

华泰柏瑞量化阿尔法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。

华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 10 月 16 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 10 月 16 日开始计算。

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	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	52
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	52
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	52
§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9	开放式基金份额变动	54
§ 10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	60
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化阿尔法	
基金主代码	005055	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 26 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	117,878,447.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C
下属分级基金的交易代码	005055	006532
报告期末下属分级基金的份额总额	116,877,880.85 份	1,000,567.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，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>(一) 资产配置策略</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>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>(三) 存托凭证投资策略</p> <p>(四) 债券组合投资策略</p> <p>(五) 权证投资策略</p> <p>(六) 资产支持证券投资策略</p> <p>(七) 国债期货投资策略</p> <p>(八) 股指期货投资策略</p> <p>(九) 融资业务的投资策略</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 姓名	刘万方	许俊

负责人	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818
法定代表人		贾波	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 弄证大五道口广场 1 号楼 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)	
	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C
本期已实现收益	-10,700,495.46	-91,908.71
本期利润	911,108.29	-9,319.83
加权平均基金份额本期利润	0.0076	-0.0093
本期加权平均净值利润率	0.61%	-0.75%
本期基金份额净值增长率	0.67%	0.54%
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	28,598,594.12

润		
期末可供分配基金份额利润	0.2447	0.2441
期末基金资产净值	145,476,474.97	1,244,819.60
期末基金份额净值	1.2447	1.2441
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	24.47%	50.04%

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

华泰柏瑞量化阿尔法 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
过去一个月	-3.53%	0.74%	-4.02%	0.54%	0.49%	0.20%
过去三个月	-0.54%	0.85%	-3.09%	0.79%	2.55%	0.06%
过去六个月	0.67%	1.02%	-1.64%	0.98%	2.31%	0.04%
过去一年	-9.01%	0.89%	-11.35%	0.89%	2.34%	0.00%
过去三年	-18.75%	0.99%	-30.91%	0.99%	12.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.47%	1.10%	-12.30%	1.13%	36.77%	-0.03%

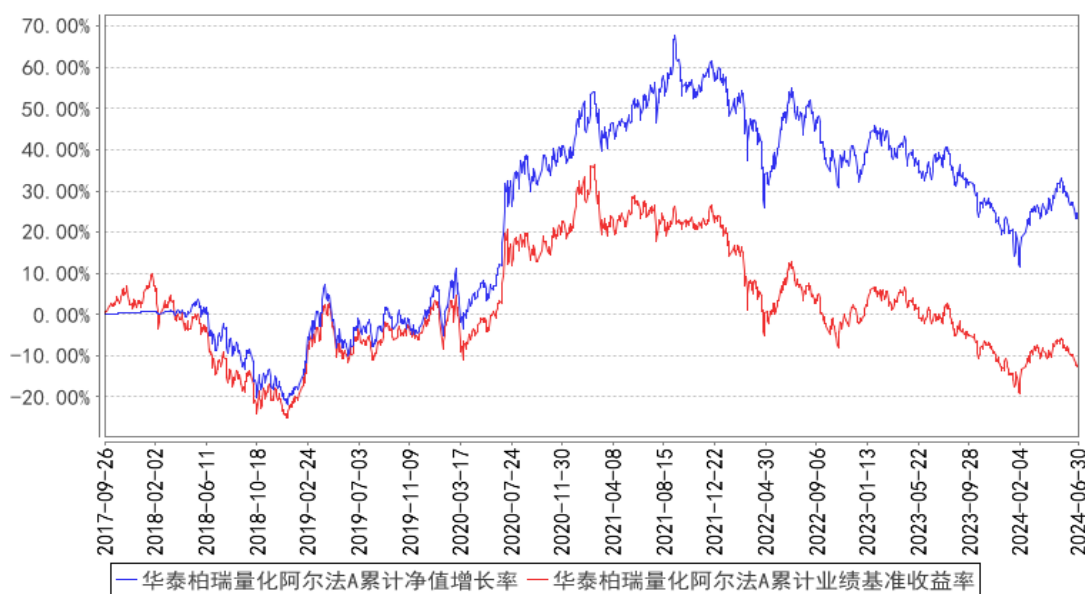
华泰柏瑞量化阿尔法 C

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
过去一个月	-3.56%	0.74%	-4.02%	0.54%	0.46%	0.20%

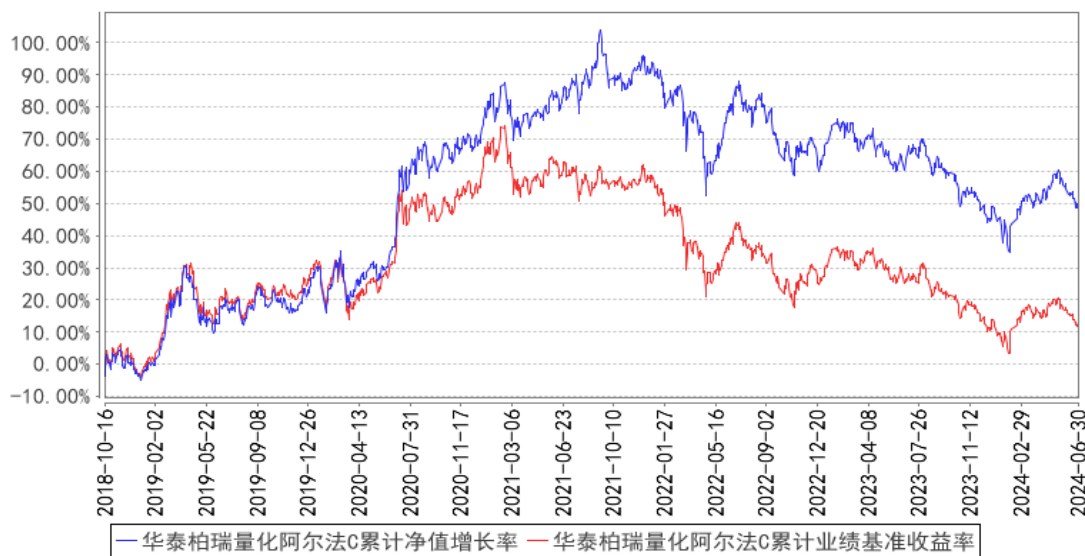
过去三个月	-0.59%	0.85%	-3.09%	0.79%	2.50%	0.06%
过去六个月	0.54%	1.02%	-1.64%	0.98%	2.18%	0.04%
过去一年	-9.24%	0.89%	-11.35%	0.89%	2.11%	0.00%
过去三年	-19.36%	0.99%	-30.91%	0.99%	11.55%	0.00%
自基金合同生效起至今	50.04%	1.14%	12.16%	1.14%	37.88%	0.00%

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

华泰柏瑞量化阿尔法A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞量化阿尔法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2017年9月26日至2024年6月30日。C类图示日期为2018年10月16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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2017 年 9 月 26 日	-	22 年	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2021 年 11 月任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配

					置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。
盛豪	量化与海外投资部总监、本基金的基金经理	2017 年 9 月 26 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 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。
--	--	--	--	--	---

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相关企业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

截至本报告期末华泰柏瑞量化阿尔法 A 的基金份额净值为 1.2447 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.67%，同期业绩比较基准收益率为-1.64%，截至本报告期末华泰柏瑞量化阿尔法 C 的基金份额净值为 1.2441 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准收益率为-1.64%。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 28,842,846.66 元。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：华泰柏瑞量化阿尔法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	9,972,408.54	9,048,380.63
结算备付金		297,012.50	210,632.03
存出保证金		16,768.02	39,398.39
交易性金融资产	6.4.7.2	137,116,543.16	145,623,063.96
其中：股票投资		137,116,543.16	145,513,056.73
基金投资		-	-
债券投资		-	110,007.23
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		-	5,347.99
应收股利		-	-

应收申购款		28,060.09	12,327.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		147,430,792.31	154,939,150.86
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		-	-
应付赎回款		279,010.42	31,943.79
应付管理人报酬		147,289.65	156,722.57
应付托管费		24,548.26	26,120.42
应付销售服务费		259.29	300.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	258,390.12	269,864.07
负债合计		709,497.74	484,951.71
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	117,878,447.91	124,917,558.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	28,842,846.66	29,536,641.15
净资产合计		146,721,294.57	154,454,199.15
负债和净资产总计		147,430,792.31	154,939,150.86

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额为 117,878,447.91 份，其中华泰柏瑞量化阿尔法 A 类基金份额净值 1.2447 元，基金份额 116,877,880.85 份；华泰柏瑞量化阿尔法 C 类基金份额净值 1.2441 元，基金份额 1,000,567.06 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化阿尔法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		2,048,991.52	5,333,989.47
1. 利息收入		18,573.89	36,697.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,573.89	36,697.62

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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,664,303.15	1,369,267.22
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,720,748.20	-1,826,397.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	15,796.18	4,115.22
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,040,648.87	3,191,549.09
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	11,694,192.63	3,784,567.41
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	528.15	143,457.22
减：二、营业总支出		1,147,203.06	2,293,519.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	897,605.49	1,874,859.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	149,600.90	312,476.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,539.51	5,868.49
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		0.05	-
8. 其他费用	6.4.7.23	98,457.11	100,314.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		901,788.46	3,040,470.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		901,788.46	3,040,470.30
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		901,788.46	3,040,470.30

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞量化阿尔法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	124,917,558.00	-	29,536,641.15	154,454,199.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	124,917,558.00	-	29,536,641.15	154,454,199.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,039,110.09	-	-693,794.49	-7,732,904.58
(一)、综合收益总额	-	-	901,788.46	901,788.46
(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)	-7,039,110.09	-	-1,595,582.95	-8,634,693.04
其中：1. 基金申购款	640,567.39	-	150,826.75	791,394.14
2. 基金赎回款	-7,679,677.48	-	-1,746,409.70	-9,426,087.18
(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	117,878,447.91	-	28,842,846.66	146,721,294.57

资产				
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	157,672,187.38	-	54,407,350.55	212,079,537.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	157,672,187.38	-	54,407,350.55	212,079,537.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-19,076,005.84	-	-3,412,858.10	-22,488,863.94
(一)、综合收益总额	-	-	3,040,470.30	3,040,470.30
(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)	-19,076,005.84	-	-6,453,328.40	-25,529,334.24
其中：1. 基金申购款	35,164,858.00	-	12,618,350.88	47,783,208.88
2. 基金赎回款	-54,240,863.84	-	-19,071,679.28	-73,312,543.12
(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	138,596,181.54	-	50,994,492.45	189,590,673.99

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：

韩勇

房伟力

赵景云

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

华泰柏瑞量化阿尔法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[2017]1197号《关于准予华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华泰柏瑞量化阿尔法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5,153,838,894.45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(2017)第811号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,155,449,845.39份基金份额,其中认购资金利息折合1,610,950.94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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2018年10月15日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同的公告》,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,本基金自2018年10月16日起增加C类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者申购基金份额时不收取申购费用,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代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化阿尔法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、企业债、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、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债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)。本基金将根据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 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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 08 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》、《华泰柏瑞量化阿尔法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 01 月 01 日至 2024 年 06 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 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产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	9,972,408.54
等于：本金	9,971,456.40
加：应计利息	952.14
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	9,972,408.54

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	139,407,808.26	-	137,116,543.16	-2,291,265.10
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	139,407,808.26	-	137,116,543.16	-2,291,265.10

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投资。

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投资。

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	22.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	171,346.04
其中：交易所市场	171,346.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,021.48
合计	258,390.12

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化阿尔法 A

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	123,773,154.61	123,773,154.61
本期申购	492,803.06	492,803.06
本期赎回（以“-”号填列）	-7,388,076.82	-7,388,076.82
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	116,877,880.85	116,877,880.85

华泰柏瑞量化阿尔法 C

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	1,144,403.39	1,144,403.39
本期申购	147,764.33	147,764.33
本期赎回（以“-”号填列）	-291,600.66	-291,600.66
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	1,000,567.06	1,000,567.06

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

华泰柏瑞量化阿尔法 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	68,335,848.46	-39,070,897.15	29,264,951.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	68,335,848.46	-39,070,897.15	29,264,951.31
本期利润	-10,700,495.46	11,611,603.75	911,108.29
本期基金份额交易产生的变动数	-3,297,160.05	1,719,694.57	-1,577,465.48
其中：基金申购款	235,825.56	-124,506.66	111,318.90
基金赎回款	-3,532,985.61	1,844,201.23	-1,688,784.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,338,192.95	-25,739,598.83	28,598,594.12

华泰柏瑞量化阿尔法 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	495,286.34	-223,596.50	271,689.84
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	495,286.34	-223,596.50	271,689.84
本期利润	-91,908.71	82,588.88	-9,319.83
本期基金份额交易产生的变动数	-59,206.76	41,089.29	-18,117.47
其中：基金申购款	49,746.15	-10,238.30	39,507.85
基金赎回款	-108,952.91	51,327.59	-57,625.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	344,170.87	-99,918.33	244,252.54

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	16,158.00
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	2,267.64
其他	148.25
合计	18,573.89

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	-11,720,748.20
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	-11,720,748.20

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	173,498,083.16
减：卖出股票成本总额	184,792,368.50
减：交易费用	426,462.86
买卖股票差价收入	-11,720,748.20

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	12.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,783.52
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	15,796.18

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	125,808.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	110,000.00
减：应计利息总额	20.25

减：交易费用	5.04
买卖债券差价收入	15,783.52

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

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	2,040,648.87
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	2,040,648.87

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	11,694,192.63
股票投资	11,694,192.63
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	11,694,192.63

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	514.13
基金转换费收入	14.02
合计	528.15

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	27,349.14
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	2,435.63
合计	98,457.11

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

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	-	-	87,330,889.28	14.37

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 (%)
-	-	-	-	-
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 (%)
华泰证券	80,457.82	14.56	17,170.65	9.33

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（截止 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	897,605.49	1,874,859.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	366,502.71	594,149.53
应支付基金管理人的净管理费	531,102.78	1,280,709.73

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	149,600.90	312,476.56

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

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

6.4.10.2.3 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C	合计

合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	3,144.71	3,144.71
合计	0.00	3,144.71	3,144.71

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 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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。

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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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
中国银行	9,972,408.54	16,158.00	12,369,257.26	32,636.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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	603312	西典新能	网下申购	557	16,164.14
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	2,751	43,163.19
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	858	22,308.00
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	301408	华人健康	网下申购	5,856	95,101.44
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	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
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	688478	晶升股份	网下申购	2,728	88,714.56
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	30,013	170,773.97
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	4,109	85,960.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	9,946	110,400.60
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	1,723	73,141.35
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	2,481	47,635.20
华泰联合证券	601916	浙商银行	网上配股	265,560	536,431.20

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
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	28.01	37.83	119	3,333.19	4,501.77	-
601033	永兴股份	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	16.20	15.96	211	3,418.20	3,367.56	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	21.28	29.49	68	1,447.04	2,005.32	-
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	761	14,192.65	14,192.65	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	29.02	25.36	56	1,625.12	1,420.16	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	72.46	68.06	24	1,739.04	1,633.44	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	26.00	37.49	86	2,236.00	3,224.14	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.18	22.66	87	1,668.66	1,971.42	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	797	16,386.32	16,386.32	-
603375	盛景	2024 年 1 月	6 个月	新股锁定	38.18	38.90	42	1,603.56	1,633.80	-

	微	17 日		期内						
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	23.35	25.13	66	1,541.10	1,658.58	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	22.66	15.89	221	5,007.86	3,511.69	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	42.51	173	3,435.78	7,354.23	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	86.96	174.93	56	4,869.76	9,796.08	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	22.43	31.55	152	3,409.36	4,795.60	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.69	18.79	276	4,330.44	5,186.04	-

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等流通受限股票。

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：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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 0.07%)。

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	9,972,408.54	-	-	-	-	-	9,972,408.54
结算备付金	297,012.50	-	-	-	-	-	297,012.50
存出保证金	16,768.02	-	-	-	-	-	16,768.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-137,116,543.16	137,116,543.16
应收申购款	-	-	-	-	-	28,060.09	28,060.09
资产总计	10,286,189.06	-	-	-	-	-137,144,603.25	147,430,792.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	279,010.42	279,010.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	147,289.65	147,289.65
应付托管费	-	-	-	-	-	24,548.26	24,548.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	259.29	259.29
其他负债	-	-	-	-	-	258,390.12	258,390.12
负债总计	-	-	-	-	-	709,497.74	709,497.74
利率敏感度缺口	10,286,189.06	-	-	-	-	-136,435,105.51	146,721,294.57
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	9,048,380.63	-	-	-	-	-	9,048,380.63
结算备付金	210,632.03	-	-	-	-	-	210,632.03
存出保证金	39,398.39	-	-	-	-	-	39,398.39
交易性金融资产	-	-	-	-110,007.23	-	-145,513,056.73	145,623,063.96
应收申购款	-	-	-	-	-	12,327.86	12,327.86
应收清算款	-	-	-	-	-	5,347.99	5,347.99
资产总计	9,298,411.05	-	-	-110,007.23	-	-145,530,732.58	154,939,150.86
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	31,943.79	31,943.79

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	156,722.57	156,722.57
应付托管费	-	-	-	-	-	26,120.42	26,120.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	300.64	300.64
应交税费	-	-	-	-	-	0.22	0.22
其他负债	-	-	-	-	-	269,864.07	269,864.07
负债总计	-	-	-	-	-	484,951.71	484,951.71
利率敏感度缺口	9,298,411.05	-	-	-110,007.23	-	-145,045,780.87	154,454,199.15

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：0.07%)，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	137,116,543.16	93.45	145,513,056.73	94.21

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	137,116,543.16	93.45	145,513,056.73	94.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 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）
	中证 800 指数上升 5%	7,677,055.71	7,130,400.83
	中证 800 指数下降 5%	-7,677,055.71	-7,130,400.83

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	137,028,365.96	145,031,643.93
第二层次	30,578.97	110,007.23

第三层次	57,598.23	481,412.80
合计	137,116,543.16	145,623,063.96

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	137,116,543.16	93.00
	其中：股票	137,116,543.16	93.00
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	10,269,421.04	6.97

8	其他各项资产	44,828.11	0.03
9	合计	147,430,792.31	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	382,860.00	0.26
B	采矿业	8,858,224.00	6.04
C	制造业	78,398,754.72	53.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,480,726.66	4.42
E	建筑业	3,923,689.00	2.67
F	批发和零售业	2,092,535.00	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	4,223,126.70	2.88
H	住宿和餐饮业	710,082.00	0.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,065,952.91	4.13
J	金融业	21,604,999.61	14.73
K	房地产业	1,188,697.00	0.81
L	租赁和商务服务业	2,217,677.00	1.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	921,841.56	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	47,377.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	137,116,543.16	93.45

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	601318	中国平安	54,800	2,266,528.00	1.54
2	000651	格力电器	50,200	1,968,844.00	1.34
3	601601	中国太保	62,600	1,744,036.00	1.19
4	601717	郑煤机	115,500	1,709,400.00	1.17
5	000568	泸州老窖	11,900	1,707,531.00	1.16
6	601668	中国建筑	313,700	1,665,747.00	1.14

7	600000	浦发银行	194,400	1,599,912.00	1.09
8	601336	新华保险	51,467	1,545,554.01	1.05
9	600312	平高电气	79,100	1,538,495.00	1.05
10	601169	北京银行	262,500	1,533,000.00	1.04
11	688798	艾为电子	26,000	1,472,120.00	1.00
12	601001	晋控煤业	85,600	1,414,112.00	0.96
13	600489	中金黄金	94,500	1,398,600.00	0.95
14	600919	江苏银行	177,600	1,319,568.00	0.90
15	000858	五粮液	10,100	1,293,204.00	0.88
16	300628	亿联网络	34,900	1,283,273.00	0.87
17	000338	潍柴动力	74,800	1,214,752.00	0.83
18	600519	贵州茅台	800	1,173,912.00	0.80
19	601166	兴业银行	66,400	1,169,968.00	0.80
20	601186	中国铁建	135,000	1,156,950.00	0.79
21	601857	中国石油	111,200	1,147,584.00	0.78
22	601766	中国中车	147,800	1,109,978.00	0.76
23	600019	宝钢股份	166,700	1,108,555.00	0.76
24	601598	中国外运	191,000	1,075,330.00	0.73
25	002583	海能达	263,500	1,072,445.00	0.73
26	600057	厦门象屿	153,800	1,045,840.00	0.71
27	601577	长沙银行	127,600	1,043,768.00	0.71
28	600050	中国联通	220,800	1,037,760.00	0.71
29	601919	中远海控	65,830	1,019,706.70	0.69
30	601818	光大银行	318,900	1,010,913.00	0.69
31	000876	新希望	110,400	1,009,056.00	0.69
32	601319	中国人保	193,100	994,465.00	0.68
33	002955	鸿合科技	42,300	988,974.00	0.67
34	600655	豫园股份	190,300	980,045.00	0.67
35	600066	宇通客车	37,500	967,500.00	0.66
36	600926	杭州银行	73,700	961,785.00	0.66
37	600642	申能股份	108,900	961,587.00	0.66
38	601916	浙商银行	335,760	926,697.60	0.63
39	300433	蓝思科技	49,100	896,075.00	0.61
40	688253	英诺特	23,500	895,585.00	0.61
41	688766	普冉股份	9,100	884,247.00	0.60
42	601058	赛轮轮胎	62,800	879,200.00	0.60
43	600023	浙能电力	122,000	867,420.00	0.59
44	002497	雅化集团	96,800	863,456.00	0.59
45	688486	龙迅股份	14,980	858,354.00	0.59
46	600741	华域汽车	51,200	838,656.00	0.57
47	000423	东阿阿胶	13,100	820,060.00	0.56
48	300529	健帆生物	29,600	805,416.00	0.55
49	688123	聚辰股份	13,200	802,956.00	0.55

50	002475	立讯精密	20,400	801,924.00	0.55
51	601998	中信银行	119,300	799,310.00	0.54
52	600346	恒力石化	57,000	795,150.00	0.54
53	601665	齐鲁银行	161,800	794,438.00	0.54
54	601156	东航物流	38,900	791,615.00	0.54
55	600886	国投电力	43,200	787,968.00	0.54
56	300772	运达股份	81,800	785,280.00	0.54
57	601229	上海银行	106,000	769,560.00	0.52
58	601233	桐昆股份	47,800	762,888.00	0.52
59	300866	安克创新	10,540	750,553.40	0.51
60	000932	华菱钢铁	166,800	738,924.00	0.50
61	002025	航天电器	15,863	735,725.94	0.50
62	601137	博威合金	47,600	725,424.00	0.49
63	603605	珀莱雅	6,520	723,654.80	0.49
64	002410	广联达	75,400	722,332.00	0.49
65	000596	古井贡酒	3,400	717,638.00	0.49
66	600150	中国船舶	17,600	716,496.00	0.49
67	603258	电魂网络	44,300	715,445.00	0.49
68	300638	广和通	41,600	711,360.00	0.48
69	600754	锦江酒店	30,900	710,082.00	0.48
70	300896	爱美客	4,060	698,726.00	0.48
71	002100	天康生物	100,400	695,772.00	0.47
72	600372	中航机载	58,100	695,457.00	0.47
73	000690	宝新能源	136,100	694,110.00	0.47
74	000528	柳工	62,000	693,780.00	0.47
75	601138	工业富联	25,300	693,220.00	0.47
76	688213	思特威	14,200	688,700.00	0.47
77	002557	洽洽食品	23,900	673,741.00	0.46
78	688697	纽威数控	42,700	669,963.00	0.46
79	688095	福昕软件	14,400	659,664.00	0.45
80	688036	传音控股	8,520	652,120.80	0.44
81	002465	海格通信	62,300	645,428.00	0.44
82	000600	建投能源	101,600	640,080.00	0.44
83	601127	赛力斯	7,000	637,840.00	0.43
84	000661	长春高新	6,900	633,213.00	0.43
85	300750	宁德时代	3,500	630,105.00	0.43
86	600900	长江电力	21,600	624,672.00	0.43
87	600901	江苏金租	123,000	621,150.00	0.42
88	688187	时代电气	12,400	612,312.00	0.42
89	603160	汇顶科技	8,900	611,875.00	0.42
90	000951	中国重汽	42,400	607,168.00	0.41
91	000933	神火股份	29,500	596,785.00	0.41
92	601390	中国中铁	91,100	593,972.00	0.40

93	002152	广电运通	56,600	592,036.00	0.40
94	600011	华能国际	61,000	586,820.00	0.40
95	603198	迎驾贡酒	10,200	586,500.00	0.40
96	600966	博汇纸业	122,100	583,638.00	0.40
97	601888	中国中免	9,300	581,157.00	0.40
98	601101	昊华能源	62,300	572,537.00	0.39
99	002068	黑猫股份	79,800	566,580.00	0.39
100	600096	云天化	29,000	563,180.00	0.38
101	688506	百利天恒	3,100	562,340.00	0.38
102	600562	国睿科技	40,900	558,694.00	0.38
103	600862	中航高科	29,500	554,010.00	0.38
104	603727	博迈科	41,600	547,456.00	0.37
105	603568	伟明环保	26,600	547,428.00	0.37
106	000725	京东方 A	130,200	532,518.00	0.36
107	600028	中国石化	83,800	529,616.00	0.36
108	600765	中航重机	25,960	529,584.00	0.36
109	600362	江西铜业	22,300	528,064.00	0.36
110	300769	德方纳米	18,700	527,340.00	0.36
111	601600	中国铝业	68,600	523,418.00	0.36
112	300841	康华生物	10,200	516,528.00	0.35
113	002008	大族激光	24,400	507,520.00	0.35
114	600048	保利发展	57,900	507,204.00	0.35
115	688772	珠海冠宇	33,800	503,620.00	0.34
116	601898	中煤能源	40,000	499,200.00	0.34
117	002468	申通快递	58,000	487,200.00	0.33
118	003012	东鹏控股	79,600	486,356.00	0.33
119	000975	山金国际	29,700	483,813.00	0.33
120	603225	新凤鸣	30,700	478,613.00	0.33
121	300394	天孚通信	5,400	477,468.00	0.33
122	600566	济川药业	14,800	469,308.00	0.32
123	600029	南方航空	75,000	441,750.00	0.30
124	300783	三只松鼠	19,900	435,213.00	0.30
125	601658	邮储银行	82,800	419,796.00	0.29
126	601155	新城控股	47,300	419,551.00	0.29
127	002171	楚江新材	63,000	415,170.00	0.28
128	002035	华帝股份	66,500	414,295.00	0.28
129	603313	梦百合	55,300	413,091.00	0.28
130	688252	天德钰	28,400	412,652.00	0.28
131	603583	捷昌驱动	20,100	409,638.00	0.28
132	300502	新易盛	3,800	401,090.00	0.27
133	300054	鼎龙股份	17,600	399,168.00	0.27
134	000001	平安银行	39,100	396,865.00	0.27
135	603650	彤程新材	13,400	395,970.00	0.27

136	601398	工商银行	69,200	394,440.00	0.27
137	600582	天地科技	56,800	391,352.00	0.27
138	002304	洋河股份	4,800	387,552.00	0.26
139	601666	平煤股份	34,300	384,160.00	0.26
140	600502	安徽建工	88,700	381,410.00	0.26
141	600409	三友化工	74,900	375,998.00	0.26
142	000786	北新建材	12,600	373,716.00	0.25
143	600475	华光环能	42,600	371,046.00	0.25
144	600755	厦门国贸	50,000	358,500.00	0.24
145	600809	山西汾酒	1,700	358,496.00	0.24
146	300457	赢合科技	20,000	356,600.00	0.24
147	300724	捷佳伟创	6,400	345,664.00	0.24
148	688016	心脉医疗	3,427	336,017.35	0.23
149	603368	柳药集团	19,200	336,000.00	0.23
150	002948	青岛银行	99,500	335,315.00	0.23
151	688276	百克生物	11,800	334,766.00	0.23
152	000830	鲁西化工	28,600	331,474.00	0.23
153	601369	陕鼓动力	40,700	326,414.00	0.22
154	688608	恒玄科技	2,200	322,036.00	0.22
155	688578	艾力斯	5,000	318,700.00	0.22
156	688516	奥特维	7,420	310,230.20	0.21
157	002608	江苏国信	40,000	310,000.00	0.21
158	000049	德赛电池	13,200	309,540.00	0.21
159	002648	卫星化学	17,100	307,458.00	0.21
160	002237	恒邦股份	26,600	306,166.00	0.21
161	603517	绝味食品	19,700	303,380.00	0.21
162	000333	美的集团	4,700	303,150.00	0.21
163	300973	立高食品	10,600	297,754.00	0.20
164	002415	海康威视	9,600	296,736.00	0.20
165	603808	歌力思	46,100	291,813.00	0.20
166	603338	浙江鼎力	4,800	290,016.00	0.20
167	601607	上海医药	14,700	280,917.00	0.19
168	300972	万辰集团	13,200	278,916.00	0.19
169	601991	大唐发电	92,300	277,823.00	0.19
170	603609	禾丰股份	41,900	274,026.00	0.19
171	000059	华锦股份	64,700	271,093.00	0.18
172	688188	柏楚电子	1,460	269,443.00	0.18
173	601619	嘉泽新能	87,900	266,337.00	0.18
174	301207	华兰疫苗	15,000	265,050.00	0.18
175	000550	江铃汽车	12,100	262,691.00	0.18
176	001979	招商蛇口	29,800	261,942.00	0.18
177	600027	华电国际	37,700	261,638.00	0.18
178	002807	江阴银行	68,500	258,245.00	0.18

179	601615	明阳智能	27,200	256,768.00	0.18
180	603348	文灿股份	9,200	254,748.00	0.17
181	000589	贵州轮胎	50,200	254,514.00	0.17
182	000157	中联重科	33,100	254,208.00	0.17
183	002469	三维化学	42,900	244,530.00	0.17
184	603688	石英股份	8,250	244,282.50	0.17
185	600328	中盐化工	35,200	241,472.00	0.16
186	600985	淮北矿业	14,200	237,708.00	0.16
187	300083	创世纪	38,200	234,166.00	0.16
188	600153	建发股份	26,000	232,180.00	0.16
189	603833	欧派家居	4,200	224,952.00	0.15
190	601211	国泰君安	16,600	224,930.00	0.15
191	002384	东山精密	10,800	223,560.00	0.15
192	603112	华翔股份	21,100	221,761.00	0.15
193	000807	云铝股份	16,200	218,862.00	0.15
194	603501	韦尔股份	2,200	218,614.00	0.15
195	002746	仙坛股份	37,500	214,875.00	0.15
196	688153	唯捷创芯	5,800	214,600.00	0.15
197	000915	华特达因	7,100	214,136.00	0.15
198	002928	华夏航空	33,700	213,658.00	0.15
199	601328	交通银行	28,600	213,642.00	0.15
200	688080	映翰通	7,000	212,310.00	0.14
201	000630	铜陵有色	58,600	211,546.00	0.14
202	601966	玲珑轮胎	11,400	209,418.00	0.14
203	300115	长盈精密	17,400	208,626.00	0.14
204	600737	中粮糖业	21,500	206,185.00	0.14
205	688239	航宇科技	5,900	205,320.00	0.14
206	002351	漫步者	15,600	205,140.00	0.14
207	603369	今世缘	4,400	203,280.00	0.14
208	600547	山东黄金	7,400	202,612.00	0.14
209	002756	永兴材料	5,600	200,368.00	0.14
210	002273	水晶光电	11,800	200,364.00	0.14
211	300389	艾比森	16,300	200,164.00	0.14
212	605555	德昌股份	10,700	199,127.00	0.14
213	002396	星网锐捷	15,000	198,150.00	0.14
214	300682	朗新集团	21,300	181,263.00	0.12
215	300005	探路者	35,800	179,358.00	0.12
216	603345	安井食品	2,400	178,344.00	0.12
217	688278	特宝生物	3,300	176,715.00	0.12
218	601633	长城汽车	6,900	174,570.00	0.12
219	601566	九牧王	19,300	162,506.00	0.11
220	000425	徐工机械	22,600	161,590.00	0.11
221	300161	华中数控	7,100	159,679.00	0.11

222	002600	领益智造	21,100	150,232.00	0.10
223	688236	春立医疗	10,100	143,218.00	0.10
224	601899	紫金矿业	8,000	140,560.00	0.10
225	600483	福能股份	11,801	137,599.66	0.09
226	002984	森麒麟	5,700	137,313.00	0.09
227	600988	赤峰黄金	8,200	133,988.00	0.09
228	002947	恒铭达	3,700	130,240.00	0.09
229	601728	中国电信	20,400	125,460.00	0.09
230	002558	巨人网络	13,200	124,608.00	0.08
231	603323	苏农银行	25,800	124,098.00	0.08
232	300718	长盛轴承	8,900	122,998.00	0.08
233	600557	康缘药业	7,800	122,460.00	0.08
234	688019	安集科技	960	120,768.00	0.08
235	600271	航天信息	15,700	115,552.00	0.08
236	000521	长虹美菱	14,600	110,668.00	0.08
237	688020	方邦股份	3,300	110,088.00	0.08
238	600938	中国海油	3,300	108,900.00	0.07
239	002567	唐人神	20,100	107,736.00	0.07
240	600875	东方电气	5,690	104,980.50	0.07
241	000063	中兴通讯	3,700	103,489.00	0.07
242	601009	南京银行	9,900	102,861.00	0.07
243	301150	中一科技	5,700	102,429.00	0.07
244	605333	沪光股份	3,500	97,475.00	0.07
245	605166	聚合顺	9,200	96,508.00	0.07
246	002409	雅克科技	1,500	94,365.00	0.06
247	300580	贝斯特	6,375	93,712.50	0.06
248	601872	招商轮船	10,500	88,725.00	0.06
249	000998	隆平高科	8,800	86,504.00	0.06
250	002048	宁波华翔	6,200	80,228.00	0.05
251	002422	科伦药业	2,400	72,792.00	0.05
252	600350	山东高速	8,000	70,800.00	0.05
253	601800	中国交建	7,800	69,732.00	0.05
254	000983	山西焦煤	6,700	69,077.00	0.05
255	000921	海信家电	2,100	67,704.00	0.05
256	688599	天合光能	4,000	67,680.00	0.05
257	000039	中集集团	7,200	66,672.00	0.05
258	000598	兴蓉环境	8,600	64,672.00	0.04
259	002371	北方华创	200	63,978.00	0.04
260	002727	一心堂	4,000	60,360.00	0.04
261	300559	佳发教育	6,200	59,334.00	0.04
262	601865	福莱特	2,800	56,280.00	0.04
263	300035	中科电气	6,600	56,166.00	0.04
264	000090	天健集团	13,900	55,878.00	0.04

265	688208	道通科技	2,250	54,315.00	0.04
266	600583	海油工程	8,400	49,644.00	0.03
267	300286	安科瑞	2,200	47,608.00	0.03
268	300144	宋城演艺	5,900	47,377.00	0.03
269	002315	焦点科技	1,700	45,832.00	0.03
270	688525	佰维存储	700	44,905.00	0.03
271	000603	盛达资源	3,300	39,039.00	0.03
272	600872	中炬高新	1,600	36,304.00	0.02
273	000923	河钢资源	2,100	36,162.00	0.02
274	600585	海螺水泥	1,500	35,385.00	0.02
275	600026	中远海能	2,200	34,342.00	0.02
276	601628	中国人寿	1,100	34,155.00	0.02
277	600104	上汽集团	2,200	30,492.00	0.02
278	688232	新点软件	1,400	27,608.00	0.02
279	002064	华峰化学	3,000	21,510.00	0.01
280	002714	牧原股份	400	17,440.00	0.01
281	603350	安乃达	797	16,386.32	0.01
282	603285	键邦股份	761	14,192.65	0.01
283	688692	达梦数据	56	9,796.08	0.01
284	688691	灿芯股份	173	7,354.23	0.01
285	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
286	688709	成都华微	276	5,186.04	0.00
287	688695	中创股份	152	4,795.60	0.00
288	301502	华阳智能	119	4,501.77	0.00
289	688584	上海合晶	221	3,511.69	0.00
290	601033	永兴股份	211	3,367.56	0.00
291	603341	龙旗科技	86	3,224.14	0.00
292	603082	北自科技	68	2,005.32	0.00
293	603344	星德胜	87	1,971.42	0.00
294	603381	永臻股份	66	1,658.58	0.00
295	603375	盛景微	42	1,633.80	0.00
296	603325	博隆技术	24	1,633.44	0.00
297	603312	西典新能	56	1,420.16	0.00

注：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	300750	宁德时代	4,113,766.00	2.66
2	600919	江苏银行	2,511,081.00	1.63
3	688213	思特威	1,612,579.65	1.04

4	002475	立讯精密	1,606,722.00	1.04
5	600000	浦发银行	1,565,153.00	1.01
6	000001	平安银行	1,493,679.00	0.97
7	688798	艾为电子	1,447,667.86	0.94
8	002955	鸿合科技	1,409,429.00	0.91
9	601288	农业银行	1,385,726.00	0.90
10	601336	新华保险	1,365,658.00	0.88
11	300718	长盛轴承	1,354,282.00	0.88
12	601001	晋控煤业	1,344,661.50	0.87
13	002466	天齐锂业	1,339,357.00	0.87
14	601598	中国外运	1,268,196.00	0.82
15	688095	福昕软件	1,260,261.23	0.82
16	002415	海康威视	1,207,320.00	0.78
17	000423	东阿阿胶	1,159,552.00	0.75
18	300628	亿联网络	1,130,816.00	0.73
19	600655	豫园股份	1,126,322.00	0.73
20	600562	国睿科技	1,110,130.00	0.72

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	5,343,177.00	3.46
2	300750	宁德时代	3,346,261.20	2.17
3	600066	宇通客车	1,761,695.00	1.14
4	601211	国泰君安	1,711,816.00	1.11
5	601838	成都银行	1,629,377.00	1.05
6	300760	迈瑞医疗	1,621,303.00	1.05
7	000521	长虹美菱	1,615,888.00	1.05
8	000100	TCL 科技	1,614,457.00	1.05
9	601288	农业银行	1,598,614.00	1.04
10	688036	传音控股	1,571,857.27	1.02
11	601108	财通证券	1,567,623.00	1.01
12	600900	长江电力	1,516,035.00	0.98
13	000001	平安银行	1,482,948.00	0.96
14	600061	国投资本	1,421,943.92	0.92
15	600309	万华化学	1,406,228.00	0.91
16	002179	中航光电	1,403,130.20	0.91
17	300015	爱尔眼科	1,396,830.00	0.90
18	300693	盛弘股份	1,321,375.27	0.86
19	002466	天齐锂业	1,309,650.00	0.85
20	600919	江苏银行	1,300,285.00	0.84

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	164,701,662.30
卖出股票收入（成交）总额	173,498,083.16

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，郑煤机（601717）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

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

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

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	16,768.02
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,060.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,828.11

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

份额级别	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 (%)
华泰柏瑞量化阿尔法 A	3,668	31,864.20	0.00	0.00	116,877,880.85	100.00
华泰柏瑞量化阿尔	561	1,783.54	0.00	0.00	1,000,567.06	100.00

法 C						
合计	4,202	28,052.94	0.00	0.00	117,878,447.91	100.00

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）。

8.2 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	华泰柏瑞量化阿尔法 A	835,368.31	0.7147
	华泰柏瑞量化阿尔法 C	0.00	0.0000
	合计	835,368.31	0.7087

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	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	华泰柏瑞量化阿尔法 A	0
	华泰柏瑞量化阿尔法 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化阿尔法 A	50~100
	华泰柏瑞量化阿尔法 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C
基金合同生效日 (2017年9月26日) 基金份额总额	5,155,449,845.39	-
本报告期期初基金份额总额	123,773,154.61	1,144,403.39
本报告期基金总申购份额	492,803.06	147,764.33
减：本报告期基金总赎回份额	7,388,076.82	291,600.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	116,877,880.85	1,000,567.06

§ 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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
方正证券	2	67,422,550.27	19.96	63,777.30	20.05	-
申万宏源	2	42,089,003.08	12.46	39,392.10	12.39	-
国泰君安	1	40,396,536.38	11.96	38,212.50	12.01	-
中信证券	5	36,809,906.27	10.90	34,451.02	10.83	-
海通证券	2	34,933,509.83	10.34	32,895.02	10.34	-
华鑫证券	1	19,985,631.90	5.92	18,704.05	5.88	-
国联证券	1	17,089,646.59	5.06	15,994.58	5.03	-
东北证券	3	16,176,054.69	4.79	15,302.27	4.81	-
国信证券	1	15,663,226.57	4.64	14,815.53	4.66	-
中金公司	2	10,898,814.01	3.23	10,200.00	3.21	-
华安证券	2	9,735,547.87	2.88	9,210.41	2.90	-
财通证券	2	9,164,445.69	2.71	8,668.57	2.73	-
国海证券	1	8,741,841.44	2.59	8,268.76	2.60	-
国金证券	1	3,782,780.08	1.12	3,578.46	1.13	-
中银国际	3	2,706,925.46	0.80	2,559.63	0.80	-
国元证券	1	2,107,982.98	0.62	1,993.99	0.63	-
广发证券	5	29,237.95	0.01	26.73	0.01	-
东方证券	3	7,725.53	0.00	7.23	0.00	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

华福证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	5	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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	成交金额	占当期债券 回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
中信证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	125,808.81	100.00	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
北京高 华	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
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 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

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。

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