

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞量化增强混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

本基金于 2020 年 9 月 28 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 9 月 28 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61

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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化增强混合	
基金主代码	000172	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 8 月 2 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	955,170,832.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
下属分级基金的交易代码	000172	010234
报告期末下属分级基金的份额总额	925,506,423.57 份	29,664,409.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型混合投资基金，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8% 以内。
投资策略	本基金利用量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。 1、比较基准的标的指数：本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数 2、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略：本基金利用定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。 （1）多因子 alpha 模型——股票超额回报预测（2）风险估测模型——有效控制预期风险（3）交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩（4）投资组合的优化（5）投资组合的调整 3、存托凭证投资策略 4、债券投资策略 5、金融衍生工具投资策略 6、融资融券和转融资转融券
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+2.5% (指年收益率,评价时按期间折算)
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 负责人	姓名	刘万方	许俊
	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	证券时报
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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
和指标	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
本期已实现收益	-21,308,497.40	-184,673.48
本期利润	9,245,325.15	7,588,520.31
加权平均基金份 额本期利润	0.0085	0.0807
本期加权平均净 值利润率	0.59%	5.62%
本期基金份额净 值增长率	0.93%	0.44%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

和指标		
期末可供分配利润	379,481,852.69	11,268,104.78
期末可供分配基金份额利润	0.4100	0.3799
期末基金资产净值	1,304,988,276.26	40,932,514.09
期末基金份额净值	1.410	1.380
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	198.46%	-9.51%

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。

4、本基金于 2020 年 9 月 28 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 9 月 28 日开始计算。

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

华泰柏瑞量化增强混合 A

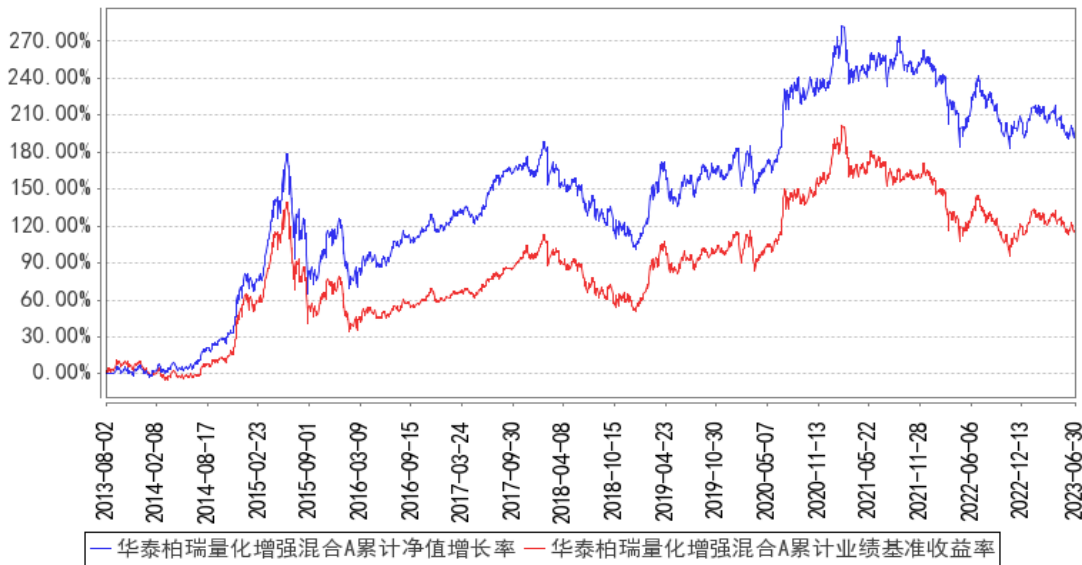
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.25%	0.80%	1.31%	0.83%	0.94%	-0.03%
过去三个月	-3.89%	0.75%	-4.28%	0.79%	0.39%	-0.04%
过去六个月	0.93%	0.75%	0.56%	0.80%	0.37%	-0.05%
过去一年	-11.76%	0.85%	-11.39%	0.94%	-0.37%	-0.09%
过去三年	3.62%	1.06%	0.22%	1.14%	3.40%	-0.08%
自基金合同生效起至今	198.46%	1.34%	116.63%	1.33%	81.83%	0.01%

华泰柏瑞量化增强混合 C

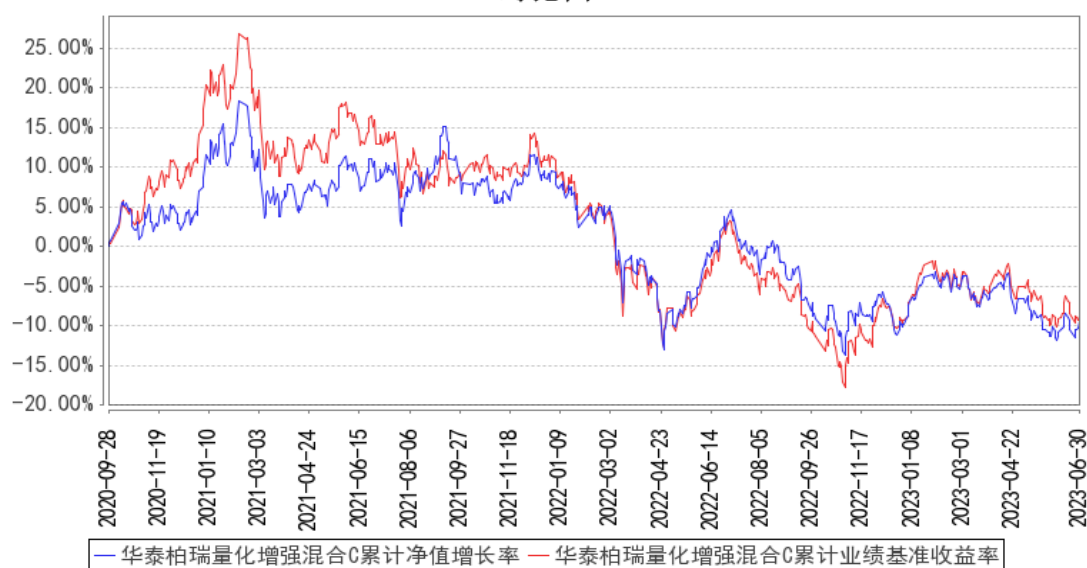
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.15%	0.80%	1.31%	0.83%	0.84%	-0.03%
过去三个月	-4.03%	0.75%	-4.28%	0.79%	0.25%	-0.04%
过去六个月	0.44%	0.75%	0.56%	0.80%	-0.12%	-0.05%
过去一年	-12.55%	0.85%	-11.39%	0.94%	-1.16%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-9.51%	1.00%	-8.85%	1.09%	-0.66%	-0.09%

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

华泰柏瑞量化增强混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞量化增强混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A类图示日期为2013年8月2日至2023年6月30日。C类图示日期为2020年9月28日至2023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%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型

开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50

成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起

式联接基金，华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金，华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金，华泰柏瑞致远混合型证券投资基金，华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 3,348.66 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐帅宇	本基金的基金经理	2022 年 8 月 5 日	-	6 年	美国密歇根大学量化金融与风险管理专业硕士。2017 年 4 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、基金经理助理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2013 年 8 月 2 日	-	21 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，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。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 5 次，其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 4 次为指数量化投资组合因投资策略需要而发

生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股市场整体表现较弱，各主要股票指数在经历年初的上涨后，呈现了震荡下跌的走势。市场热点从疫后消费复苏到 AI、中特估等主题板块的轮动，再转向超跌板块的修复和可能的政策博弈。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别下跌 5.43%和 0.75%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别下跌 5.61%、上涨 4.71%；中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别上涨 2.29%和 5.10%。横向比较来看，中小市值与主题板块相对较强，大市值与顺周期行业下跌较多。

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。

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增强混合 A 的基金份额净值为 1.410 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.93%，同期业绩比较基准收益率为 0.56%，截至本报告期末华泰柏瑞量化增强混合 C 的基金份额净值为 1.380 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.44%，同期业绩比较基准收益率为 0.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2023 年上半年，在经历了一季度经济快速修复之后，随着二季度，尤其是 5 月份国内经济数据开始走弱，市场逐渐从对经济复苏的强一致预期状态切换到对国内经济复苏进度、外部经济衰退风险、产业政策发展方向等问题的分歧状态。行情结构先是延续去年年底疫后消费修复，到主题驱动的结构性情短期见顶，再调整转向政策博弈。A 股市场当前的整体估值水平已经很有吸引力，市场已经基本反映了对经济的悲观预期，投资人情绪可能已经处在恢复过程中，在这种情况下，估值修复本身也可以推动市场的上行。在不出现极端情况的前提下，我们对 2023 年的股票市场持乐观态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格会更加有利于华泰柏瑞量化模型获取超额收益。从因子表现来看，华泰柏瑞量化模型的估值因子表现依然较好，且趋势向上，同时我们的成长因子预期会继续表现良好；政策面和消息面或许会带来短期扰动，市场主线仍会回归到股票的基本面上；未来大小市值、各行业股票的表现将更加均衡；量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。尽管市场在这些方面的回归可能还会有一定的反复，但大方向上是比较确定的。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理偏低，或是很不错的买入风格均衡的量化基金的机会。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用量化选股策略，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

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，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。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 390,749,957.47 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”）在华泰柏瑞量化增强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遵规守信、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：华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	79,098,703.91	106,691,887.25
结算备付金		10,530,023.61	2,271,916.62
存出保证金		322,840.36	235,330.74
交易性金融资产	6.4.7.2	1,260,149,883.24	1,680,207,488.99
其中：股票投资		1,260,149,883.24	1,680,207,488.99
基金投资		—	—
债券投资		—	—
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		3,937,061.37	142,107.15
应收股利		—	—
应收申购款		227,778.29	390,989.25
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		1,354,266,290.78	1,789,939,720.00
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		4,811,681.07	-
应付赎回款		494,934.13	291,110.33
应付管理人报酬		1,167,555.57	1,554,728.59
应付托管费		291,888.89	388,682.14
应付销售服务费		31,670.76	65,576.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,547,770.01	1,210,334.27
负债合计		8,345,500.43	3,510,432.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	955,170,832.88	1,280,157,954.37
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	390,749,957.47	506,271,333.63
净资产合计		1,345,920,790.35	1,786,429,288.00
负债和净资产总计		1,354,266,290.78	1,789,939,720.00

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 955,170,832.88 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.410 元，基金份额总额 925,506,423.57 份；下属 C 类基金份额净值 1.380 元，基金份额总额 29,664,409.31 份；无华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金 H 类基金份额。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		28,078,450.35	-30,216,216.80
1. 利息收入		279,352.25	1,021,065.44
其中：存款利息收入	6.4.7.13	279,352.25	975,832.37
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		-	45,233.07
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,051,951.47	-52,611,363.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-30,101,425.13	-67,947,254.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	294,706.08
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-288,322.89	-10,188,743.77
股利收益	6.4.7.19	19,337,796.55	25,229,928.61
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	38,327,016.34	20,166,948.73
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	524,033.23	1,207,132.99
减：二、营业总支出		11,244,604.89	12,479,722.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,462,710.73	9,293,006.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,115,677.66	2,323,251.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	535,817.06	725,675.48
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		325.24	-
8. 其他费用	6.4.7.23	130,074.20	137,789.31
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		16,833,845.46	-42,695,939.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		16,833,845.46	-42,695,939.72
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		16,833,845.46	-42,695,939.72

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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（基金净值）	1,280,157,954.37	-	506,271,333.63	1,786,429,288.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,280,157,954.37	-	506,271,333.63	1,786,429,288.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-324,987,121.49	-	-115,521,376.16	-440,508,497.65
（一）、综合收益总额	-	-	16,833,845.46	16,833,845.46
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-324,987,121.49	-	-132,355,221.62	-457,342,343.11
其中：1. 基金申购款	269,932,124.77	-	119,314,603.43	389,246,728.20
2. 基金赎回款	-594,919,246.26	-	-251,669,825.05	-846,589,071.31
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	955,170,832.88	-	390,749,957.47	1,345,920,790.35
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	741,099,892.24	-	508,057,608.48	1,249,157,500.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	741,099,892.24	-	508,057,608.48	1,249,157,500.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	302,648,493.09	-	114,939,092.10	417,587,585.19
（一）、综合收益总额	-	-	-42,695,939.72	-42,695,939.72
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	302,648,493.09	-	157,635,031.82	460,283,524.91
其中：1. 基金申购款	1,235,633,621.03	-	621,881,157.62	1,857,514,778.65
2. 基金赎回款	-932,985,127.94	-	-464,246,125.80	-1,397,231,253.74
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,043,748,385.33	-	622,996,700.58	1,666,745,085.91

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

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金(原名为华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金,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[2013]610号《关于核准华泰柏瑞量化指数增强股票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《华泰柏瑞量化指数增强股票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 333,108,260.81 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(2013)第 441 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 333,186,365.72 份基金份额,其中认购资金利息折合 78,104.91 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2020 年 9 月 23 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,本基金自 2020 年 9 月 28 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化增强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以及销售地区的不同,将基金份额分为 A 类、C 类和 H 类不同的类别。在中国内地销售的,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;在中国内地销售的,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;通过基金互认在香港地区销售的基金份额为 H 类份额。本基金 A 类、C 类和 H 类份额分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。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《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须

符合中国证监会相关规定)。本基金股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 60%；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率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+2.5% (指年收益率，评价时按期间折算)。

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 2023 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》、《华泰柏瑞量化增强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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	79,098,703.91
等于：本金	79,089,388.38
加：应计利息	9,315.53
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	79,098,703.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,319,838,225.80	—	1,260,149,883.24	-59,688,342.56
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	—	—	—	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		1,319,838,225.80	—	1,260,149,883.24	-59,688,342.56

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。

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	702.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,437,971.54
其中：交易所市场	1,437,971.54
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	1,547,770.01

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化增强混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,182,118,757.93	1,182,118,757.93
本期申购	186,613,269.08	186,613,269.08
本期赎回（以“-”号填列）	-443,225,603.44	-443,225,603.44
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	925,506,423.57	925,506,423.57

华泰柏瑞量化增强混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,039,196.44	98,039,196.44
本期申购	83,318,855.69	83,318,855.69
本期赎回（以“-”号填列）	-151,693,642.82	-151,693,642.82
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	29,664,409.31	29,664,409.31

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。上述基金份额为 A 类及 C 类基金份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未有其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞量化增强混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	600,913,403.80	-131,265,429.18	469,647,974.62
本期利润	-21,308,497.40	30,553,822.55	9,245,325.15
本期基金份额交易产生的变动数	-126,542,716.10	27,131,269.02	-99,411,447.08
其中：基金申购款	95,504,044.01	-8,893,813.31	86,610,230.70
基金赎回款	-222,046,760.11	36,025,082.33	-186,021,677.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	453,062,190.30	-73,580,337.61	379,481,852.69

华泰柏瑞量化增强混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	66,393,373.03	-29,770,014.02	36,623,359.01
本期利润	-184,673.48	7,773,193.79	7,588,520.31
本期基金份额交易产生的变动数	-46,858,763.07	13,914,988.53	-32,943,774.54
其中：基金申购款	56,305,240.44	-23,600,867.71	32,704,372.73
基金赎回款	-103,164,003.51	37,515,856.24	-65,648,147.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,349,936.48	-8,081,831.70	11,268,104.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	199,520.22
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	77,661.47
其他	2,170.56
合计	279,352.25

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,101,425.13
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	-30,101,425.13

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,020,125,124.94
减：卖出股票成本总额	2,045,107,640.36
减：交易费用	5,118,909.71
买卖股票差价收入	-30,101,425.13

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

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	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-288,322.89

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	19,337,796.55
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	19,337,796.55

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	38,327,016.34
股票投资	38,327,016.34
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	38,327,016.34

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	501,017.54
基金转换费收入	23,015.69
合计	524,033.23

注：1. 本基金 A 类份额和 C 类份额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；H 类份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

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，其中不低于转出本基金 A 类份额和 C 类份额的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产，转出本基金 H 类份额的赎回费全额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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
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	11,978.26
合计	130,074.20

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-	34,891,840.07	1.15

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	32,495.57	1.25	-	-

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。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,462,710.73	9,293,006.48
其中：支付销售机构的客户维护费	1,300,178.46	767,149.78

注：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 1.00%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,115,677.66	2,323,251.65

注：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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 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		
	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	21.46	21.46
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	448,255.09	448,255.09
合计	0.00	448,276.55	448,276.55
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		

名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	27.68	27.68
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	714,715.53	714,715.53
合计	0.00	714,743.21	714,743.21

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 0.8% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人于次月前 5 个工作日内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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
基金合同生效日（2013 年 8 月 2 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	993,006.99	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
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	993,006.99	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1040%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
基金合同生效日（2013 年 8 月 2 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	993,006.99	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
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	993,006.99	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0951%	0.0000%

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	79,098,703.91	199,520.22	105,060,227.42	361,475.70

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 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	8,784	142,652.16
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	4,013	130,502.76
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	60,168	667,864.80
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
中银国际证券	301397	溯联股份	网下申购	3,618	192,730.86
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	601916	浙商银行	网上配股	136,320	275,366.40
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合证券	688209	英集芯	网下申购	6,822	165,297.06
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：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（2023 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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定期内	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定期内	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股 锁定 期内	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股 锁定 期内	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股 锁定 期内	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股 锁定 期内	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 锁定 期内	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股 锁定 期内	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股 锁定 期内	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股 锁定 期内	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股 锁定 期内	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股 锁定 期内	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股 锁定 期内	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股 锁定 期内	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股 锁定 期内	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股 锁定 期内	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股 锁定 期内	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股 锁定 期内	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股 锁定 期内	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股 锁定 期内	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定 期内	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股 锁定 期内	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股 锁定 期内	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股 锁定 期内	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股 锁定 期内	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-

301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股 锁定 期内	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股 锁定 期内	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股 锁定 期内	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股 锁定 期内	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股 锁定 期内	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 锁定 期内	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-

601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	配股 流通受限	2.02	2.64	136,320	275,366.40	359,884.80	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 锁定 期内	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股 锁定 期内	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股 锁定 期内	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股 锁定 期内	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股 锁定 期内	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股 锁定 期内	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股 锁定 期内	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股 锁定 期内	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	37.88	29.49	2,765	104,738.20	81,539.85	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.10	17.04	6,017	66,788.70	102,529.68	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股 锁定 期内	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股 锁定 期内	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股 锁定 期内	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股 锁定 期内	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股 锁定 期内	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股 锁定 期内	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股 锁定 期内	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 锁定 期内	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股 未上 市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股 锁定 期内	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，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。

2、基金还可作为特定投资者，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。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、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设定限售期的新股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。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2022 年 12 月 31 日：同)。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 2023 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 2023 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							
银行存款	79,098,703.91	-	-	-	-	-	79,098,703.91
结算备付金	10,530,023.61	-	-	-	-	-	10,530,023.61
存出保证金	322,840.36	-	-	-	-	-	322,840.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,260,149,883.24	1,260,149,883.24
应收申购款	-	-	-	-	-	227,778.29	227,778.29
应收清算款	-	-	-	-	-	3,937,061.37	3,937,061.37
资产总计	89,951,567.88	-	-	-	-	1,264,314,722.90	1,354,266,290.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	494,934.13	494,934.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,167,555.57	1,167,555.57
应付托管费	-	-	-	-	-	291,888.89	291,888.89
应付清算款	-	-	-	-	-	4,811,681.07	4,811,681.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,670.76	31,670.76
其他负债	-	-	-	-	-	1,547,770.01	1,547,770.01
负债总计	-	-	-	-	-	8,345,500.43	8,345,500.43
利率敏感度缺口	89,951,567.88	-	-	-	-	-1,255,969,222.47	1,345,920,790.35

上年度末 2022 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							
银行存款	106,691,887.25	-	-	-	-	-	106,691,887.25
结算备付金	2,271,916.62	-	-	-	-	-	2,271,916.62
存出保证金	235,330.74	-	-	-	-	-	235,330.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,680,207,488.99	1,680,207,488.99
应收申购款	-	-	-	-	-	390,989.25	390,989.25
应收清算款	-	-	-	-	-	142,107.15	142,107.15
资产总计	109,199,134.61	-	-	-	-	1,680,740,585.39	1,789,939,720.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	291,110.33	291,110.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,554,728.59	1,554,728.59
应付托管费	-	-	-	-	-	388,682.14	388,682.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	65,576.67	65,576.67
其他负债	-	-	-	-	-	1,210,334.27	1,210,334.27
负债总计	-	-	-	-	-	3,510,432.00	3,510,432.00
利率敏感度缺口	109,199,134.61	-	-	-	-	-1,677,230,153.39	1,786,429,288.00

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,260,149,883.24	93.63	1,680,207,488.99	94.05
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,260,149,883.24	93.63	1,680,207,488.99	94.05

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	57,564,381.55	78,811,430.75
	沪深 300 指数下降 5%	-57,564,381.55	-78,811,430.75

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,257,433,601.93	1,676,602,041.21
第二层次	1,086,689.70	—
第三层次	1,629,591.61	3,605,447.78
合计	1,260,149,883.24	1,680,207,488.99

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 2023 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（2022 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	1,260,149,883.24	93.05
	其中：股票	1,260,149,883.24	93.05
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	89,628,727.52	6.62
8	其他各项资产	4,487,680.02	0.33
9	合计	1,354,266,290.78	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	13,956,095.10	1.04
B	采矿业	46,792,285.53	3.48
C	制造业	701,975,384.17	52.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,147,176.02	2.39
E	建筑业	38,601,874.29	2.87
F	批发和零售业	29,444,745.39	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	26,922,208.60	2.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,213,072.06	4.92
J	金融业	257,178,430.46	19.11
K	房地产业	19,941,885.62	1.48
L	租赁和商务服务业	15,516,191.54	1.15
M	科学研究和技术服务业	3,680,671.43	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,741,253.60	0.58
S	综合	-	-
	合计	1,260,149,883.24	93.63

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	27,002	45,660,382.00	3.39
2	300750	宁德时代	174,680	39,965,037.20	2.97
3	601318	中国平安	553,156	25,666,438.40	1.91
4	600036	招商银行	630,156	20,643,910.56	1.53
5	000333	美的集团	325,400	19,172,568.00	1.42
6	000001	平安银行	1,469,237	16,499,531.51	1.23
7	601336	新华保险	415,611	15,282,016.47	1.14
8	601166	兴业银行	889,030	13,913,319.50	1.03
9	000858	五粮液	84,608	13,839,330.56	1.03
10	601398	工商银行	2,840,000	13,688,800.00	1.02
11	002594	比亚迪	51,100	13,197,597.00	0.98
12	601328	交通银行	2,254,600	13,076,680.00	0.97
13	601601	中国太保	503,181	13,072,642.38	0.97
14	600919	江苏银行	1,690,754	12,427,041.90	0.92
15	601818	光大银行	3,889,900	11,941,993.00	0.89
16	601211	国泰君安	849,522	11,884,812.78	0.88
17	300532	今天国际	552,900	11,367,624.00	0.84
18	601899	紫金矿业	982,349	11,169,308.13	0.83
19	601717	郑煤机	874,900	10,892,505.00	0.81
20	601137	博威合金	696,000	10,829,760.00	0.80
21	002475	立讯精密	332,500	10,789,625.00	0.80
22	688599	天合光能	242,280	10,323,550.80	0.77
23	600566	济川药业	349,500	10,149,480.00	0.75
24	000776	广发证券	686,400	10,096,944.00	0.75
25	603688	石英股份	88,100	10,029,304.00	0.75
26	600901	江苏金租	2,392,460	9,880,859.80	0.73
27	688390	固德威	58,935	9,833,894.10	0.73
28	600050	中国联通	2,047,400	9,827,520.00	0.73
29	000568	泸州老窖	46,100	9,661,177.00	0.72
30	601668	中国建筑	1,682,000	9,654,680.00	0.72
31	000933	神火股份	738,059	9,594,767.00	0.71
32	688063	派能科技	48,083	9,532,454.75	0.71
33	688002	睿创微纳	206,982	9,272,793.60	0.69
34	601377	兴业证券	1,491,200	9,126,144.00	0.68
35	600483	福能股份	779,881	9,007,625.55	0.67
36	600030	中信证券	453,909	8,978,320.02	0.67
37	600428	中远海特	1,409,300	8,878,590.00	0.66

38	002244	滨江集团	990,200	8,733,564.00	0.65
39	600039	四川路桥	853,580	8,373,619.80	0.62
40	002304	洋河股份	63,600	8,353,860.00	0.62
41	600809	山西汾酒	44,978	8,324,078.46	0.62
42	300349	金卡智能	586,600	8,142,008.00	0.60
43	000596	古井贡酒	32,500	8,039,850.00	0.60
44	688006	杭可科技	261,160	7,957,545.20	0.59
45	002223	鱼跃医疗	219,400	7,896,206.00	0.59
46	603368	柳药集团	317,700	7,850,367.00	0.58
47	300433	蓝思科技	663,900	7,807,464.00	0.58
48	600438	通威股份	225,421	7,734,194.51	0.57
49	603369	今世缘	141,299	7,460,587.20	0.55
50	002384	东山精密	280,000	7,252,000.00	0.54
51	002458	益生股份	577,400	7,130,890.00	0.53
52	002600	领益智造	1,029,700	7,115,227.00	0.53
53	300861	美畅股份	163,418	7,087,438.66	0.53
54	301039	中集车辆	530,400	7,017,192.00	0.52
55	600060	海信视像	282,553	6,993,186.75	0.52
56	300775	三角防务	206,500	6,975,570.00	0.52
57	000951	中国重汽	411,300	6,930,405.00	0.51
58	600026	中远海能	542,900	6,862,256.00	0.51
59	688630	芯碁微装	81,194	6,821,919.88	0.51
60	002139	拓邦股份	521,800	6,809,490.00	0.51
61	605117	德业股份	44,636	6,675,313.80	0.50
62	688188	柏楚电子	35,300	6,656,168.00	0.49
63	300860	锋尚文化	119,500	6,625,080.00	0.49
64	002518	科士达	161,800	6,473,618.00	0.48
65	002027	分众传媒	943,900	6,427,959.00	0.48
66	600057	厦门象屿	729,600	6,347,520.00	0.47
67	600481	双良节能	452,461	6,325,404.78	0.47
68	000591	太阳能	930,500	6,308,790.00	0.47
69	002299	圣农发展	327,794	6,277,255.10	0.47
70	300122	智飞生物	140,860	6,226,012.00	0.46
71	601618	中国中冶	1,561,900	6,200,743.00	0.46
72	600048	保利发展	475,800	6,199,674.00	0.46
73	688516	奥特维	32,600	6,141,840.00	0.46
74	002736	国信证券	698,200	6,095,286.00	0.45
75	601619	嘉泽新能	1,337,400	6,085,170.00	0.45
76	601138	工业富联	241,300	6,080,760.00	0.45
77	600038	中直股份	152,200	6,060,604.00	0.45
78	300827	上能电气	162,939	5,873,950.95	0.44
79	600741	华域汽车	317,149	5,854,570.54	0.43
80	000528	柳工	739,610	5,842,919.00	0.43

81	000063	中兴通讯	123,000	5,601,420.00	0.42
82	601699	潞安环能	340,300	5,553,696.00	0.41
83	002371	北方华创	17,202	5,464,215.30	0.41
84	000739	普洛药业	307,500	5,455,050.00	0.41
85	300457	赢合科技	302,300	5,338,618.00	0.40
86	601872	招商轮船	911,140	5,275,500.60	0.39
87	600021	上海电力	483,800	5,210,526.00	0.39
88	600999	招商证券	376,528	5,109,484.96	0.38
89	601012	隆基绿能	174,960	5,016,103.20	0.37
90	300450	先导智能	136,334	4,931,200.78	0.37
91	603609	禾丰股份	533,400	4,853,940.00	0.36
92	002965	祥鑫科技	86,300	4,805,184.00	0.36
93	600309	万华化学	54,200	4,760,928.00	0.35
94	601958	金钼股份	419,300	4,675,195.00	0.35
95	603225	新凤鸣	421,200	4,654,260.00	0.35
96	000408	藏格矿业	203,900	4,602,023.00	0.34
97	002444	巨星科技	208,800	4,568,544.00	0.34
98	603129	春风动力	28,200	4,565,580.00	0.34
99	300724	捷佳伟创	40,570	4,558,039.50	0.34
100	603392	万泰生物	67,416	4,501,366.32	0.33
101	002929	润建股份	102,300	4,440,843.00	0.33
102	002459	晶澳科技	106,281	4,431,917.70	0.33
103	002466	天齐锂业	63,300	4,425,303.00	0.33
104	300274	阳光电源	36,900	4,303,647.00	0.32
105	000728	国元证券	657,660	4,287,943.20	0.32
106	600985	淮北矿业	372,100	4,286,592.00	0.32
107	601390	中国中铁	559,873	4,243,837.34	0.32
108	600028	中国石化	666,600	4,239,576.00	0.31
109	600489	中金黄金	403,900	4,172,287.00	0.31
110	688408	中信博	49,200	4,149,036.00	0.31
111	002142	宁波银行	163,600	4,139,080.00	0.31
112	600585	海螺水泥	173,700	4,123,638.00	0.31
113	600256	广汇能源	596,440	4,091,578.40	0.30
114	601186	中国铁建	409,800	4,036,530.00	0.30
115	002179	中航光电	88,530	4,014,835.50	0.30
116	600989	宝丰能源	317,121	3,998,895.81	0.30
117	000923	河钢资源	295,300	3,986,550.00	0.30
118	601975	招商南油	1,388,500	3,971,110.00	0.30
119	002484	江海股份	186,200	3,964,198.00	0.29
120	300316	晶盛机电	55,500	3,934,950.00	0.29
121	601288	农业银行	1,113,500	3,930,655.00	0.29
122	600276	恒瑞医药	81,500	3,903,850.00	0.29
123	002155	湖南黄金	316,060	3,855,932.00	0.29

124	603383	顶点软件	69,100	3,829,522.00	0.28
125	688711	宏微科技	65,400	3,815,436.00	0.28
126	603185	弘元绿能	48,876	3,643,705.80	0.27
127	601658	邮储银行	725,042	3,545,455.38	0.26
128	300332	天壕环境	306,000	3,509,820.00	0.26
129	600958	东方证券	360,408	3,495,957.60	0.26
130	002609	捷顺科技	299,200	3,488,672.00	0.26
131	600732	爱旭股份	112,680	3,464,910.00	0.26
132	601231	环旭电子	231,600	3,464,736.00	0.26
133	002937	兴瑞科技	137,000	3,370,200.00	0.25
134	002056	横店东磁	185,000	3,368,850.00	0.25
135	000100	TCL 科技	836,230	3,294,746.20	0.24
136	002727	一心堂	124,600	3,289,440.00	0.24
137	605009	豪悦护理	68,300	3,278,400.00	0.24
138	603883	老百姓	109,500	3,268,575.00	0.24
139	000034	神州数码	121,233	3,223,585.47	0.24
140	688239	航宇科技	46,000	3,217,700.00	0.24
141	300896	爱美客	7,200	3,203,640.00	0.24
142	600502	安徽建工	586,000	3,094,080.00	0.23
143	601998	中信银行	516,300	3,087,474.00	0.23
144	600570	恒生电子	67,900	3,007,291.00	0.22
145	603233	大参林	106,691	2,988,414.91	0.22
146	000498	山东路桥	465,400	2,987,868.00	0.22
147	002373	千方科技	217,900	2,972,156.00	0.22
148	002572	索菲亚	170,200	2,964,884.00	0.22
149	603456	九洲药业	106,900	2,926,922.00	0.22
150	603259	药明康德	46,633	2,905,702.23	0.22
151	001979	招商蛇口	222,554	2,899,878.62	0.22
152	601728	中国电信	509,100	2,866,233.00	0.21
153	605123	派克新材	26,100	2,835,765.00	0.21
154	600398	海澜之家	410,200	2,822,176.00	0.21
155	688261	东微半导	19,920	2,786,210.40	0.21
156	605168	三人行	31,891	2,740,712.54	0.20
157	688578	艾力斯	98,953	2,666,783.35	0.20
158	002925	盈趣科技	136,907	2,655,995.80	0.20
159	300059	东方财富	186,672	2,650,742.40	0.20
160	002583	海能达	452,700	2,630,187.00	0.20
161	600998	九州通	252,952	2,625,641.76	0.20
162	300866	安克创新	29,900	2,616,250.00	0.19
163	600066	宇通客车	175,800	2,591,292.00	0.19
164	600745	闻泰科技	52,800	2,581,920.00	0.19
165	600183	生益科技	179,770	2,552,734.00	0.19
166	002563	森马服饰	406,000	2,525,320.00	0.19

167	002212	天融信	259,800	2,520,060.00	0.19
168	601077	渝农商行	701,400	2,518,026.00	0.19
169	600929	雪天盐业	312,750	2,483,235.00	0.18
170	601169	北京银行	535,000	2,477,050.00	0.18
171	603939	益丰药房	66,420	2,457,540.00	0.18
172	000488	晨鸣纸业	504,600	2,447,310.00	0.18
173	000768	中航西飞	91,349	2,443,585.75	0.18
174	603279	景津装备	77,253	2,422,654.08	0.18
175	000876	新希望	205,900	2,404,912.00	0.18
176	601229	上海银行	416,800	2,396,600.00	0.18
177	002493	荣盛石化	204,000	2,374,560.00	0.18
178	000915	华特达因	67,100	2,367,959.00	0.18
179	000726	鲁泰 A	346,100	2,367,324.00	0.18
180	603218	日月股份	123,200	2,339,568.00	0.17
181	300232	洲明科技	253,400	2,316,076.00	0.17
182	600546	山煤国际	158,800	2,297,836.00	0.17
183	603799	华友钴业	49,200	2,258,772.00	0.17
184	002402	和而泰	132,770	2,254,434.60	0.17
185	000913	钱江摩托	122,600	2,234,998.00	0.17
186	603501	韦尔股份	22,770	2,232,370.80	0.17
187	601766	中国中车	338,700	2,201,550.00	0.16
188	000895	双汇发展	88,200	2,160,018.00	0.16
189	300014	亿纬锂能	35,500	2,147,750.00	0.16
190	000537	广宇发展	180,700	2,108,769.00	0.16
191	002756	永兴材料	33,223	2,080,092.03	0.15
192	688508	芯朋微	35,200	2,041,248.00	0.15
193	002829	星网宇达	46,200	2,029,566.00	0.15
194	301030	仕净科技	28,500	1,969,350.00	0.15
195	300693	盛弘股份	53,107	1,960,710.44	0.15
196	601111	中国国航	234,800	1,934,752.00	0.14
197	600346	恒力石化	134,200	1,923,086.00	0.14
198	688223	晶科能源	136,440	1,918,346.40	0.14
199	000792	盐湖股份	99,200	1,901,664.00	0.14
200	300119	瑞普生物	104,700	1,863,660.00	0.14
201	300454	深信服	16,150	1,828,987.50	0.14
202	300682	朗新科技	76,300	1,776,264.00	0.13
203	603032	德新科技	50,440	1,742,197.60	0.13
204	000301	东方盛虹	145,600	1,720,992.00	0.13
205	300910	瑞丰新材	32,190	1,619,157.00	0.12
206	000893	亚钾国际	69,800	1,601,212.00	0.12
207	688123	聚辰股份	29,600	1,590,112.00	0.12
208	601838	成都银行	129,600	1,582,416.00	0.12
209	603027	千禾味业	73,500	1,552,320.00	0.12

210	600582	天地科技	252,597	1,472,640.51	0.11
211	002876	三利谱	44,200	1,466,114.00	0.11
212	601615	明阳智能	80,000	1,350,400.00	0.10
213	300760	迈瑞医疗	4,500	1,349,100.00	0.10
214	000878	云南铜业	120,700	1,333,735.00	0.10
215	600755	厦门国贸	171,800	1,329,732.00	0.10
216	000725	京东方 A	314,100	1,284,669.00	0.10
217	002938	鹏鼎控股	52,300	1,270,367.00	0.09
218	601939	建设银行	201,200	1,259,512.00	0.09
219	600061	国投资本	172,540	1,228,484.80	0.09
220	603317	天味食品	81,100	1,184,871.00	0.09
221	300638	广和通	51,880	1,176,638.40	0.09
222	600918	中泰证券	167,600	1,158,116.00	0.09
223	601916	浙商银行	434,620	1,147,396.80	0.09
224	300144	宋城演艺	90,014	1,116,173.60	0.08
225	600863	内蒙华电	264,800	1,098,920.00	0.08
226	600801	华新水泥	86,671	1,070,386.85	0.08
227	002283	天润工业	155,200	996,384.00	0.07
228	600821	金开新能	129,300	890,877.00	0.07
229	601577	长沙银行	114,600	889,296.00	0.07
230	002123	梦网科技	66,000	877,140.00	0.07
231	688556	高测股份	15,995	849,974.30	0.06
232	603345	安井食品	5,700	836,760.00	0.06
233	000552	甘肃能化	228,700	761,571.00	0.06
234	601222	林洋能源	87,500	716,625.00	0.05
235	603229	奥翔药业	33,500	702,830.00	0.05
236	688009	中国通号	112,291	651,287.80	0.05
237	601311	骆驼股份	66,700	618,976.00	0.05
238	000860	顺鑫农业	17,400	586,206.00	0.04
239	002714	牧原股份	13,000	547,950.00	0.04
240	603127	昭衍新药	12,806	523,765.40	0.04
241	000898	鞍钢股份	177,700	494,006.00	0.04
242	603529	爱玛科技	14,500	467,190.00	0.03
243	002987	京北方	20,600	451,552.00	0.03
244	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
245	688621	阳光诺和	4,026	236,809.32	0.02
246	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
247	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
248	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
249	688472	阿特斯	6,017	102,529.68	0.01
250	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
251	688443	智翔金泰	2,765	81,539.85	0.01
252	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01

253	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
254	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
255	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
256	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
257	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
258	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
259	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
260	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
261	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
262	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
263	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
264	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
265	600859	王府井	1,500	29,685.00	0.00
266	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
267	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
268	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
269	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
270	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
271	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
272	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
273	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
274	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
275	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
276	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
277	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
278	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
279	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
280	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
281	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
282	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
283	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
284	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
285	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
286	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
287	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
288	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
289	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
290	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
291	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
292	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
293	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
294	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
295	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00

296	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
297	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
298	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
299	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
300	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
301	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
302	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
303	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
304	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
305	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
306	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
307	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
308	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
309	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
310	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
311	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
312	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
313	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
314	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
315	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
316	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
317	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
318	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
319	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
320	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
321	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
322	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
323	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
324	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
325	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
326	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
327	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
328	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
329	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
330	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
331	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
332	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

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	000333	美的集团	20,051,616.00	1.12

2	600036	招商银行	17,925,597.00	1.00
3	000776	广发证券	14,905,682.00	0.83
4	601318	中国平安	14,890,941.00	0.83
5	603688	石英股份	14,794,204.00	0.83
6	300750	宁德时代	13,637,175.00	0.76
7	000725	京东方 A	13,548,730.00	0.76
8	600483	福能股份	13,204,146.32	0.74
9	600039	四川路桥	13,153,542.00	0.74
10	002594	比亚迪	13,090,039.00	0.73
11	688390	固德威	13,052,594.94	0.73
12	601818	光大银行	12,861,560.00	0.72
13	002463	沪电股份	12,757,870.70	0.71
14	600256	广汇能源	12,455,010.69	0.70
15	002518	科士达	12,162,154.00	0.68
16	002335	科华数据	11,918,731.00	0.67
17	688063	派能科技	11,516,530.49	0.64
18	600026	中远海能	11,437,618.00	0.64
19	688123	聚辰股份	11,363,622.49	0.64
20	601998	中信银行	11,230,425.00	0.63

注：不考虑其他交易费用。

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	601658	邮储银行	23,767,170.00	1.33
2	002463	沪电股份	20,886,277.80	1.17
3	600519	贵州茅台	19,978,140.95	1.12
4	601288	农业银行	19,516,781.00	1.09
5	601328	交通银行	18,871,943.00	1.06
6	601728	中国电信	17,337,292.00	0.97
7	600873	梅花生物	17,002,649.00	0.95
8	688123	聚辰股份	15,975,907.94	0.89
9	300866	安克创新	15,657,401.52	0.88
10	600060	海信视像	15,606,802.00	0.87
11	601881	中国银河	14,306,605.00	0.80
12	601601	中国太保	14,199,257.68	0.79
13	601318	中国平安	14,142,662.00	0.79
14	000921	海信家电	13,758,585.26	0.77
15	300308	中际旭创	13,141,171.84	0.74
16	300390	天华新能	12,845,758.92	0.72
17	002597	金禾实业	12,540,811.00	0.70
18	603369	今世缘	12,456,980.00	0.70
19	601012	隆基绿能	12,168,266.72	0.68

20	000568	泸州老窖	12,112,696.00	0.68
----	--------	------	---------------	------

注：不考虑其他交易费用。

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	1,586,723,018.27
卖出股票收入（成交）总额	2,020,125,124.94

注：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。本报告期间基金遇到大额申赎时，我们有使用股指期货套保保持仓位。

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，兴业银行（601166）于 2022 年 9 月 9 日及 2022 年 9 月 28 日受到银保监会的处罚，因违反审慎经营规则及存款业务违规，违规办理同业业务，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，故分别罚款 150 万元和 450 万元。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，

由基金经理决定具体投资行为。

本基金本报告期末投资的前十名证券中，招商银行（600036）于 2022 年 8 月 31 日收到中国人民银行下发的银罚决字[2022]1 号，因违反国库管理规定,违反征信管理规定,违反清算管理规定,违反支付结算管理规定,违反账户管理规定,违反银行结算账户业务规定,未按规定履行客户身份识别义务,未按规定报送大额交易或者可疑交易报告,其他违规行为，对招商银行处以没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 万元的处罚。同时银保监会于 2022 年 9 月 9 日下发银保监罚决字[2022]48 号，罚款 460 万元。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

报告期内基金投资的前十名其他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。

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	322,840.36
2	应收清算款	3,937,061.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	227,778.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,487,680.02

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 量化增强 混合 A	155,499	5,951.85	510,291,188.72	55.14	415,215,234.85	44.86
华泰柏瑞 量化增强 混合 C	1,385	21,418.35	17,804,641.84	60.02	11,859,767.47	39.98
合计	156,842	6,090.02	528,095,830.56	55.29	427,075,002.32	44.71

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	华泰柏瑞量化增强混合 A	379,531.86	0.0410
	华泰柏瑞量化增强混合 C	0.00	0.0000
	合计	379,531.86	0.0397

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	华泰柏瑞量化增强混合 A	10~50
	华泰柏瑞量化增强混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化增强混合 A	0~10
	华泰柏瑞量化增强混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化增强混合 A	华泰柏瑞量化增强混合 C
基金合同生效日 (2013 年 8 月 2 日) 基金份额总额	333,186,365.72	—
本报告期期初基金份 额总额	1,182,118,757.93	98,039,196.44
本报告期基金总申购 份额	186,613,269.08	83,318,855.69
减：本报告期基金总 赎回份额	443,225,603.44	151,693,642.82
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	925,506,423.57	29,664,409.31

§ 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

2023 年 4 月 18 日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

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

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

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(%)	
浙商证券	3	1,319,326,014.55	36.76	951,631.79	33.85	-
海通证券	3	1,264,541,534.17	35.23	924,745.14	32.90	-
东方证券	1	684,159,600.68	19.06	637,160.36	22.67	-
招商证券	1	163,964,185.05	4.57	151,060.02	5.37	-
广发证券	1	157,241,022.06	4.38	146,435.08	5.21	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。

3) 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) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本报告期内, 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 (%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-

券						
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中原证 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旗下基金参与浙商银行股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 28 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 27 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	2023 年 6 月 21 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 16 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 3 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	2023 年 5 月 9 日

7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 29 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 19 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 14 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	2023 年 4 月 11 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 30 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 22 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 21 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 10 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 23 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与博时财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 08 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

2023 年 8 月 31 日