业硕士。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2022 年 8 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
盛豪	量化与海外投资部总监、本基金的基金经理	2015 年 10 月 13 日	-	16 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。现任量化与海外投资部总监。2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至

					<p>2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 11 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
盛豪	公募基金	8	2,191,930,873.11	2015 年 10 月 13 日
	私募资产管理计划	1	3,565,114.82	2022 年 12 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	2,195,495,987.93	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 3 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 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

2024 年上半年，A 股整体呈震荡走势，风格上分化较大。春节过后，市场从前期由短期资金流造成的剧烈波动中恢复，转而更加关注公司基本面。一方面，随着美国 OpenAI 公司和苹果公司在 AI 软件和硬件上的推陈出新，AI 算力的成长性打开向上空间。同时，伴随着海外产能和基础设施建设，供应链转移等因素，上游大宗商品和设备出口迎来涨价和业绩兑现。而另一方面，大部分中下游和内需相关产业链经历了业绩预期下修的过程。上半年，A 股市场中银行、能源、公用事业等高股息相关行业表现较强，同时以人工智能创新链、消费电子复苏链为代表的“科特估”主题先后成为市场热点。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别上涨 2.95% 和 0.89%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数上涨 11.03%；代表小市值公司的中证 1000 和中证 2000 指数同期涨跌幅分别为-16.84% 和 -23.28%。横向比较来看，大市值与高股息板块相对较强，中小市值下跌较多。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。由于我们对上市公司财务质量和经营质量的把控较为系统和严谨，在投资全流程中的风控较为严格，因而在本轮小微盘急跌过程和上市公司退市风波中，超额收益几乎不受影响，超额收益波动较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3310 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.88%，业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，中国经济的韧性仍然值得期待。上半年，出口数据显示出强劲的景气度，往后看短期或许会受到海外政治周期扰动，但我们预计许多企业的“出海”战略布局长期有望持续贡献增长。时隔十年，“国九条”再次发布，投资者可能更加重视公司基本面质量的定价，证券市场的定价有效性有望逐步提高。当前，A 股市场许多股票已处于超跌状态，整体估值较低，等待投资人情绪的恢复。在不出现极端情况的前提下，我们对未来几个季度的 A 股股票市场持比较乐观的态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，我们看到市场正逐渐回归基本面逻辑。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的质量因子近期表现较好，我们预期其趋势或仍将延续，而我们的成长因子可能会继续表现良好；同时，小微盘的风险得到释放之后，大小市值、各行业股票可能均有机会，量化投资全市场选股的优势可能将得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值偏低，投资人交易行为更加注重基本面，我们认为专注于基本面的量化投资超额收益有望得到进一步提高，或是很不错的配置风格均衡的基本面量化基金的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	42,005,253.68	62,774,568.79
结算备付金		15,321,985.06	14,903,784.97
存出保证金		43,523.74	52,492.71
交易性金融资产	6.4.7.2	658,497,674.01	651,059,538.36
其中：股票投资		658,497,674.01	650,432,497.13
基金投资		-	-
债券投资		-	627,041.23
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		42,664.18	83,274.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		715,911,100.67	728,873,659.21
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	26,434,885.75
应付赎回款		144,156.60	169,088.88
应付管理人报酬		714,028.18	693,955.52
应付托管费		119,004.69	115,659.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,385.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	936,628.77	601,306.22
负债合计		1,913,818.24	28,016,280.74
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	536,426,296.99	541,689,743.66
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	177,570,985.44	159,167,634.81
净资产合计		713,997,282.43	700,857,378.47
负债和净资产总计		715,911,100.67	728,873,659.21

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3310 元，基金份额总额 536,426,296.99 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
-----	-----	--	---

一、营业总收入		24,196,204.08	12,582,533.45
1. 利息收入		199,510.24	141,689.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	190,672.57	141,689.89
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,837.67	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-22,343,361.46	10,400,945.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-34,445,406.20	837,013.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	90,204.04	17,140.41
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	2,128,559.51	-90,966.69
股利收益	6.4.7.19	9,883,281.19	9,637,758.06
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	46,306,139.28	2,023,389.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	33,916.02	16,508.83
减：二、营业总支出		5,062,440.10	6,697,470.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,247,069.71	5,655,613.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	707,844.91	942,602.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		7,672.88	0.09
8. 其他费用	6.4.7.23	99,852.60	99,254.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,133,763.98	5,885,062.99

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,133,763.98	5,885,062.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,133,763.98	5,885,062.99

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	541,689,743.66	-	159,167,634.81	700,857,378.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	541,689,743.66	-	159,167,634.81	700,857,378.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,263,446.67	-	18,403,350.63	13,139,903.96
(一)、综合收益总额	-	-	19,133,763.98	19,133,763.98
(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)	-5,263,446.67	-	-730,413.35	-5,993,860.02
其中：1. 基金申购款	13,724,967.68	-	4,568,791.06	18,293,758.74
2. 基金赎回款	-18,988,414.35	-	-5,299,204.41	-24,287,618.76
(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	536,426,296.99	-	177,570,985.44	713,997,282.43
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	448,741,210.23	-	227,505,698.33	676,246,908.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	448,741,210.23	-	227,505,698.33	676,246,908.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	61,477,301.99	-	42,171,602.31	103,648,904.30
（一）、综合收益总额	-	-	5,885,062.99	5,885,062.99
（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)	61,477,301.99	-	36,286,539.32	97,763,841.31
其中：1. 基金申购款	73,108,365.48	-	42,937,917.92	116,046,283.40
2. 基金赎回款	-11,631,063.49	-	-6,651,378.60	-18,282,442.09
（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	510,218,512.22	-	269,677,300.64	779,895,812.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 1132 号《关于准予华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,619,915,951.10 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(2014)第 768 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,620,221,925.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 305,974.34 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0-95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 95%*沪深 300 指数收益率+5%*银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2024 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业

会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管

产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	42,005,253.68
等于：本金	42,001,281.92
加：应计利息	3,971.76
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	42,005,253.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	673,150,214.33	-	658,497,674.01	-14,652,540.32
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	673,150,214.33	-	658,497,674.01	-14,652,540.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 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。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	148.59
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	846,972.58
其中：交易所市场	846,972.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	936,628.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	541,689,743.66	541,689,743.66
本期申购	13,724,967.68	13,724,967.68
本期赎回（以“-”号填列）	-18,988,414.35	-18,988,414.35
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	536,426,296.99	536,426,296.99

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	418,781,357.92	-259,613,723.11	159,167,634.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	418,781,357.92	-259,613,723.11	159,167,634.81
本期利润	-27,172,375.30	46,306,139.28	19,133,763.98
本期基金份额交易产生的变动数	-3,999,827.91	3,269,414.56	-730,413.35
其中：基金申购款	9,840,523.51	-5,271,732.45	4,568,791.06
基金赎回款	-13,840,351.42	8,541,147.01	-5,299,204.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	387,609,154.71	-210,038,169.27	177,570,985.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	78,002.05
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	112,316.57	

其他	353.95
合计	190,672.57

注：其他为结算保证金利息收入、直销申购款利息收入和期货备付金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-34,445,406.20
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	-34,445,406.20

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	668,050,333.91
减：卖出股票成本总额	700,851,077.46
减：交易费用	1,644,662.65
买卖股票差价收入	-34,445,406.20

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	72.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	90,131.99
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	90,204.04

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	717,276.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	627,000.00
减：应计利息总额	115.44
减：交易费用	28.69
买卖债券差价收入	90,131.99

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	2,128,559.51

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,883,281.19
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	9,883,281.19

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	46,306,139.28
股票投资	46,306,139.28
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	46,306,139.28

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	11,430.13
基金转换费收入	22,485.89
合计	33,916.02

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	9,000.00
银行划款手续费	1,345.00
合计	99,852.60

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
华泰证券	3,303.30	0.00	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)

华泰证券	1.65	0.00	1.65	0.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

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（截至 2024 年 6 月 30 日）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,247,069.71	5,655,613.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	574,339.43	685,041.90
应支付基金管理人的净管理费	3,672,730.28	4,970,571.33

注：自 2023 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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	707,844.91	942,602.24

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 25 日，支付基金托管人中国建设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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25%/ 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，支付基金托管人中国建设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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 12 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,424,505.14	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	6,424,505.14
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	6,424,505.14	6,424,505.14
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.1977%	1.2592%

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	42,005,253.68	78,002.05	56,449,462.53	79,605.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	688709	成都华微	网下申购	10,448	163929.12
华泰联合证券有限责任公司	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26705.80
华泰联合证券有限责任公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合证券有限责任公司	603312	西典新能	网下申购	1,296	37609.92
华泰联合证券有限责任公司	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66406.88
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	301408.SZ	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券有限责任公司	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券有限责任公司	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券有限责任公司	603137.SH	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80

华泰联合证券 有限责任公司	688478. SH	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合证券 有限责任公司	688469. SH	中芯集成	网下申购	89,696	510,370.24
华泰联合证券 有限责任公司	688512. SH	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券 有限责任公司	688472. SH	阿特斯	网下申购	28,658	318,103.80
华泰联合证券 有限责任公司	300804. SZ	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券 有限责任公司	688429. SH	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券 有限责任公司	118031. SH	天 23 转债	网上配售	1,030	103,000.00
华泰联合证券 有限责任公司	601916. SH	浙商银行	网上配股	336,030	678,780.60

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
001359	平安 电 工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾 达 科 技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪 祺 电 气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广	2024	6 个月	新 股	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

	合科技	年 3 月 26 日		锁定期内						
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月以上	新股锁定期内	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯	2024	6 个月	新股	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

	特 股 份	年 2 月 20 日		锁 定 期 内						
601033	永 兴 股 份	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	16.20	15.96	951	15,406.20	15,177.96	-
603082	北 自 科 技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键 邦 股 份	2024 年 6 月 28 日	1 个月 内 (含)	新 股 未 上 市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603312	西 典 新 能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博 隆 技 术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙 旗 科 技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星 德 胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安 乃 达	2024 年 6 月 26 日	1 个月 内 (含)	新 股 未 上 市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
603375	盛 景 微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永 臻 股 份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新 股 锁 定 期 内	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧	2024	6 个月	新 股	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

	莱新材	年 4 月 29 日		锁定期内						
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无

债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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中国建设银行，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 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.09%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	42,005,253.68	-	-	-	-	-	42,005,253.68
结算备付金	15,321,985.06	-	-	-	-	-	15,321,985.06
存出保证金	43,523.74	-	-	-	-	-	43,523.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	658,497,674.01	658,497,674.01
应收申购款	-	-	-	-	-	42,664.18	42,664.18
资产总计	57,370,762.48	-	-	-	-	658,540,338.19	715,911,100.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	144,156.60	144,156.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	714,028.18	714,028.18
应付托管费	-	-	-	-	-	119,004.69	119,004.69
其他负债	-	-	-	-	-	936,628.77	936,628.77
负债总计	-	-	-	-	-	1,913,818.24	1,913,818.24
利率敏感度缺口	57,370,762.48	-	-	-	-	-656,626,519.95	713,997,282.43
上年度末 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
资产							
货币资金	62,774,568.79	-	-	-	-	-	62,774,568.79
结算备付金	14,903,784.97	-	-	-	-	-	14,903,784.97
存出保证金	52,492.71	-	-	-	-	-	52,492.71
交易性金融资产	-	-	-	627,041.23	-	650,432,497.13	651,059,538.36
应收申购款	-	-	-	-	-	83,274.38	83,274.38
资产总计	77,730,846.47	-	-	627,041.23	-	650,515,771.51	728,873,659.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	169,088.88	169,088.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	693,955.52	693,955.52
应付托管费	-	-	-	-	-	115,659.24	115,659.24
应付清算款	-	-	-	-	-	26,434,885.75	26,434,885.75
应交税费	-	-	-	-	-	1,385.13	1,385.13
其他负债	-	-	-	-	-	601,306.22	601,306.22
负债总计	-	-	-	-	-	28,016,280.74	28,016,280.74
利率敏感度缺口	77,730,846.47	-	-	627,041.23	-	-622,499,490.77	700,857,378.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：0.09%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	658,497,674.01	92.23	650,432,497.13	92.81
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	658,497,674.01	92.23	650,432,497.13	92.81

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	36,892,281.83	30,940,311.19
沪深 300 指数下降 5%	-36,892,281.83	-30,940,311.19	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	658,191,898.99	649,298,452.24
第二层次	45,611.11	627,041.23
第三层次	260,163.91	1,134,044.89
合计	658,497,674.01	651,059,538.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、

交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	658,497,674.01	91.98
	其中：股票	658,497,674.01	91.98
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	57,327,238.74	8.01
8	其他各项资产	86,187.92	0.01
9	合计	715,911,100.67	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	1,963,212.00	0.27
B	采矿业	38,878,970.00	5.45
C	制造业	331,856,087.70	46.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,213,262.40	4.37
E	建筑业	21,333,007.60	2.99
F	批发和零售业	12,633,996.00	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	22,833,277.00	3.20
H	住宿和餐饮业	264,270.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,689,264.97	3.88
J	金融业	148,847,174.21	20.85
K	房地产业	4,941,555.17	0.69
L	租赁和商务服务业	9,415,393.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	1,084,542.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	3,859,521.96	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	220,800.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,463,340.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	658,497,674.01	92.23

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	14,522	21,309,437.58	2.98
2	600036	招商银行	458,670	15,681,927.30	2.20
3	601318	中国平安	283,800	11,737,968.00	1.64
4	300750	宁德时代	63,760	11,478,712.80	1.61
5	601601	中国太保	387,464	10,794,747.04	1.51
6	601336	新华保险	315,729	9,481,341.87	1.33
7	601319	中国人保	1,551,000	7,987,650.00	1.12
8	600000	浦发银行	961,700	7,914,791.00	1.11
9	688798	艾为电子	137,603	7,791,081.86	1.09
10	601169	北京银行	1,262,800	7,374,752.00	1.03
11	601668	中国建筑	1,365,600	7,251,336.00	1.02
12	300628	亿联网络	194,120	7,137,792.40	1.00
13	601916	浙商银行	2,529,830	6,982,330.80	0.98

14	000651	格力电器	177,200	6,949,784.00	0.97
15	601717	郑煤机	437,300	6,472,040.00	0.91
16	601919	中远海控	415,200	6,431,448.00	0.90
17	600926	杭州银行	488,200	6,371,010.00	0.89
18	000858	五粮液	49,269	6,308,402.76	0.88
19	601899	紫金矿业	339,000	5,956,230.00	0.83
20	601166	兴业银行	325,435	5,734,164.70	0.80
21	601211	国泰君安	422,248	5,721,460.40	0.80
22	601127	赛力斯	62,200	5,667,664.00	0.79
23	000333	美的集团	87,420	5,638,590.00	0.79
24	601001	晋控煤业	337,600	5,577,152.00	0.78
25	000001	平安银行	533,700	5,417,055.00	0.76
26	601390	中国中铁	803,255	5,237,222.60	0.73
27	600655	豫园股份	1,005,600	5,178,840.00	0.73
28	601857	中国石油	490,700	5,064,024.00	0.71
29	000568	泸州老窖	35,000	5,022,150.00	0.70
30	300308	中际旭创	36,260	4,999,528.80	0.70
31	601186	中国铁建	578,900	4,961,173.00	0.69
32	600741	华域汽车	301,200	4,933,656.00	0.69
33	002557	洽洽食品	173,412	4,888,484.28	0.68
34	300433	蓝思科技	264,200	4,821,650.00	0.68
35	601577	长沙银行	581,700	4,758,306.00	0.67
36	600642	申能股份	533,800	4,713,454.00	0.66
37	600011	华能国际	486,100	4,676,282.00	0.65
38	601138	工业富联	169,800	4,652,520.00	0.65
39	603605	珀莱雅	41,513	4,607,527.87	0.65
40	000690	宝新能源	898,200	4,580,820.00	0.64
41	601137	博威合金	295,203	4,498,893.72	0.63
42	601766	中国中车	589,900	4,430,149.00	0.62
43	688036	传音控股	57,863	4,428,834.02	0.62
44	601665	齐鲁银行	900,500	4,421,455.00	0.62
45	601633	长城汽车	172,100	4,354,130.00	0.61
46	001965	招商公路	362,200	4,295,692.00	0.60
47	600050	中国联通	898,500	4,222,950.00	0.59
48	600346	恒力石化	293,100	4,088,745.00	0.57
49	600023	浙能电力	574,400	4,083,984.00	0.57
50	600919	江苏银行	549,100	4,079,813.00	0.57
51	002475	立讯精密	98,467	3,870,737.77	0.54
52	600886	国投电力	212,000	3,866,880.00	0.54
53	603568	伟明环保	186,800	3,844,344.00	0.54
54	601628	中国人寿	123,300	3,828,465.00	0.54
55	688578	艾力斯	59,800	3,811,652.00	0.53
56	600362	江西铜业	157,600	3,731,968.00	0.52

57	002410	广联达	374,800	3,590,584.00	0.50
58	600489	中金黄金	242,100	3,583,080.00	0.50
59	601156	东航物流	175,700	3,575,495.00	0.50
60	601598	中国外运	633,300	3,565,479.00	0.50
61	300394	天孚通信	39,880	3,526,189.60	0.49
62	600028	中国石化	554,800	3,506,336.00	0.49
63	601818	光大银行	1,100,500	3,488,585.00	0.49
64	300896	爱美客	19,880	3,421,348.00	0.48
65	600312	平高电气	174,900	3,401,805.00	0.48
66	601888	中国中免	53,700	3,355,713.00	0.47
67	601658	邮储银行	650,300	3,297,021.00	0.46
68	601898	中煤能源	264,100	3,295,968.00	0.46
69	600066	宇通客车	127,200	3,281,760.00	0.46
70	601998	中信银行	484,800	3,248,160.00	0.45
71	601800	中国交建	356,500	3,187,110.00	0.45
72	603198	迎驾贡酒	55,000	3,162,500.00	0.44
73	600057	厦门象屿	462,400	3,144,320.00	0.44
74	002384	东山精密	150,400	3,113,280.00	0.44
75	600938	中国海油	92,900	3,065,700.00	0.43
76	300841	康华生物	60,300	3,053,592.00	0.43
77	600901	江苏租赁	601,900	3,039,595.00	0.43
78	688408	中信博	32,991	3,037,811.28	0.43
79	300760	迈瑞医疗	10,400	3,025,464.00	0.42
80	300783	三只松鼠	137,300	3,002,751.00	0.42
81	300502	新易盛	28,400	2,997,620.00	0.42
82	688213	思特威	61,480	2,981,780.00	0.42
83	002100	天康生物	429,400	2,975,742.00	0.42
84	000725	京东方 A	727,300	2,974,657.00	0.42
85	688008	澜起科技	51,800	2,960,888.00	0.41
86	688123	聚辰股份	47,600	2,895,508.00	0.41
87	600483	福能股份	247,740	2,888,648.40	0.40
88	688187	时代电气	57,600	2,844,288.00	0.40
89	688599	天合光能	166,727	2,821,020.84	0.40
90	688111	金山办公	12,200	2,775,500.00	0.39
91	300866	安克创新	38,840	2,765,796.40	0.39
92	600809	山西汾酒	13,000	2,741,440.00	0.38
93	601009	南京银行	263,300	2,735,687.00	0.38
94	000661	长春高新	29,200	2,679,684.00	0.38
95	002948	青岛银行	793,200	2,673,084.00	0.37
96	301207	华兰疫苗	147,400	2,604,558.00	0.36
97	603993	洛阳钼业	299,900	2,549,150.00	0.36
98	000338	潍柴动力	154,200	2,504,208.00	0.35
99	000157	中联重科	325,700	2,501,376.00	0.35

100	300529	健帆生物	91,200	2,481,552.00	0.35
101	300973	立高食品	88,100	2,474,729.00	0.35
102	000596	古井贡酒	11,700	2,469,519.00	0.35
103	300390	天华新能	142,800	2,453,304.00	0.34
104	600030	中信证券	134,570	2,453,211.10	0.34
105	300682	朗新集团	285,600	2,430,456.00	0.34
106	603368	柳药集团	136,200	2,383,500.00	0.33
107	600048	保利发展	269,000	2,356,440.00	0.33
108	601155	新城控股	264,391	2,345,148.17	0.33
109	000423	东阿阿胶	36,800	2,303,680.00	0.32
110	688016	心脉医疗	23,244	2,279,074.20	0.32
111	300769	德方纳米	80,740	2,276,868.00	0.32
112	600019	宝钢股份	339,700	2,259,005.00	0.32
113	603609	禾丰股份	339,400	2,219,676.00	0.31
114	002736	国信证券	254,600	2,212,474.00	0.31
115	688188	柏楚电子	11,869	2,190,423.95	0.31
116	002648	卫星化学	121,200	2,179,176.00	0.31
117	600566	济川药业	68,100	2,159,451.00	0.30
118	002746	仙坛股份	372,500	2,134,425.00	0.30
119	300122	智飞生物	75,750	2,123,272.50	0.30
120	601233	桐昆股份	131,100	2,092,356.00	0.29
121	688278	特宝生物	38,400	2,056,320.00	0.29
122	601229	上海银行	281,100	2,040,786.00	0.29
123	603345	安井食品	27,400	2,036,094.00	0.29
124	000915	华特达因	66,600	2,008,656.00	0.28
125	300773	拉卡拉	161,200	2,003,716.00	0.28
126	002048	宁波华翔	149,300	1,931,942.00	0.27
127	600737	中粮糖业	201,400	1,931,426.00	0.27
128	600557	康缘药业	122,200	1,918,540.00	0.27
129	000975	山金国际	116,800	1,902,672.00	0.27
130	603338	浙江鼎力	31,400	1,897,188.00	0.27
131	002594	比亚迪	7,450	1,864,362.50	0.26
132	600989	宝丰能源	107,500	1,862,975.00	0.26
133	600765	中航重机	90,600	1,848,240.00	0.26
134	002025	航天电器	39,600	1,836,648.00	0.26
135	001872	招商港口	95,400	1,836,450.00	0.26
136	600985	淮北矿业	108,100	1,809,594.00	0.25
137	002152	广电运通	170,600	1,784,476.00	0.25
138	000951	中国重汽	123,500	1,768,520.00	0.25
139	688772	珠海冠宇	118,200	1,761,180.00	0.25
140	002714	牧原股份	39,300	1,713,480.00	0.24
141	000786	北新建材	55,900	1,657,994.00	0.23
142	002555	三七互娱	126,500	1,650,825.00	0.23

143	600582	天地科技	234,200	1,613,638.00	0.23
144	601607	上海医药	84,100	1,607,151.00	0.23
145	002465	海格通信	150,700	1,561,252.00	0.22
146	600183	生益科技	72,700	1,531,062.00	0.21
147	600999	招商证券	109,200	1,518,972.00	0.21
148	000932	华菱钢铁	340,200	1,507,086.00	0.21
149	688232	新点软件	76,400	1,506,608.00	0.21
150	002371	北方华创	4,700	1,503,483.00	0.21
151	000630	铜陵有色	414,400	1,495,984.00	0.21
152	000933	神火股份	72,700	1,470,721.00	0.21
153	600153	建发股份	164,200	1,466,306.00	0.21
154	300251	光线传媒	174,000	1,463,340.00	0.20
155	601865	福莱特	72,000	1,447,200.00	0.20
156	000600	建投能源	224,800	1,416,240.00	0.20
157	300428	立中集团	75,800	1,409,122.00	0.20
158	002001	新和成	73,000	1,401,600.00	0.20
159	300207	欣旺达	91,000	1,380,470.00	0.19
160	600900	长江电力	45,700	1,321,644.00	0.19
161	600027	华电国际	189,800	1,317,212.00	0.18
162	603323	苏农银行	273,400	1,315,054.00	0.18
163	002304	洋河股份	16,200	1,307,988.00	0.18
164	603195	公牛集团	16,815	1,296,772.80	0.18
165	600887	伊利股份	50,100	1,294,584.00	0.18
166	603688	石英股份	43,650	1,292,476.50	0.18
167	002558	巨人网络	135,200	1,276,288.00	0.18
168	003012	东鹏控股	207,700	1,269,047.00	0.18
169	603501	韦尔股份	12,700	1,261,999.00	0.18
170	600755	厦门国贸	174,000	1,247,580.00	0.17
171	601666	平煤股份	109,000	1,220,800.00	0.17
172	002583	海能达	299,300	1,218,151.00	0.17
173	300274	阳光电源	19,460	1,207,103.80	0.17
174	002236	大华股份	74,100	1,145,586.00	0.16
175	601600	中国铝业	148,500	1,133,055.00	0.16
176	603444	吉比特	6,300	1,121,463.00	0.16
177	603556	海兴电力	23,800	1,114,554.00	0.16
178	688389	普门科技	67,000	1,089,420.00	0.15
179	000166	申万宏源	252,100	1,086,551.00	0.15
180	688105	诺唯赞	54,200	1,084,542.00	0.15
181	002847	盐津铺子	24,800	1,060,696.00	0.15
182	300724	捷佳伟创	19,100	1,031,591.00	0.14
183	002468	申通快递	122,100	1,025,640.00	0.14
184	600718	东软集团	122,200	1,010,594.00	0.14
185	600219	南山铝业	260,500	992,505.00	0.14

186	002756	永兴材料	27,720	991,821.60	0.14
187	601991	大唐发电	324,400	976,444.00	0.14
188	605499	东鹏饮料	4,500	970,875.00	0.14
189	600018	上港集团	167,800	969,884.00	0.14
190	002807	江阴银行	256,600	967,382.00	0.14
191	000528	柳 工	85,900	961,221.00	0.13
192	603160	汇顶科技	13,900	955,625.00	0.13
193	000425	徐工机械	130,600	933,790.00	0.13
194	300679	电连技术	23,200	933,336.00	0.13
195	000876	新 希 望	101,300	925,882.00	0.13
196	300035	中科电气	106,400	905,464.00	0.13
197	688276	百克生物	30,000	851,100.00	0.12
198	600585	海螺水泥	35,903	846,951.77	0.12
199	600372	中航机载	70,395	842,628.15	0.12
200	002128	电投能源	39,500	833,450.00	0.12
201	603806	福斯特	56,195	826,066.50	0.12
202	002179	中航光电	21,510	818,455.50	0.11
203	000830	鲁西化工	70,300	814,777.00	0.11
204	002351	漫步者	57,700	758,755.00	0.11
205	603893	瑞芯微	12,300	727,791.00	0.10
206	600089	特变电工	47,400	657,438.00	0.09
207	300119	瑞普生物	46,600	634,692.00	0.09
208	300772	运达股份	65,400	627,840.00	0.09
209	300316	晶盛机电	21,700	623,441.00	0.09
210	600031	三一重工	35,700	589,050.00	0.08
211	002466	天齐锂业	19,300	577,263.00	0.08
212	601369	陕鼓动力	70,200	563,004.00	0.08
213	600104	上汽集团	40,000	554,400.00	0.08
214	002008	大族激光	26,400	549,120.00	0.08
215	002865	钧达股份	14,300	548,834.00	0.08
216	000807	云铝股份	40,300	544,453.00	0.08
217	600872	中炬高新	23,600	535,484.00	0.07
218	002463	沪电股份	14,400	525,600.00	0.07
219	000598	兴蓉环境	68,900	518,128.00	0.07
220	002273	水晶光电	29,300	497,514.00	0.07
221	601816	京沪高铁	90,200	484,374.00	0.07
222	002727	一心堂	30,600	461,754.00	0.06
223	688169	石头科技	1,152	452,275.20	0.06
224	601619	嘉泽新能	149,200	452,076.00	0.06
225	601886	江河集团	89,700	437,736.00	0.06
226	688239	航宇科技	11,800	410,640.00	0.06
227	002608	江苏国信	51,800	401,450.00	0.06
228	603583	捷昌驱动	19,400	395,372.00	0.06

229	600988	赤峰黄金	23,700	387,258.00	0.05
230	600882	妙可蓝多	28,300	352,901.00	0.05
231	601728	中国电信	55,700	342,555.00	0.05
232	000921	海信家电	10,500	338,520.00	0.05
233	600029	南方航空	56,500	332,785.00	0.05
234	000400	许继电气	9,600	330,336.00	0.05
235	688516	奥特维	7,720	322,773.20	0.05
236	601872	招商轮船	37,400	316,030.00	0.04
237	002415	海康威视	10,200	315,282.00	0.04
238	300002	神州泰岳	38,400	311,808.00	0.04
239	600096	云天化	14,800	287,416.00	0.04
240	600754	锦江酒店	11,500	264,270.00	0.04
241	600502	安徽建工	60,100	258,430.00	0.04
242	300498	温氏股份	12,600	249,732.00	0.03
243	002068	黑猫股份	34,800	247,080.00	0.03
244	000776	广发证券	19,900	242,183.00	0.03
245	601528	瑞丰银行	51,100	241,192.00	0.03
246	001979	招商蛇口	27,300	239,967.00	0.03
247	688608	恒玄科技	1,636	239,477.68	0.03
248	000997	新大陆	16,300	226,733.00	0.03
249	300244	迪安诊断	18,400	220,800.00	0.03
250	603300	华铁应急	36,900	201,474.00	0.03
251	603348	文灿股份	6,400	177,216.00	0.02
252	002311	海大集团	3,400	159,970.00	0.02
253	603833	欧派家居	2,700	144,612.00	0.02
254	002497	雅化集团	14,300	127,556.00	0.02
255	301308	江波龙	500	47,370.00	0.01
256	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
257	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
258	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
259	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
260	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
261	601033	永兴股份	951	15,177.96	0.00
262	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
263	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
264	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
265	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
266	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
267	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
268	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
269	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
270	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
271	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00

272	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
273	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
274	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
275	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
276	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
277	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
278	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
279	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
280	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
281	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
282	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
283	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
284	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
285	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
286	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
287	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

注：自 2024 年 7 月 25 日起，证券代码为 000975 的证券简称由“银泰黄金”变更为“山金国际”。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600919	江苏银行	11,004,533.00	1.57
2	300750	宁德时代	8,704,380.71	1.24
3	601919	中远海控	8,447,660.30	1.21
4	600519	贵州茅台	8,407,468.00	1.20
5	600000	浦发银行	7,746,771.00	1.11
6	688798	艾为电子	7,525,077.62	1.07
7	000001	平安银行	7,363,886.00	1.05
8	601336	新华保险	6,535,861.99	0.93
9	000725	京东方 A	5,897,906.00	0.84
10	600655	豫园股份	5,884,656.00	0.84
11	603993	洛阳钼业	5,790,460.00	0.83
12	002557	洽洽食品	5,774,382.92	0.82
13	603267	鸿远电子	5,744,083.00	0.82
14	300122	智飞生物	5,712,938.00	0.82
15	300529	健帆生物	5,694,478.00	0.81
16	000690	宝新能源	5,491,558.00	0.78
17	601601	中国太保	5,438,676.00	0.78
18	601127	赛力斯	5,412,193.00	0.77
19	601137	博威合金	5,334,319.74	0.76

20	000661	长春高新	5,290,104.00	0.75
----	--------	------	--------------	------

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	13,491,983.00	1.93
2	600519	贵州茅台	12,849,748.00	1.83
3	688036	传音控股	8,621,002.73	1.23
4	600919	江苏银行	8,301,267.00	1.18
5	600900	长江电力	8,033,402.18	1.15
6	000100	TCL 科技	7,279,285.20	1.04
7	601108	财通证券	6,550,149.00	0.93
8	601699	潞安环能	6,297,975.00	0.90
9	600309	万华化学	6,141,253.08	0.88
10	603993	洛阳钼业	6,115,345.16	0.87
11	600926	杭州银行	6,018,673.00	0.86
12	002594	比亚迪	5,955,551.00	0.85
13	002244	滨江集团	5,934,567.00	0.85
14	688169	石头科技	5,863,624.31	0.84
15	603267	鸿远电子	5,776,234.00	0.82
16	002736	国信证券	5,729,484.00	0.82
17	300015	爱尔眼科	5,699,841.36	0.81
18	600918	中泰证券	5,614,177.00	0.80
19	002027	分众传媒	5,598,194.00	0.80
20	600066	宇通客车	5,430,117.57	0.77

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	662,610,115.06
卖出股票收入（成交）总额	668,050,333.91

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间因市场流动性较差或者股指期货贴水较大时，我们有使用股指期货套保调整或保持仓位。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,523.74
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,664.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,187.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
94,687	5,665.26	387,938,454.75	72.32	148,487,842.24	27.68

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	921,481.38	0.1718

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年12月17日) 基金份额总额	1,620,221,925.44
本报告期期初基金份额总额	541,689,743.66
本报告期基金总申购份额	13,724,967.68
减：本报告期基金总赎回份额	18,988,414.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	536,426,296.99

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：2024 年 1 月 19 日，公司股东会书面决定尹雷先生担任公司独立董事，陆楨女士不再担任公司独立董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	4	209,834,395.77	15.79	198,484.55	16.20	-
方正证券	3	162,762,748.13	12.25	152,331.34	12.43	-

华宝证券	1	149,258,423 .11	11.23	141,184.93	11.52	-
粤开证券	1	117,851,481 .43	8.87	110,297.58	9.00	-
中信建投	3	69,612,093. 72	5.24	51,228.32	4.18	-
民生证券	4	69,074,890. 93	5.20	64,648.36	5.28	-
中泰证券	2	68,961,365. 58	5.19	65,231.87	5.32	-
国盛证券	2	64,143,052. 34	4.83	47,203.56	3.85	-
国投证券	3	62,717,117. 11	4.72	59,323.28	4.84	-
南京证券	1	60,186,340. 39	4.53	56,930.65	4.65	-
华西证券	1	47,773,957. 06	3.60	45,189.29	3.69	-
太平洋证券	2	44,556,945. 83	3.35	42,147.78	3.44	-
平安证券	2	41,544,960. 98	3.13	39,299.16	3.21	-
天风证券	2	37,019,158. 01	2.79	35,434.03	2.89	-
中金财富证券	2	36,010,486. 91	2.71	34,063.15	2.78	-
江海证券	2	29,963,219. 67	2.25	28,341.63	2.31	-
东海证券	2	20,772,953. 92	1.56	19,441.66	1.59	-
中航证券	1	20,391,402. 78	1.53	19,287.59	1.57	-
金元证券	2	16,350,082. 80	1.23	15,302.38	1.25	-
长江证券	2	58,779.60	0.00	55.60	0.00	-
华泰证券	6	3,303.30	0.00	1.65	0.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：本报告期内：

1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：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，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；
- 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、本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
招商证券	717,276.12	100.00	15,000,000.00	100.00	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
江海证	-	-	-	-	-	-

券						
东海证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证	-	-	-	-	-	-

券						
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
银泰证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 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分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 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	2024 年 03 月 28 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	2024 年 02 月 24 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货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	2024 年 02 月 21 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
8	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	2024 年 02 月 01 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代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	2024 年 01 月 06 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240630;	110,254,048.27	0.00	0.00	110,254,048.27	20.55
	2	20240101-20240520;	133,507,866.43	0.00	133,507,866.43	0.00	0.00
	3	20240521-20240630;	0.00	133,507,866.43	0.00	133,507,866.43	24.89

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理

人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日